



## Клиентские SDMA логины на валютном рынке, спонсируемый доступ

### 1 Термины и определения

**Участники торгов (Участник)** – организации, допущенные к организованным торгам после выполнения установленных Биржей условий допуска.

**Клиент Участника (Клиент)** – юридическое или физическое лицо, зарегистрированное в соответствии с Правилами допуска к участию в торгах на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ОАО Московская Биржа, по поручению которого Участник торгов подает заявки в ТС с целью заключения сделок в соответствии с Правилами торгов.

**Спонсируемый доступ** – прямое подключение **Клиентов Участника** к инфраструктуре Биржи, минуя инфраструктуру **Участника**.

**АСП** – аналог собственноручной подписи.

**Поручение** – электронное сообщение, подписанное АСП Клиентом Участника, и поручающее Участнику совершить на Бирже то или иное действие.

**Заявка (торговый приказ)** – электронное сообщение, подписанное АСП Участника и являющееся предложением для других Участников торгов совершить ту или иную сделку.

**SMA\_ID** – идентификатор, с помощью которого Клиент Участника идентифицируется в торговой системе и от имени которого присылает поручения. С точки зрения реализации SMA-ID – торговый идентификатор (User ID) со специальным признаком.

**MASTER\_ID** – идентификатор Участника, с помощью которого Участник подсоединяется к Торговой системе, выставляет заявки, контролирует исполнение заявок.

**Cancel On Disconnect** – данный сервис включается для идентификатора и означает автоматическое снятие заявок, выставленных с данного идентификатора, при де-регистрации (logoff), потере соединения, неактивности превышающей заданный порог.

**Cancel On Drop-Copy Disconnect** - данный сервис включается для идентификатора SMA\_ID, при этом идентификатору назначается контрольный идентификатор (MASTER\_ID). Данный сервис означает, что при де-регистрации (logoff), потере соединения или неактивности заданного порога MASTER\_ID автоматически снимаются заявки, выставленные по поручениям от SMA\_ID.



## 2 Технологическая схема

Участник Торгов подает заявление в Клиентский Центр на получение SMA\_ID для подключения Клиента по Спонсируемому доступу. В заявлении он указывает:

1. MASTER\_ID1 и MASTER\_ID2 - Собственные технологические идентификаторы, с помощью которых будут выставляться заявки и производиться контроль торговых операций. Идентификаторы, используемые в качестве MASTER\_ID, должны обладать правом ставить заявки. Участник вправе указать один или два MASTER\_ID.
2. Регистрационный код клиента

Примечание: Участник вправе использовать один и тот же MASTER\_ID для более чем одного SMA\_ID.

Для SMA\_ID также указывается включение сервисов:

1. Cancel On Disconnect
2. Опционально устанавливается автоматическое снятие заявок при неактивности MASTER\_ID (см. Cancel On Drop-Copy Disconnect)
3. Устанавливается привязка «Треjder-счет» для SMA\_ID

### Процесс Обработки Поручений от Клиента

Клиент подключается к торговой системе используя SMA\_ID и отправляет в систему поручения, подписанные SMA\_ID.

При получении поручения торговая система выполняет:

1. базовые проверки
2. проверяет наличие активного соединения хотя бы одного из идентификаторов MASTER\_ID1 или MASTER\_ID2, связанного с SMA\_ID

## 3 Содержание разработки

В рамки проекта входит:

- Реализация SMA идентификаторов. Привязка SMA идентификатора к торговому идентификатору Участника (MASTER\_ID). Участник может указать 2 идентификатора MASTER\_ID1 и MASTER\_ID2.
- Проверка активности MASTER\_ID при получении поручения от SMA идентификатора.
- Выставление заявки на основе поручения, полученного от SMA идентификатора, путем добавления MASTER\_ID Участника.
- Отображение MASTER\_ID в таблице "Orders" шлюза.



- Изменения в отчетах по результатам торгов.

## **4 Описание функциональных блоков проекта**

### **4.1 Реализация SMA идентификаторов**

Новые поля в таблице “USERS” шлюза:

1. MASTER\_ID1 char(12)
2. MASTER\_ID2 char(12)
3. CODMODE\_DC (Y/N) (по умолчанию N) - Опциональное включение Cancel On Drop-Copy Disconnect.
4. MASTERUSERFLAG TYesNo (1) - Идентификатор является контролирующим Мастер Идентификатором.

#### **4.1.1 Изменения в таблице шлюза Orders**

В таблице Orders появляется новое поле ASP (CHAR(12))

Данное поле доступно всем пользователям Участника по полномочиям доступа к информации о заявках, за исключением SMA-клиентов.

Для не-SMA заявок участников в поле “ASP” записывается User ID.

Для SMA заявок в поле “ASP” записывается MASTER\_ID , в поле USERID записывается SMA\_ID.

См. **Пример отображения информации в таблицах шлюза и отчетах**

### **4.2 Обработка поручений от SMA\_ID**

При получении поручения от SMA\_ID проверяется, что

1. Для данного SMA\_ID есть связанный MASTER\_ID, то есть в таблице USERS установлены значения хотя бы в одном из полей MASTER\_ID1 и MASTER\_ID2.
2. Активно хотя бы одно из подключений MASTER\_ID1 или MASTER\_ID2 (см. таблицу ниже).

Если поручение не проходит проверку по одному из указанных выше пунктов, поручение отвергается.



Если поручение успешно прошло проверку, в новое поле “ASP” для сформированной заявки записывается связанный MASTER\_ID1 или MASTER\_ID2 (см таблицу ниже) и полученная заявка отправляется в обработку.

Обработка поручений в зависимости от состояний подключения MASTER\_ID1 и MASTER\_ID2:

<i>MASTER_ID1</i>	<i>MASTER_ID2</i>	<i>Поручение принимается (да/нет)</i>	<i>В ASP записывается</i>
Задан и Активен	Задан и Активен	Да	MASTER_ID1
Задан и Активен	Не задан или Неактивен	Да	MASTER_ID1
Не задан или Неактивен	Задан и Активен	Да	MASTER_ID2
Не задан или Неактивен	Не задан или Неактивен	НЕТ	- (заявка не регистрируется)

Если задан только один MASTER\_ID, то есть одно из полей MASTER\_ID1 или MASTER\_ID2 пустое, при проверке поручения учитывается только активность подключения по заданному идентификатору MASTER\_ID.

#### **4.2.1 Проверка активности MASTER\_ID**

Активность MASTER\_ID определяется по технологии аналогичной Cancel On Disconnect.

MASTER\_ID считается неактивным в случаях, описанных в документации к сервису Cancel On Disconnect, а именно при де-регистрации (logout) и отсутствии транзакционной активности более чем 20 сек.

Подробная информация:

[ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/ASTS/docs/Cancel\\_on\\_Disconnect\\_rus.pdf](ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/ASTS/docs/Cancel_on_Disconnect_rus.pdf)

Важно: в случае достижения временного порога неактивности производится принудительное отключение MASTER\_ID от системы – см. «Особенности реализации» в Cancel\_on\_Disconnect.pdf.

#### **4.2.2 Автоматическое снятие заявок при неактивности MASTER\_ID**

При установленном признаке CODMODE\_DC = Y для данного SMA\_ID система автоматически снимает заявки, поставленные по поручениям от SMA\_ID при обнаружении неактивности идентификаторов MASTER\_ID1 и MASTER\_ID2.

Если для SMA\_ID заданы два MASTER\_ID идентификатора, заявки снимаются при потере активности обоих идентификаторов.

Значение CODMODE\_DC устанавливается Администратором системы при создании SMA\_ID, если соответствующая опция выбрана Участником торгов при подаче заявления.

Например:

Заданы MASTER\_ID1 и MASTER\_ID2 и оба активны.



Произошло отключение MASTER\_ID1 – заявки НЕ снимаются.

Произошло отключение MASTER\_ID2 – заявки снимаются.

Если для SMA\_ID задан только один MASTER\_ID (не важно MASTER\_ID1 или MASTER\_ID2) – заявки снимаются после неактивности этого MASTER\_ID.

Снимаются только анонимные безадресные заявки с областью действия текущего торгового дня.

## 4.3 Изменения в отчетах

### 4.3.1 Изменения в отчете “Реестр заявок”

#### 4.3.1.1 Новое поле “ASP”

Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер
ASP	АСП Участника торгов	Да	Character	0-12

Поле ASP во всех случаях содержит АСП Участника торгов. В случае не-SMA поле содержит Торговый идентификатор Участника торгов (User ID), для SMA поле содержит MASTER\_ID.

Значение поля ASP всегда равно значению поля ASP в таблице Orders шлюза.

См. **Пример отображения информации в таблицах шлюза и отчетах**

#### 4.3.1.2 Логика заполнения поля “UserId”

Изменена логика заполнения поля UserId. В случае не-SMA поле содержит Торговый идентификатор Участника торгов (User ID) (т.е. сохраняется текущая логика заполнения поля).

Для SMA заявок поле UserId содержит Идентификатор Спонсируемого доступа (SMA\_ID).

Значение поля UserId всегда равно значению поля USERID в таблице Orders шлюза.



### **4.3.2 Изменения в отчете “Реестр сделок”**

#### **4.3.2.1 Логика заполнения поля “UserId”**

В случае не-SMA поле содержит Торговый идентификатор Участника торгов (User ID) (т.е. сохраняется текущая логика заполнения поля).

Для SMA заявок поле UserId содержит Идентификатор Спонсируемого доступа (SMA\_ID).

Значение поля UserId всегда равно значению поля USERID в таблице Trades шлюза.



## Приложение

### Пример отображения информации в таблицах шлюза и отчетах

#### USERS

USER_ID	MASTERUSERFLAG	MASTER_ID1	MASTER_ID2
MD08...AC	N	MD08...AD	
MD08...AD	Y		

MD08...AC – SMA\_ID – Идентификатор Спонсируемого доступа

MD08...AD – Идентификатор Участников Торгов (АСП)

#### ORDERS - информация в шлюзе

USER_ID	ASP	
MD08...AC	MD08...AD	Заявка по поручению от SMA клиента
MD08...AD	MD08...AD	Обычная заявка

#### Выписка из отчета по заявкам

UserId	ASP	
MD08...AC	MD08...AD	Заявка по поручению от SMA клиента
MD08...AD	MD08...AD	Обычная заявка