



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

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