



Технические особенности реализации дополнительной (вечерней) торговой сессии на фондовом рынке

[Информацию об инструментах, расписании и периодах торгов, риск-менеджменте и т.д. см. в презентации «Параметры запуска вечерней сессии на фондовом рынке»]

Дополнительная сессия будет проводиться только на следующих бордах:

- TQBR – режим основных торгов T+;
- SMAL – режим «Неполные лоты»;
- PSEQ – режим переговорных сделок (с кодами расчетов, не предусматривающими исполнение сделки в день заключения: B01-Bn);
- RTEQ – РПС с ЦК (с кодами расчетов, не предусматривающими исполнение сделки в день заключения: Y1-Yn);

Изменения в шлюзовых интерфейсах

В новую версию шлюзового интерфейса IFCBroker36 добавляются следующие поля в существующие таблицы:

SECURITIES

Поле	Тип	Описание
TradingSession	CHAR(1)	Идентификатор текущей торговой сессии
EveningSession	CHAR(1)	Y - бумага может торговаться в дополнительную сессию, N - бумага не может торговаться в дополнительную сессию

Значение TradingSession относится именно к текущей сессии согласно расписанию и не является ключом, определяющим к какой из сессий относятся данные в полях таблицы. В ходе дополнительной сессии вся информация о торгах продолжает публиковаться в тех же строках/полях, что и в ходе основной сессии.

FIRMS

Поле	Тип	Описание
EveningSession	CHAR(1)	Флаг допуска фирмы для торгов в дополнительной сессии

ORDERS, ONEORDER, NEGDEALS, ONENEGDEAL, SECTTRANSFERS

Поле	Тип	Описание
TradingSession	CHAR(1)	Идентификатор торговой сессии, в которой была зарегистрирована заявка

TRADES, ALL_TRADES

Поле	Тип	Описание
TradingSession	CHAR(1)	Идентификатор торговой сессии, в которой была заключена сделка

Добавляются следующие таблицы:

TRADING_SESSION

Справочник торговых сессий

Поле	Тип	Описание
ID	CHAR(1)	Идентификатор
NAME	CHAR(30)	Наименование торговой сессии
SHORTNAME	CHAR(10)	Краткое наименование

Значения в таблице:

1	Основная сессия
2	Дополнительная сессия
3	Итоги дня

SEC_STATS

Биржевая информация по сессии.

Информация по итогам основной сессии добавляется в таблицу с TRADINGSESSION=1 после её завершения. Информация по итогам дополнительной сессии (TRADINGSESSION=2) и суммарная информация за весь торговый день (TRADINGSESSION=3) – после завершения дополнительной сессии.

Вся рыночная информация в режиме онлайн отображается в таблице SECURITIES как для основной, так и для дополнительной сессии.

Состав полей в таблице может быть скорректирован в ходе реализации и тестирования проекта.

Поле	Тип	Описание
SECBOARD	CHAR(4)	Режим
SECCODE	CHAR(12)	Инструмент
TRADINGSESSION	CHAR(1)	Идентификатор торговой сессии
TIME	TIME(6)	Время последней
PRICEMINUSPREVWAPPRICE	PRICE(10)	К оценке пред. дня
VOLTODAY	INTEGER	Количество за сегодня
LOWOFFER	PRICE(9)	Лучшее предложение
HIGHBID	PRICE(9)	Лучший спрос
HIGH	PRICE(9)	Максимум
LOW	PRICE(9)	Минимум
VALTODAY	INTEGER	Объем сегодня
WAPRICE	PRICE(9)	Оценка
OPEN	PRICE(9)	Открытие
LAST	PRICE(9)	Последняя
PREVPRICE	PRICE(9)	Последняя предыдущего дня
LASTOFFER	PRICE(9)	Предложение сессии

NUMTRADES	INTEGER	Сделок
LASTBID	PRICE(9)	Спрос сессии
ADMITTEDQUOTE	PRICE(9)	Признаваемая котировка
MARKETPRICETODAY	PRICE(9)	Рыночная цена
MARKETPRICE2	PRICE(9)	Рыночная цена 2
LCURRENTPRICE	PRICE(9)	Текущая цена
CLOSING_AUCTION_PRICE	PRICE(9)	Цена АЗ
LCLOSEPRICE	PRICE(9)	Цена закрытия
PREVLEGALCLOSEPRICE	PRICE(9)	Цена закрытия предыдущего дня
OPENPERIODPRICE	PRICE(9)	Цена предторгового периода

(полужирным шрифтом выделены ключевые поля)

События в расписании

Добавляются следующие новые типы событий, которые перечислены в таблице TRDTIMETYPES:

M4	Начало основной сессии
M5	Окончание основной сессии
V4	Начало дополнительной сессии
V5	Окончание дополнительной сессии

Существующие события в расписании не изменяются и для начала/завершения сессии будут по-прежнему использоваться события Normal trading start/end.

Пример расписания (данный пример не является полным расписанием в промышленной системе, а иллюстрирует логику последовательности событий):

Время	Тип	Событие	Торговая сессия
9:50:00	M4	Начало основной сессии	1
9:50:00	q	Начало аукциона открытия	1
9:59:30	s	Начало фазы случайного завершения АО	1
10:00:00	4	Normal trading start	1
10:00:00	t	Начало расчета текущей цены	1
18:39:59	5	Normal trading end	1
18:40:01	8	Начало аукциона закрытия	1
18:45:00	i	Начало фазы случайного завершения АЗ	1
18:50:00	l	Окончание торгов по цене АЗ	1
18:50:00	v	Окончание расчета текущей цены	1
18:50:00	z	Расчет официальной цены закрытия	1
18:50:00	n	Снятие активных заявок	1

19:00:00	M5	Окончание основной сессии	
19:00:00	V4	Начало дополнительной сессии	2
19:00:00	q	Начало аукциона открытия	2
19:04:30	s	Начало фазы случайного завершения АО	2
19:05:00	t	Начало расчета текущей цены	2
19:05:00	4	Normal trading start	2
23:50:00	5	Normal trading end	2
23:50:00	v	Окончание расчета текущей цены	2
23:50:00	n	Снятие активных заявок	2
23:50:00	V5	Окончание дополнительной сессии	

Итоги основной сессии на технических режимах

С целью предоставления итогов торгов в основной сессии участникам, не имеющим возможности доработать свои системы для работы с новым шлюзовым интерфейсом к моменту запуска проекта, будут добавлены следующие технологически борды:

MQBR - Осн.сес. Т+ Акции и ДР

MSML - Осн.сес. Т+ Неполные лоты

MSEQ - Осн.сес. РПС : Акции

MTEQ - Осн.сес. РПС с ЦК: Акции и ДР

Итоги торгов будут публиковаться на перечисленных режимах после завершения основной сессии, одновременно с добавлением информации в таблицу SEC_STATS.

Внимание: перечисленные борды реализуются на переходный период и будут удалены в конце 2020 года.

Протоколы FIX/FAST

Протоколы и шаблоны FAST не меняются.

Изменения в отчётах

В следующие торговые отчёты добавляется атрибут с номером сессии: SEM02, SEM03, SEM04.

В отчётах SEM21/SEM21A информация с итогами торгов будет сгруппирована в новой ноде с номером сессии.

Запускаются новые торговые отчеты:

«Ежедневный отчет об исполнении обязательств маркет-мейкеров» - SEM85

«Ежемесячный отчет об исполнении обязательств маркет-мейкеров» - SEM86

Структура клиринговых отчётов не меняется.

Для отчётов, рассылаемых по итогам каждой сессии, номер сессии будет отображаться в имени файла. Например: MM00001_SEM21_001 – отчёт за основную сессию, MC99999_SEM02_002 –

отчёт за дополнительной сессию. MM00001_SEM21_00T – отчёт со всеми сессиями за торговый день.