

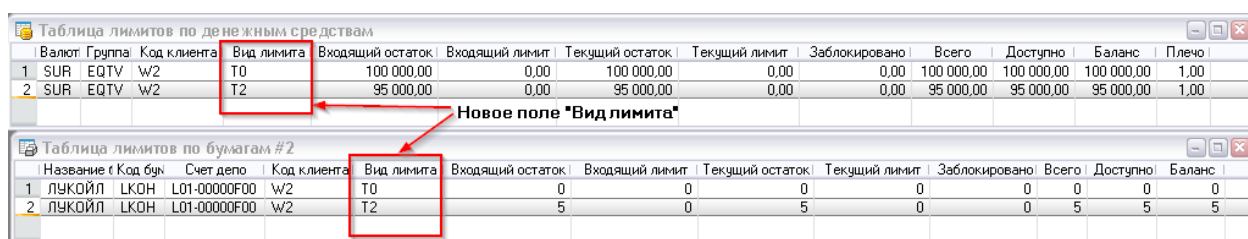
Правила работы с новыми видами лимитов

Лимиты

При предоставлении клиентам доступа к торгам инструментами с отложенными расчётами возникает необходимость ведения позиций в разрезе дат расчётов.

В новой версии торговой системы QUIK данная возможность реализована за счёт введения новых видов лимитов.

«Вид лимита» - это новое поле в бумажных и денежных лимитах с возможными значениями T0, T2.



Новое поле "Вид лимита"

Лимит «T0» учитывает фактические активы клиента с учётом сделок, рассчитывающихся сегодня (текущая позиция).

Например, если у клиента на начало дня есть 90 000 рублей и сегодня в 17:00 на бирже должна рассчитаться сделка объёмом 10 000 рублей (заключённая в режиме T+ два дня назад), то входящий лимит на начало дня у клиента будет составлять 100 000 рублей

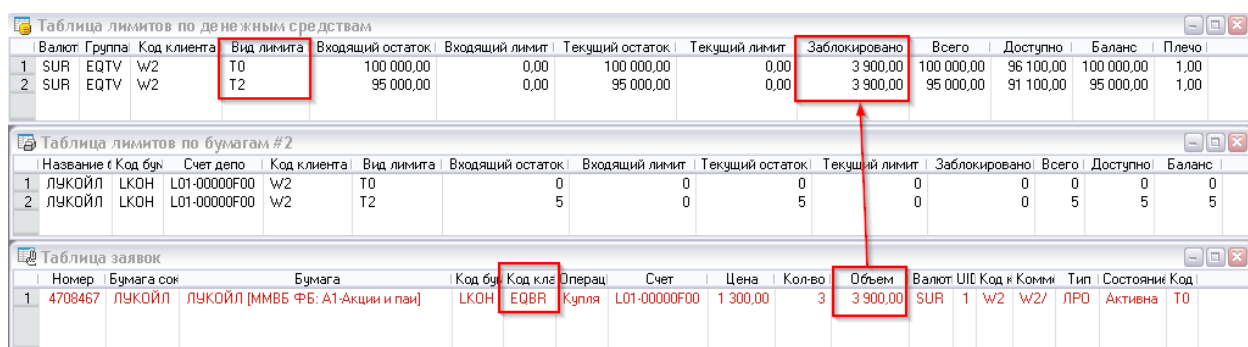
Лимит «T2» учитывает фактические активы клиента с учётом сделок, рассчитывающихся сегодня (т.е. то же самое что и «T0») плюс все сделки с расчётами «завтра и далее». Таким образом, лимит «T2» представляет собой плановую позицию клиента.

Если у клиента нет никаких нерассчитанных сделок с датой расчётов, начиная с завтрашней даты, то его лимит «T2» будет полностью повторять лимит «T0»

В примере на скриншоте у клиента есть сделка с расчётами, например, завтра по покупке 5 бумаг Лукойла объёмом 5 000 рублей. Соответственно, входящий остаток лимита «T2» по деньгам равен 95 000 рублей, а по бумагам равен 5-ти бумагам.

Выставление заявки

При выставлении заявки по инструментам с кодом расчётов «T0» происходит проверка покупательной способности клиента по текущей позиции (по лимитам «T0») и плановой позиции (по лимитам «T2»). Если средств достаточно, происходит блокировка необходимого объёма в лимитах:



После совершения сделки изменяются текущие остатки как по лимиту «Т0», так и по лимиту «Т2»

При выставлении заявки по инструментам с расчётами в Т+2 происходит проверка покупательной способности клиента только по плановой позиции (по лимитам Т2). Блокировка средств также выполняется только на одном виде лимита «Т2».

Таблица лимитов по денежным средствам

Валют	Группа	Код клиента	Вид лимита	Входящий остаток	Входящий лимит	Текущий остаток	Текущий лимит	Заблокировано	Всего	Доступно	Баланс	Плечо
1	SUR	EQTV	W2	T0	100 000,00	0,00	100 000,00	0,00	0,00	100 000,00	100 000,00	1,00
2	SUR	EQTV	W2	T2	95 000,00	0,00	95 000,00	0,00	3 900,00	95 000,00	91 100,00	1,00

Таблица лимитов по бумагам #2

Название	Код бик	Счет депоз	Код клиента	Вид лимита	Входящий остаток	Входящий лимит	Текущий остаток	Текущий лимит	Заблокировано	Всего	Доступно	Баланс
1	ЛУКОЙЛ	LKON	L01-00000F00	W2	T0	0	0	0	0	0	0	0
2	ЛУКОЙЛ	LKON	L01-00000F00	W2	T2	5	0	4	0	0	4	4

Таблица заявок

Номер	Бумага сок	Бумага	Код бик	Код кли	Операц	Счет	Цена	Кол-во	Объем	Валют	UID	Код к	Комм	Тип	Состояние	Код	
1	4739407	ЛУКОЙЛ	ЛУКОЙЛ [МБ ФР: Т+ А1-Акции, паи и РДР]	LKON	TQBR	Купля	L01-00000F00	1 300,00	3	3 900,00	SUR	1	W2	W2/	ЛПО	Активна	Y2

После совершения сделки изменяются текущие остатки только по виду лимита «Т2»

Таблица «Клиентский портфель»

В таблице «Клиентский портфель» также будет присутствовать две строки с разными видами лимитов. Значение плеча устанавливается в разрезе каждого вида лимитов, т.е. для сделок на рынке Т0 и рынке Т+ могут быть установлены разные плечи.

Сделка на рынке Т0 повлияет на рассчитываемые в таблице параметры для вида лимита «Т0» и вида лимита «Т2»

Сделка на рынке с отложенными расчётами повлияет только на параметры, отражённые в строке для вида лимита «Т2»

Для клиентов, работающих на рынке RTS Standard или Т+ до 05.08.2013

1. Счета типа «XXXXX-Q» будут удалены с 05.08.2013г.
2. Лимиты, которые раньше отображались на счёте типа «XXXXX-Q», будут отображаться на счёте «XXXXX» на лимитах вида «Т2».
3. В таблице «Клиентский портфель» параметры, отображающиеся на счёте «XXXXX-Q», будут отображаться на счёте «XXXXX» по виду лимита «Т2».
4. Какие-либо изменения в части ввода заявки на рынок RTS Standard отсутствуют.
5. Клиентам, работающим на рынке Т+ с 05.08.2013 необходимо при выставлении заявки в поле «Код клиента» указывать код вида «XXXXX», а не «XXXXX-Q» как в настоящий момент.