

Январь 2018

Модуль ForecastIM



МОСКОВСКАЯ
БИРЖА

Описание сервиса

ForecastIM – модуль, рассчитывающий предполагаемое значение денежных средств участников после раздвижки планок

- Модуль предварительно рассчитывает свободные средства участников в предположении, что случилась раздвижка по инструментам, лежащим на планке.

Алгоритм работы

- Раз в минуту модуль опрашивает состояние рынка по инструментам и находит те, которые лежат на планке.
- Если такие инструменты присутствуют, то происходит перерасчет ГО по клиентским портфелям. Риск-параметры по инструментам на планке изменены в соответствии с предполагаемой раздвижкой.
- Рассчитанные деньги отдаются в потоке реплики в формате, совместимом с форматом потока FORTS_PART_REPL.
- Таблицы `part_forecast` и `part_sa_forecast` содержат прогнозируемое состояние денежных средств по Брокерским Фирмам и Расчетным Кодам в случае увеличения диапазона колебаний цен сделок по инструментам, цена которых достигла верхнего/нижнего лимита колебания цен сделок.
- Модуль повторяет алгоритм каждую минуту.
- Старые данные зачищаются из потока.

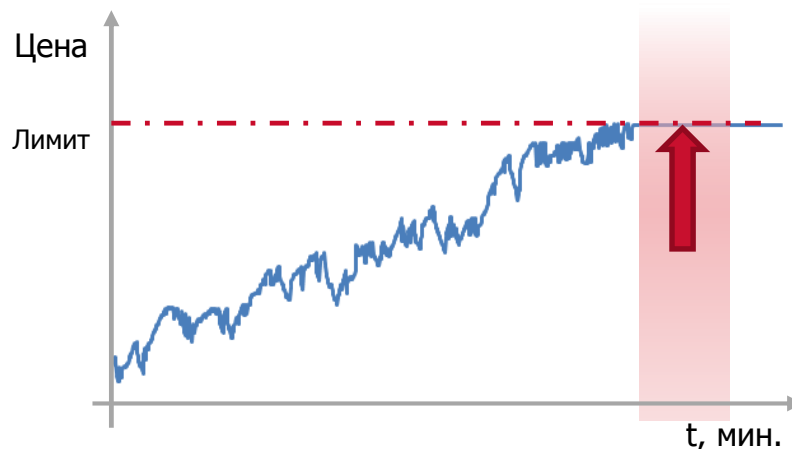


Пример работы сервиса (1/2)

1 В портфеле имеются заявки и позиции по опционам и фьючерсам на RTS и MXI. Под обеспечение данных позиций и заявок требуется 820980 р.

Счет/ПК	Всего денег	Свободно денег	Св. денег (прогноз)
OD	1,092,843,652.85	1,080,504,465.12	
OD06X	1,111,399.32	290,419.32	
OD06	1,111,399.32	290,419.32	
OD06001	1,000,000.00	179,020.00	
OD06000	111,399.32	111,399.32	

2 Инструмент RTS-6.17 ложится на планку. В течение 1 минуты лучшая цена на покупку равна верхнему лимиту.

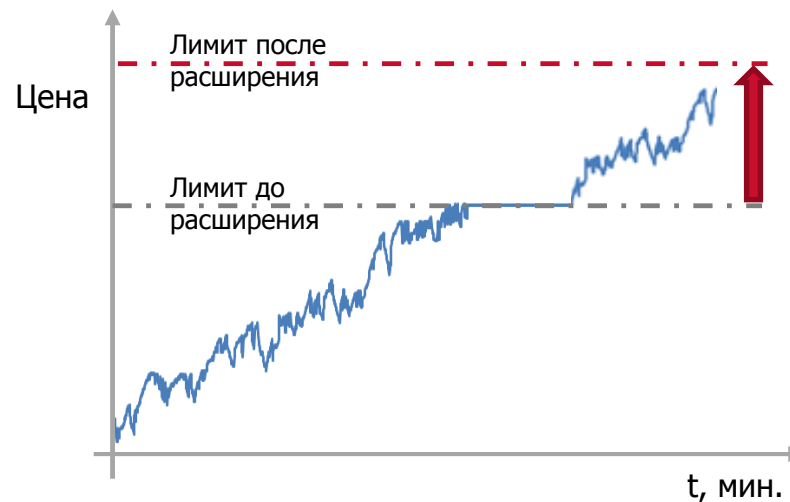


3 Сервис ForecastIM прогнозирует увеличение обеспечения до 1 436 040 р. Такое обеспечение приводит к отрицательному свободному лимиту на уровне ПК.*

Счет/ПК	Всего денег	Свободно денег	Св. денег (прогноз)
OD	1,092,843,652.85	1,080,504,465.12	
OD06X	1,111,399.32	290,419.32	-4,915.68
OD06	1,111,399.32	290,419.32	
OD06001	1,000,000.00	179,020.00	
OD06000	111,399.32	111,399.32	

Пример работы сервиса (2/2)

- 4** По истечении 5 минут происходит первое расширение лимитов.



- 5** В результате расширения требования под обеспечение увеличилось и свободные средства уменьшились до предсказанных значений.*

Счет/ПК	Всего денег	Свободно денег	Св. денег (прогноз)
OD	1,092,843,652.85	1,080,504,465.12	
OD06X	1,111,399.32	-4,915.68	
OD06	1,111,399.32	-4,915.68	
OD06001	1,000,000.00	-116,315.00	
OD06000	111,399.32	111,399.32	



Контакты

Вопросы по работе сервиса можно направлять по адресам:

Email: help@moex.com, tdba@moex.com

Тел: +7 (495) 232 3363, +7 (495) 363 3232

