



МОСКОВСКАЯ  
БИРЖА



**СПЕТРА. Вынесение расчета  
комиссий из ядра.**

# Комиссии в SPECTRA AS IS

В настоящее время:

- Биржевые комиссии рассчитываются ядром.
- Комиссии учитываются в требованиях к обеспечению в момент заключения сделки.
- Комиссии указываются в потоке приватных данных по сделкам в режиме реального времени.
- Комиссии рассылаются в брокерских отчетах после клиринга.



## В релизе 5.0 будет следующая логика

- В ядре остаётся расчет `initial_fee` – фиксированной комиссии для каждого инструмента.
- `Initial_fee` учитывается в требованиях к обеспечению, вызывая перемаржирование.
- `Initial_fee` публикуется в полях `fee_buy/fee_sell` потока сделок.
- Сервер биллинга рассчитывает `adjusted_fee` – окончательную комиссию, которая учитывает все возможные виды скидок.
- `adjusted_fee` рассылается в потоке данных ядру и клиентам.
- `adjusted_fee` заменяет `initial_fee` в требованиях к обеспечению в ядре.



# Комментарии к окончательной схеме трансляции комиссий

- Поток комиссий будет задерживаться относительно потока сделок на время порядка 1 мин.
- Новый поток комиссий не будет содержать информацию по сделкам экспирации/исполнения, т.к. они не тарифицируются биллинговым модулем (тарификация таких сделок остается в клиринговом модуле).
- Клиринговые отчеты (по части биллинга) остаются без изменений и будут содержать уже окончательно рассчитанную комиссию `adjusted_fee`.



# Timeline изменений в системе SPECTRA

Время

## Этап 1, март 2016

- Запуск сервера биллинга на **Т-полигоне**
- В потоке сделок в поле fee находится initial\_fee.
- В потоке комиссий в полях initial\_fee и adjusted\_fee находится соответственно начальная и окончательная комиссии

## Этап 2, июнь 2016

- Запуск сервера биллинга в **продакшене**
- В потоке сделок в поле fee находится initial\_fee.
- В потоке комиссий в полях initial\_fee и adjusted\_fee находится соответственно начальная и окончательная комиссии



# Изменения в схемах данных

- Поток FORTS\_FUTTRADE\_REPL и FORTS\_OPTTRADE\_REPL
  - Таблицы user\_deal, deal.
    - Field = fee\_buy, d26.2*; трансляция initial\_fee покупателя
    - Field = fee\_sell, d26.2* ; трансляция initial\_fee продавца
- Поток **FORTS\_FEE\_REPL** содержит таблицу **adjusted\_fee**

Поле	Тип	Описание
replID	i8	Служебное поле подсистемы репликации
replRev	i8	Служебное поле подсистемы репликации
replAct	i8	Служебное поле подсистемы репликации
id_deal	i8	Номер сделки
moment	t	Время заключения сделки
code_buy	c7	Код покупателя
code_sell	c7	Код продавца
initial_fee_buy	d26.2	Сбор по сделке покупателя, грубо
initial_fee_sell	d26.2	Сбор по сделке продавца, грубо
adjusted_fee_buy	d26.2	Сбор по сделке покупателя, точно
adjusted_fee_sell	d26.2	Сбор по сделке продавца, точно
id_repo	i8	Номер одной части сделки по связке
id_deal_multileg	i8	Номер сделки по всей связке



# Контактная информация

- Тел.: **+7(495) 363-32-32**
  - Олег Дюкель
  - Дмитрий Абрамов
  - Алексей Ерпылев
- Email: [help@moex.com](mailto:help@moex.com)

