

Информационные объекты рынка

"FO3" - "Срочный рынок v 3.0"

Содержание

Перечислимые типы

TStatus - Статус

TBuySell - Направленность заявки

TTradingStatus - Состояние торгов по инструменту

TPutCall - Тип срочного инструмента

TDeliveryType - Вид расчётов

TTimeEvent - Тип события

TTimeStatus - Состояние события

Интерфейс "INFO" - "Информационный интерфейс"

Таблицы

ALL_TRADES - Все сделки

BOARDS - Режимы торгов

FOSECTYPES - Типы срочных инструментов

ORDERBOOK - Котировки

SECURITIES - Финансовые инструменты

TESYSTIME - Системное время торгового сервера

TRADETIME - Расписание торгов

Транзакции

Перечислимые типы

TStatus - Статус (длина: 1, тип: ekGroup)

Константа	Значение	Описание
A		Операции разрешены
S	=	Операции запрещены

TBuySell - Направленность заявки (длина: 1, тип: ekGroup)

Константа	Значение	Описание
B	K	Купля
S	П	Продажа

TTradingStatus - Состояние торгов по инструменту (длина: 1, тип: ekGroup)

Возможные состояния торгов по финансовому инструменту.

Константа	Значение	Описание
N	H	Недоступно для торгов
O	O	Период открытия
T		Торговая сессия
C	-	Торги закрыты

TPutCall - Тип срочного инструмента (длина: 1, тип: ekCombo)

Константа	Значение	Описание
F		Фьючерс
C	CALL	Опцион CALL
P	PUT	Опцион PUT

TDeliveryType - Вид расчётов (длина: 1, тип: ekCombo)

Константа	Значение	Описание
D		Поставочный
C		Расчётный

TTimeEvent - Тип события (длина: 1, тип: ekCombo) Перечень временных событий Торговой Системы.

Константа	Значение	Описание
2		Начало периода открытия
3		Окончание периода открытия
4		Начало торговой сессии
5		Окончание торговой сессии
6		Начало перерыва
7		Окончание перерыва
D		Начало динамического внесения/возврата депозитной маржи
E		Окончание динамического внесения/возврата депозитной маржи
F		Начало перерыва динамического внесения/возврата депозитной маржи
G		Окончание перерыва динамического внесения/возврата депозитной маржи

TTimeStatus - Состояние события (длина: 1, тип: ekCombo)

Перечень возможных состояний временных событий торговой системы.

Константа	Значение	Описание
A		Актуально
L	-	Выполнено

Интерфейс "INFO" - "Информационный интерфейс"

Таблицы

ALL_TRADES - Все сделки (обновляемая)

Таблица содержит общую информацию (без указания сторон по сделке) по всем сделкам купли/продажи финансовых инструментов, совершенным в Торговой Системе с начала торговой сессии.

Входных полей нет

Выходное поле	Описание	Тип	Размер	Примечание
TRADENO	Сделка	INTEGER	12	Идентификационный номер сделки в Торговой Системе.
TRADETIME	Время	TIME	6	Время регистрации сделки в Торговой Системе.
SECBOARD	Режим	CHAR	4	Идентификатор режима для финансового инструмента (используется совместно с идентификатором инструмента).
SECCODE*	Инструмент	CHAR	12	Идентификатор серии срочного инструмента
PRICE	Цена	PRICE	9	Цена за один контракт.
QUANTITY	Количество	INTEGER	10	Количество контрактов.

BOARDS - Режимы торгов (обновляемая)

Таблица содержит информацию о режимах торгов. Под режимом понимается набор правил проведения торгов, определяющих допустимые типы заявок, регламент торгов, виды расчетов и пр. Каждый режим представлен в таблице одной строкой.

Входных полей нет

Выходное поле	Описание	Тип	Размер	Примечание
BOARDID	Режим	CHAR	4	Идентификатор режима торгов.
BOARDNAME	Наименование	CHAR	30	Наименование режима.
STATUS	Статус	TStatus	1	Индикатор "торговые операции разрешены/запрещены".

FOSECTYPES - Типы срочных инструментов (обновляемая)

Входных полей нет

Выходное поле	Описание	Тип	Размер	Примечание
FOSECTYPEID	Тип срочного инструмента	CHAR	6	Идентификатор типа срочного инструмента.
FOSECTYPENAME	Наименование	CHAR	30	Наименование типа срочного инструмента.
STATUS	Статус	TStatus	1	Индикатор "торговые операции разрешены/запрещены".
FACEVALUE	Количество базового актива	INTEGER	16	Количество базового актива.
FACEUNIT	Валюта инструмента	CHAR	4	Код валюты, в которой выражен базовый актив.
DECIMALS	Кол-во десят. знаков	INTEGER	2	Количество десятичных знаков дробной части числа. Используется для форматирования значений полей с типом PRICE.

ORDERBOOK - Котировки (обновляемая, очищать при обновлении)

Таблица содержит информацию о заявках с лучшими ценами (отдельно на покупку и на продажу) по данной серии срочного инструмента. Каждая строка таблицы соответствует одному уровню цен и отражает суммарное количество контрактов, выставленных на покупку или продажу по этой цене.

Входное поле	Описание	Тип	Размер	Примечание
SECBOARD	Режим	CHAR	4	Идентификатор режима для финансового инструмента (используется совместно с идентификатором инструмента).
SECCODE*	Инструмент	CHAR	12	Идентификатор серии срочного инструмента.
Выходное поле	Описание	Тип	Размер	Примечание
SECBOARD	Режим	CHAR	4	Идентификатор режима для финансового инструмента (используется совместно с идентификатором инструмента).
SECCODE*	Инструмент	CHAR	12	Идентификатор серии срочного инструмента.
BUYSELL	К/П	TBuySell	1	Направленность заявки - "покупка/продажа".
PRICE	Цена	PRICE	9	Цена котировки.
QUANTITY	Количество	INTEGER	10	Количество контрактов.

SECURITIES - Финансовые инструменты (обновляемая)

Таблица содержит текущую биржевую информацию о финансовых инструментах, относящихся к различным режимам торгов. Каждая строка таблицы соответствует уникальной паре режим торгов - финансовый инструмент.

Входных полей нет

Выходное поле	Описание	Тип	Размер	Примечание
SECBOARD	Режим	CHAR	4	Идентификатор режима для финансового инструмента (используется совместно с идентификатором инструмента).
SECCODE*	Инструмент	CHAR	12	Идентификатор серии срочного инструмента.
SECNAME	Наименование	CHAR	30	Наименование финансового инструмента.
REMARKS	Примечание	CHAR	8	
SHORTNAME	Краткое наименование	CHAR	12	
STATUS	Статус	TStatus	1	Индикатор "торговые операции разрешены/запрещены".
TRADINGSTATUS	Состояние	TTradingStatus	1	Индикатор состояния торговой сессии по инструменту.
FOSECTYPEID	Тип срочного инструмента	CHAR	6	Идентификатор типа срочного инструмента.
FIRSTTRADEDATE	Первый торговый день	DATE	8	Первый торговый день по данной серии срочного инструмента.
LASTTRADEDATE	Последний торговый день	DATE	8	Последний торговый день по данной серии срочного инструмента.
LASTDELDATE	День исполнения	DATE	8	День исполнения по данной серии срочного инструмента.
MINSTEP	Мин. шаг	PRICE	9	Минимальный шаг изменения цены
PREVDATE	Дата послед. торгов	DATE	8	Дата предыдущего торгового дня.
PREVSETTLEPRICE	Расчетная цена предыдущего дня	PRICE	9	Расчетная цена предыдущего дня, руб.
CBPLIMIT	Ставка ДМ	NUMERIC	16.2	Ставка ДМ
PRICEMVTLIMIT	Лимит изменения цены	PRICE	9	Лимит изменения цены, рублей
PRICEMVTLIMITT1	Лимит изменения цены на T+1	PRICE	9	Лимит изменения цены на T+1, рублей
MAXOUTVOLUME	Лимит объема заявок	INTEGER	16	Лимит объема активных заявок, контрактов
DECIMALS	Кол-во десят. знаков	INTEGER	2	Количество десятичных знаков дробной части числа. Используется для

Выходное поле	Описание	Тип	Размер	Примечание
				форматирования значений полей с типом PRICE.
LATNAME	Английское название	CHAR	40	
PUTCALL	Тип опциона/фьючерса	TPutCall	1	
STRIKE	Страйк	PRICE	9	
UNDERLYINGSECID	Базовый актив	CHAR	12	Идентификатор финансового инструмента, являющегося базовым активом.
PRICEVALUE	Коэффициент для расчета стоимости позиции	NUMERIC	9.2	Коэффициент для расчета стоимости позиции, равный частному от деления стоимостной оценки минимального изменения цены на минимальное изменение цены по срочному инструменту. Стоимость позиции (VALUE), в валюте расчетов для данного срочного инструмента, вычисляется по следующей формуле: $VALUE = PRICE * PRICEVALUE * QUANTITY$ где: PRICE – цена позиции; QUANTITY – количество, в контрактах.
MKTSHARELIMIT	Лимит на долю рынка	NUMERIC	5.2	
MKTSHARETHRESHOLD	Минимальный объем лимита на долю рынка	INTEGER	12	Минимальный объем, при котором начинает контролироваться Лимит на долю рынка
DELIVERYTYPE	Виды расчетов	TDeliveryType	1	
BID	Спрос	PRICE	9	Лучшая котировка на покупку.
BIDDEPTH	Количество на покупку по лучшей котировке	INTEGER	10	Объем заявок на покупку по лучшей котировке .
BIDDEPTHT	Совокупный спрос	INTEGER	10	Объем всех заявок на покупку в очереди Торговой Системы.
NUMBIDS	Заявок на покупку	INTEGER	3	Количество заявок на покупку в очереди Торговой системы.
OFFER	Предложение	PRICE	9	Лучшая котировка на продажу.
OFFERDEPTH	Количество на продажу по лучшей котировке	INTEGER	10	Объем заявок на продажу по лучшей котировке.

Выходное поле	Описание	Тип	Размер	Примечание
OFFERDEPTH	Совокупное предложение	INTEGER	10	Объем всех заявок на продажу в очереди Торговой Системы.
NUMOFFERS	Заявок на продажу	INTEGER	3	Количество заявок на продажу в очереди Торговой системы.
OPEN	Открытие	PRICE	9	Цена первой сделки.
HIGH	Максимум	PRICE	9	Максимальная цена сделки.
LOW	Минимум	PRICE	9	Минимальная цена сделки.
LAST	Последняя	PRICE	9	Цена последней сделки.
LASTTOPREVSTLPRC	К расчетной	PRICE	9	Изменение цены последней сделки к расчетной цене предыдущего дня, рублей
QUANTITY	Количество	INTEGER	10	Объем последней сделки, выраженный в контрактах.
TIME	Время	TIME	6	Время заключения последней сделки.
VOLTODAY	Оборот сегодня	INTEGER	10	Объем совершенных сделок, выраженный в контрактах.
VALTODAY	Объем сегодня	INTEGER	16	Объем совершенных сделок, выраженный в руб.
VALUE	Объем	PRICE	16	Объем сделки, выраженный в руб.
SETTLEPRICE	Текущая расчетная	PRICE	9	Текущая расчетная цена.
NUMTRADES	Сделок	INTEGER	9	Количество сделок за торговый день.
NEGVALTODAY	Внесист. оборот сегодня	INTEGER	16	Объем совершенных внесистемных сделок, выраженный в руб.
NEGNUMTRADES	Внесист. сделок	INTEGER	9	Количество внесистемных сделок за торговый день.
PRICEMAX	Макс. цена	PRICE	9	Максимально возможная цена по данному инструменту.
PRICEMIN	Мин. цена	PRICE	9	Минимально возможная цена по данному инструменту.
NUMCONTRACTS	Открытых позиций	INTEGER	10	Количество открытых позиций по серии срочного инструмента.
OPENPOSITIONCHANGE	Изм. кол-ва откр. позиций	INTEGER	10	Изменение количества открытых позиций к предыдущему торговому дню, контрактов

TESYSTIME - Системное время торгового сервера (обновляемая, очищать при обновлении)

Таблица состоит из одной строки и содержит информацию о текущем времени торгового сервера. Используется для синхронизации времени на клиентском рабочем месте с временем торгового сервера.

Входных полей нет

Выходное поле	Описание	Тип	Размер	Примечание
TIME	Текущее время	TIME	6	Текущее время торгового сервера.
DATE	Дата	DATE	8	Текущая дата торгового сервера.

TRADETIME - Расписание торгов (обновляемая, очищать при обновлении)

Таблица содержит информацию о временных событиях, соответствующих изменению состояния торгов.

Входных полей нет

Выходное поле	Описание	Тип	Размер	Примечание
TIME	Время	TIME	6	Время наступления события
INSTRID	Группа инструментов	CHAR	4	Идентификатор группы инструментов.
BOARDID	Режим	CHAR	4	Идентификатор режима торгов.
SECCODE	Инструмент	CHAR	12	Идентификатор серии срочного инструмента.
TYPE	Событие	TTimeEvent	1	Тип события.
STATUS	Статус	TTimeStatus	1	Признак - наступило событие или еще нет.

Транзакции

Жирным шрифтом выделены ключевые поля.

Символом (*) помечены поля, содержащие код финансового инструмента.

Символом (+) помечена группа повторяющихся полей.