

Здравствуйте и добро пожаловать на платформу! В этом выпуске мы рассмотрим настройку моделей исполнения ордеров А-бук и В-бук.

Когда брокер использует модель исполнения А-бук, все ордера его клиентов передаются непосредственно провайдеру ликвидности.

Используя модель исполнения ордеров В-бук, брокеры выступают в качестве контрагента по сделкам своих клиентов. В модели В-бук брокеры не отправляют клиентские ордера напрямую внешним провайдерам ликвидности или на рынок.

Модели А-бук и В-бук настраиваются в настройках Агрегатора.

Начнем с модели исполнения ордеров А-бук.

Нажмите «Доступ» и давайте посмотрим на персональный счёт клиента.

Здесь в поле «Настройки счёта» мы видим настройки агрегатора счёта. Эти настройки влияют на то, как будет исполняться ордер на этом счёте.

Видим настройки агрегатора Default, нажимаем на нее и переходим на страницу настроек агрегатора.

Как мы видим, настройки агрегатора Default используют модель А-бук.

Давайте создадим новые настройки агрегатора и настроим их для счёта клиента.

Нажмите кнопку «ДОБАВИТЬ НАСТРОЙКУ АГРЕГАТОРА» и введите название новой настройки. Тип маршрутизации Аккаунт используется по умолчанию.

В поле «Маршрутизация» нажмите кнопку «ДОБАВИТЬ счёт».

В Типе источника данных выбираем А-бук, в ID счёта выбираем счёт Провайдера, после чего видим, что количество доступных инструментов изменилось.

Повторим предыдущие шаги со счётами других Провайдеров.

Нажмите кнопку ДОБАВИТЬ счёт.

В Типе источника данных выбираем А-бук, в ID счёта выбираем счёт Провайдера, после чего видим, что количество доступных инструментов изменилось.

После добавления всех необходимых счётов провайдеров настройки агрегатора готовы к созданию. Нажмите «Создать» и новые настройки агрегатора появятся в списке настроек агрегатора.

Теперь пришло время установить модель А-бук для счёта клиента.

Для этого добавим в счёт только что созданные настройки агрегатора:

Зайдите в Доступ и нажмите на нужный счёт.

В поле настроек счёта нажмите Редактировать.

В строке настроек агрегатора нажмите кнопку карандаша и выберите настройки агрегатора, затем нажмите кнопку галочки.

После нажатия кнопки галочки появится окно Предупреждение, в котором мы увидим информативное сообщение об изменении торговых настроек. Согласимся с изменениями и нажмем СОХРАНИТЬ.

Теперь мы видим уведомление о том, что счёт обновился.

счёт готов к торговле с использованием модели исполнения ордеров A-бук.

Теперь рассмотрим настройку модели исполнения ордеров B-бук на платформе.

Первый шаг — создать B бук счёт.

Зайдите в Доступ и нажмите кнопку Создать счёт.

В основной информации Клиент ID и ID провайдера будет сам брокер.

Заполним:

ID клиента - выберите профиль нашего брокера,

Тип управления счётом: Пёрсонал,

Тип управления: Брокередж,

ID провайдера - выберите профиль нашего брокера

В информации о счёте мы выбираем тип настроек Мэньюэл и выбираем настройки Дефолт для:

Настройки агрегатора

ID настройки нэттинга

Тариф

ID маржинального профиля

Налоговый профиль

Режим торговли выбираем Нэттинг

В качестве имени счёта введём В-бук экзекьютер.

Роль участника - выбираем Неизвестную роль

После завершения настройки счёта для исполнения ордеров в В бук нажмите кнопку «Создать счёт».

Второй шаг — создать настройки агрегатора для исполнения в В бук.

Перейдите в торговые настройки, затем на вкладку настроек агрегатора.

Нажмите кнопку «ДОБАВИТЬ НАСТРОЙКУ АГРЕГАТОРА» и введите название новой настройки. Например, В-бук экзекьютер.

В поле «Маршрутизация» нажмите «ДОБАВИТЬ счёт».

В поле «Тип источника данных» выбираем «Индикативный», для получения цен, в ID счёта выбираем счёт провайдера, после чего видим, что количество доступных инструментов изменилось.

Давайте включим опцию «В-бук исполнитель», нажмите «Редактировать», чтобы открыть боковую страницу, и включите данную опцию, после чего нажмите «Сохранить».

Нажмите «Создать» после того, как все настройки будут применены.

Третий шаг — установить настройки агрегатора В-бук для счёта В бук.

Перейдите в Доступ и нажмите на счёт В-бук экзекьютер.

В поле настроек счёта нажмите «Редактировать».

В строке настроек агрегатора нажмите кнопку карандаша и выберите настройки агрегатора, затем нажмите кнопку галочки.

После нажатия кнопки галочки появится окно Предупреждение, в котором мы увидим информативное сообщение об изменении торговых настроек. Согласимся с изменениями и нажмем СОХРАНИТЬ.

Теперь мы видим уведомление о том, что счёт обновился.

При желании мы можем добавить к счёту маржинальный кредит, чтобы избежать предупреждений о марже.

В поле «Корректировка» нажмите «Редактировать» и на открывшейся боковой странице в строке «Маржинальный кредит» выберите актив и введите сумму маржинального кредита. Нажмите кнопку «ОБНОВИТЬ счёт», и мы увидим, что баланс маржи счёта обновился.

Четвертый шаг — создание настроек агрегатора В-бук для клиентов .

Перейдите в торговые настройки и перейдите на вкладку настроек агрегатора.

Нажмите кнопку «ДОБАВИТЬ НАСТРОЙКУ АГРЕГАТОРА» и введите название новой настройки. Например, клиент В бук.

В поле «Маршрутизация» нажмите «ДОБАВИТЬ счёт».

В поле «Тип источника данных» выбираем «В-бук», в ID счёта выбираем недавно созданный В бук счёт «В-бук экзекьютер».

Нажмите кнопку СОЗДАТЬ, чтобы завершить создание настройки агрегатора.

Теперь давайте перенесем счёт клиента из модели А-бук в модель В-бук.

Зайдите в Доступ и нажмите на нужный счёт.

В поле настроек счёта нажмите Редактировать.

В строке настроек агрегатора нажмите кнопку карандаша и выберите настройки агрегатора В бук client, затем нажмите кнопку галочки.

После нажатия кнопки галочки появится окно Предупреждение, в котором мы увидим информативное сообщение об изменении торговых настроек. Согласимся с изменениями и нажмем СОХРАНИТЬ.

Теперь мы видим уведомление о том, что счёт обновился.

счёт готов к торговле с использованием модели исполнения ордеров В-бук.

Поздравляем, в этом выпуске мы узнали, как настроить на платформе модели исполнения ордеров А-бук и В-бук. Спасибо за внимание и до встречи в следующих выпусках!