
Репликационные потоки шлюза

P11<->P1

Содержание

Репликационные потоки шлюза P11<->P1.....	1
Общие соглашения.....	1
Поток общих справочников P1INF_DICT_REPL.....	1
<i>Таблица CommonRegistry: общие справочники.....</i>	2
<i>Таблица CommonIssue: справочник ценных бумаг/инструментов.....</i>	4
Поток рыночной информации (P1INF_MDATA_REPL).....	5
<i>Таблица StatIssue: общая статистика по инструментам.....</i>	6
<i>Таблица CommonTrade: сделки.....</i>	7
<i>Таблица CommonQuote: котировки.....</i>	9

Общие соглашения

В каждой таблице первые три поля являются служебными полями подсистемы репликации Plaza2, имеют тип i8 и наименования: id, rev, cmd

id – первичный идентификатор записи в таблице

rev – сквозной номер изменения в таблице

cmd – признак удаленной записи. 0 – запись активна, <> 0 – запись удалена.

Поток общих справочников P1INF_DICT_REPL

Схема данных

Таблицы:

- CommonRegistry – общие справочники
- CommonIssue – справочник ценных бумаг/инструментов

Таблица CommonRegistry: общие справочники

Таблица CommonRegistry содержит информацию о настройках торговой системы и статистические данные.

Таблица 1. Поля таблицы CommonRegistry

Поле	Тип	Описание
section	c31	Имя секции (содержит наименование раздела, к которому относится соответствующий параметр).
item_name	c31	Название параметра.
item_value	c255	Значение параметра.
area	c1	Параметр доступа к просмотру записи. Он может иметь только два значения: ('P' – Private, 'C' – Common).

Секции Registry, доступные для получения:

bl_base_currency - базовая валюта торговой системы;

bl_digits_in_row - количество значащих цифр в цене по умолчанию при создании новой ЦБ;

bl_group_accounts_B - задание кодов групп банковских счетов. В поле item_name задается код группы, в поле value – флаг активности торгов по группе: 1 – торги открыты, <>1 – торги закрыты;

bl_group_accounts_D - задание кодов групп депозитарных счетов. В поле item_name задается код группы, в поле value – флаг активности торгов по группе: 1 – торги открыты, <>1 – торги закрыты;

bl_news - установка обозначений источников новостей и времени их хранения в базе данных торговой системы;

bl_rate – значение курса Центрального Банка РФ (рубли за доллар США) на следующий за текущим день (вводится после официального сообщения в 12:30);

bl_status_system - индикация состояния торговых сессий в торговой системе и подсистеме СГК;

list-<название листинга> - установка условий торговли на соответствующих площадках. Параметры item_name и value имеют такое значение:

- item_name=**t_quote** – в value содержится время начала и окончания периода подачи заявок по группе бумаг;
- item_name=**t_ccp_quote** – в value содержится время начала и окончания периода подачи заявок с ССР по группе бумаг;
- item_name=**t_trade** – в value содержится время начала и окончания периода подачи адресных сделок по группе бумаг;
- item_name=**t_ccp_trade** – в value содержится время начала и окончания периода подачи адресных сделок с ССР по группе бумаг;
- item_name=**t_auction** – в value содержится время начала и окончания периода аукциона по группе бумаг;
- item_name=**t_rules** – в value содержится время начала и окончания периода расчета официальной статистики по группе бумаг;
- item_name=**t_bq** – в value содержится время начала и окончания периода, в который разрешены сделки по котировке (только для небиржевого рынка) по группе бумаг;

- item_name=**trade_allow** – в value содержатся коды, указывающие, какие сделки разрешены в данной группе. А – аукционные, В – адресные, Q – по котировке, I – сделки первичного размещения
- item_name=**day_currency** – в value содержится код валюты, в которой считается суммарный объем торгов по группе в деньгах.
- item_name=**day_volume** – в value содержится суммарный объем торгов по группе в деньгах выраженный в валюте, указанной в “day_currency”
- item_name=**NoSameFirm** - включенное условие (value ='on') запрещает заключение сделок по заявкам одного участника
- item_name=**NoSameFirmClassic** - включенное условие (value ='1') запрещает адресные сделки между клиентами одного участника (Firm) по бумагам классики. Условие работает только при включенном NoSameFirm.
- item_name=**NoSameINN** - Данное условие устанавливает режим проверки на совпадение ИНН для сделки. Работает только при включенной проверке check_inn.

Наличие запрета на заключение сделок с одинаковым ИНН в заявках зависит от значения поля Value:

Значение поля Value	Наличие запрета на заключение сделок с одинаковым ИНН в заявках:			
	одного участника	разных участников	безадресных	адресных
0	–	–	–	–
1	+	–	+	–
2	+	–	+	+
3	+	+	+	–
4	+	+	+	+

- item_name=**check_inn** - данное условие осуществляет включение проверки регистрации ИНН клиента брокера при вводе безадресных заявок, вводе и подтверждении сделок. Значение поля value ='off' – проверка выключена, value ='on' – включена, по умолчанию используется значение 'on'
- item_name=**check_limit** - условие управляет проверкой взаимных лимитов компаний при совершении сделок по котировке. Значение поля value ='off' – проверка выключена, value ='on' – включена.
- item_name=**reserve_quantity** - условие используется для установки/отключения возможности выставлять безадресные заявки с использованием резервного (скрытого) количества ценных бумаг («айсберг-заявки»). Значение поля value ='off' – проверка выключена, value ='on' – включена.

Диапазоны времени для параметров t_quote, t_trade, t_auction, t_rules, t_bq задаются в формате:

hh:mm(:ss);hh:mm(:ss) - начало диапазона; конец диапазона

Обращаем внимание, что указание секунд - опциональное

bl_currency - курс валют по отношению к базовой (доллару США). В поле item_name указывается код валюты, в поле value – значение курса;

bl_depo - количество дней на перерегистрацию в указанном депозитарии;

bl_day - корректировка установки рабочих и выходных дней стандартного календаря. В поле it_name указывается дата, в поле value – строка 'on' если выходной день объявлен рабочим или 'off', если рабочий день объявлен выходным;

bl_day_usd - корректировка установки рабочих и выходных дней американского календаря. В поле it_name указывается дата, в поле value – строка 'on' если выходной день объявлен рабочим или 'off', если рабочий день объявлен выходным;

bl_pay_conditions - условия платежа. В поле item_name вводится код (один символ). В поле value указывается код валюты (или коды разделенные запятыми без пробелов) из списка кодов, представленных в секции bl_currency;

statistics - расчетные статистические данные (индексы)

repl_stamp – heartbeat таймер

item_name = **heartbeat_interval** –точность обновления таймера (в секундах)

item_name = **heartbeat_time** – текущее время ядра с заданной точностью обновления. Если время выполнения транзакции превышает заданный интервал обновления, то смена значения производится только по окончании такой транзакции (т.е. возможны пропуски)

Таблица CommonIssue: справочник ценных бумаг/инструментов

Таблица 2. Поля таблицы CommonIssue

Поле	Тип	Описание
name	c7	Сокращенное наименование (код) инструмента в РТС.
properties	c255	Свойства эмитента.
registration_number	c31	Государственный регистрационный номер.
ISIN	c12	Международный идентификационный номер (ISIN).
full_name	c255	Полное наименование эмитента.
Currency	c3	Код валюты номинальной цены эмитента, например: ('RUR' – российский рубль, 'USD' – доллар США).
Nominal	s16.5	Номинальная цена эмитента.
price_currency	c3	Код валюты цены - валюты котирования эмитента, например: ('RUR' – российский рубль, 'USD' – доллар США).
settl_currency	c3	Валюта расчетов (для соответствия РПС).
delivery_days	u1	Стандартный срок расчетов в днях.
total_amt	t_size	Размер эмиссии (количество).
type	u4	Тип допустимых расчетов 1, 2, 3, ... (REESTR, DCC, GTS, PVD, ALL_NON, MARKET, STOP_ORDER, STOP_TRADE, IPO, I_CODE, T_N).
mode_trade	u4	Режим торговли (Поле биржа).
issue_type	u1	Тип эмитента по SWIFT (SHS, BON,....).
Pips	u1	Шаг цены активации (устарело)
end_ipo	t	Дата и время окончания первичного размещения (IPO).
z_ipo	s16.5	Дисконтирующий коэффициент (рыночные/лимитные).
risk	s16.5	Коэффициент рыночного риска. 0.12 - 12% для анонимной торговли
trade_on_off	u1	Анонимная Торговля. Запрещена – '0', разрешена – '1'
prec	u1	Количество значащих цифр в цене.

Поле	Тип	Описание
frac	i1	Количество цифр в цене после запятой (-1-любое кол-во).
listlogdate	t	Дата составления купонного реестра.
cutoffdate	t	Дата выдачи следующего купона.
create_moment	t	Время создания записи об эмитенте в РТС.
delete_moment	t	Время удаления записи об эмитенте в РТС (null если не удален).
modify_moment	t	Момент последнего изменения записи об эмитенте в РТС.
deleted	c1	Состояние эмитента (' ' эмитент – не удален, '*' эмитент – удален).
depo_accounts	c3	Код (название) депо счетов.
lstg	c7	Принадлежность эмитента к листингу РТС. Название листинга без префикса list (например: A, AA, BOARD, BOND, BONDE, BONDG, GAZ, GTS, INF, IPO, QUADRO).
range	s3.0	Параметр, задающий отклонение цены адресной заявки (сделки) в % от цены текущей лучшей безадресной заявки, совпадающей с ней по направлению.
spread	s3.0	Параметр, задающий отклонение цены безадресной заявки (котировки) в % от цены текущей лучшей безадресной заявки, совпадающей с ней по направлению для ценных бумаг, имеющих свойство SPREAD
aisle	s3.0	Параметр, задающий отклонение цены безадресной заявки (котировки) в % от цены закрытия (поле previous_close таблицы Issue) для ценных бумаг, имеющих свойство AISLE
aisle1	s3.0	Параметр, задающий отклонение цены безадресной заявки (котировки) в % от «официальной цены закрытия» (поле official_close таблицы Issue) или «официальной цены открытия» (поле official_open таблицы Issue) для ценных бумаг, имеющих свойство AISLE1
lot	s16.0	Требуемая кратность количества бумаг, указанных в безадресной заявке
lot_DBQ	s16.0	Кратность кол-ва бумаг в сделках по котировке

Поток рыночной информации (P1INF_MDATA_REPL)

Схема данных

Таблицы:

- StatIssue – общая статистика по инструментам
- CommonTrade – сделки
- CommonQuote – котировки

Таблица StatIssue: общая статистика по инструментам

Таблица 3. Поля таблицы StatIssue

Поле	Тип	Описание
name	c7	Сокращенное наименование эмитента в РТС.
lstg	c7	Принадлежность эмитента к листингу РТС. Название листинга без префикса list (например: A, AA, BOARD, BOND, BONDE, BONDG, GAZ, GTS, INF, IPO, QUADRO).
bid_best_price	s16.5	Цена лучшей котировки на покупку (max price) в течение торгового дня.
ask_best_price	s16.5	Цена лучшей котировки на продажу (min price) в течение торгового дня.
bid_inside_price	s16.5	Цена лучшей текущей котировки на покупку.
bid_inside_size	s16.0	Объем лучшей текущей котировки на покупку.
bid_changed	t	Время изменения лучшей текущей котировки на покупку.
bid_change	c1	Направление последнего изменения лучшей текущей котировки на покупку ('U' – вверх, 'D' – вниз, ' ' – новое значение равно предыдущему).
bid_change_alert	c1	Направление изменения bid_inside_price ('U' – вверх, 'D' – вниз, ' ' – новое значение равно предыдущему).
ask_inside_price	s16.5	Цена лучшей текущей котировки на продажу.
ask_inside_size	s16.0	Объем лучшей текущей котировки на продажу.
ask_changed	t	Время изменения лучшей текущей котировки на продажу.
ask_change	c1	Направление последнего изменения лучшей текущей котировки на продажу ('U' - вверх, 'D' – вниз, ' ' - новое значение равно предыдущему).
ask_change_alert	c1	Направление изменения ask_inside_price ('U' – вверх, 'D' – вниз, ' ' – новое значение равно предыдущему).
trade_moment	t	Время регистрации последней сделки.
trade_price	s16.5	Цена последней сделки.
trade_size	s16.0	Объем последней сделки (в штуках).
trade_changed	t	Время изменения цены последней сделки.
trade_change	c1	Направление изменения цены последней сделки ('U' – вверх, 'D' - вниз, ' ' - новое значение равно предыдущему).
trade_change_delta	s16.5	Дельта изменения цены (со знаком).
min_trade_price	s16.5	Минимальная цена сделки в течение торгового дня.
max_trade_price	s16.5	Максимальная цена сделки в течение торгового дня.
day_size	s16.0	Объем торговли за текущий день (в штуках).
day_vol	s26.2	Объем торговли за текущий день в валюте котирования.
open_price	s16.5	Цена сделки на открытие торгов.
average_price	s16.5	Средне-взвешенная цена сделки.
previous_close	s16.5	Цена закрытия – цена последней сделки предыдущего торгового дня.
market_price	s16.5	Рыночная цена сделки.
official_open	s16.5	Цена открытия, рассчитываемая инфосервером торговой системы («официальная цена открытия»)
official_close	s16.5	Цена закрытия, рассчитываемая инфосервером торговой системы («официальная цена закрытия»)
official_current	s16.5	Текущая цена, рассчитываемая инфосервером торговой системы («официальная текущая цена»)
Index_price	s16.5	Цена, с которой данная бумага последний раз

Поле	Тип	Описание
		участвовала в расчете индекса
market_price1	s16.5	Рыночная цена 1
market_price2	s16.5	Рыночная цена 2
market_price3	s16.5	Рыночная цена 3

Таблица CommonTrade: сделки

Таблица 4. Поля таблицы CommonTrade

Поле	Тип	Описание			
type	c1	Тип сделки ('Q' – сделка по котировке, 'B' – двухсторонняя сделка, 'C' – клиентская сделка, 'A' – сделка по результатам встречного аукциона, 'I' – сделка по результатам закрытого аукциона (IPO)).			
type_ext	c1	'R' – REPO-сделки, ' ' – обычные сделки, 'N' – сделка T+N, 'P' – REPO-сделки с ОБГЗ (т.н. «псевдо РЕПО»),			
status	u1	Значение	Статус сделки в RTS PLAZA	Статус сделки у инициатора	Статус сделки у контрагента
		1	NEW	UNC	ADV
		2	COM	COM	CAC
		3	VXI	VXI	CPI
		4	VXC	CPC	VXC
		5	CXL	CXL	CXL
		11	DEL	DEL	CLR
		12	ONE	ONE	
		14	NEI	UNI	ADI
		18	COB	COB	CAB
		19	BAC	BAC	BAK
		21	BAA	BAA	BAF
		22	BAX	BAX	BAZ
		23	BAY	BAY	BAH
		24	NEO	UNO	ADO
		25	EOM	EOM	EOM
		26	EOA	EOA	EOF
		27	NSI	USI	ASI
		28	COS	COS	CAS
		29	NEN	UNN	AND
		30	NOM	NOM	NOM
		31	CON	CON	CON
issueID	u4	Уникальный идентификатор записи (id) из таблицы Issue.			
issue_name	c7	Сокращенное наименование эмитента в РТС.			
i_code	c12	Код выпуска ценной бумаги			
price	s16.5	Цена одной акции.			

Поле	Тип	Описание
qty	s16.0	Торговый лот (количество акций в штуках).
volume	s26.2	Результат сделки в валюте платежа (расчетная формула определяется типом эмитента issue_type из таблицы Issue): – для акций (issue_type = SHS) $volume = price * qty * payment_rate / price_rate;$ – для облигаций (issue_type = BON) $volume = (price * 0.01 * nominal + nkd_1) * qty * payment_rate / nominal_rate,$ для облигаций цена определена в процентах от номинала.
Bond		
nkd_1	s16.5	Накопленный купонный доход 1 в валюте номинальной цены эмитента из таблицы Issue.
Repo		
repo_action	c1	BS – '1' – Borrow securities. Беру кредит в бумагах. LS – '2' – Lend securities. Даю кредит в бумагах. RS – '3' – Return Securities. Возвращаю кредит в бумагах. AS – '4' – Accept Securities. Принимаю кредит в бумагах. BM – '5' – Borrow money. Беру кредит в деньгах. LM – '6' – Lend money. Даю кредит в деньгах. RM – '7' – Return Money. Возвращаю кредит в деньгах. AM – '8' – Accept Money. Принимаю кредит в деньгах ANY – ' ' – Не задано.
trade_ref	i8	Ссылка на номер транзакции прямой/обратной сделки.
repurchase	s26.2	Сумма обратной сделки/Новая (отредактированная) сумма обратной сделки.
rate	s16.6	В сделках репо - Ставка кредитования, выраженная в процентах годовых по отношению к сумме (цене) первой части сделки.
trade_moment	t	Время регистрации сделки.
affirm_moment	t	Время подтверждения сделки.
price_currency	c3	Код валюты цены, например: ('RUR' – российский рубль, 'USD' – доллар США).
price_rate	s16.5	Курс валюты цены по отношению к базовой валюте.
payment_currency	c3	Код валюты платежа, например: ('RUR' – российский рубль, 'USD' – доллар США).
payment_rate	s16.6	Курс валюты платежа по отношению к базовой валюте.
Копируется из Issue в момент создания сделки		
clear	u4	Обозначение типа расчетов 1, 2, 3... (через реестр, через ДКК, GTS, DVP, ..., T+N). См. п 4.4.

Поле	Тип	Описание
dcc	c3	Способ поставки ЦБ. Для инструментов биржевого рынка допускаются следующие значения GTS – расчеты T+0 ССР – расчет через центрального контрагента РТС на рынке электронных котировок (T+4) Для инструментов небиржевого рынка допускаются следующие значения: для акций и облигаций: "(пустая строка) – поставка ЦБ через реестр или свободная поставка ОВГЗ NBU – поставка ОВГЗ на рынке котировок биржи УБ DCC – поставка ЦБ через депозитарий ДКК (стандартный срок поставки – 4 дня) PVD – расчет с использованием схемы Поставка Против Платежа (стандартный срок поставки – 4 дня) для еврооблигаций, дополнительно к вышеуказанному : BVT – поставка ЦБ через ОАО Внешторгбанк (стандартный срок поставки – 3 дня) ECL – поставка ЦБ через Euroclear Bank (стандартный срок поставки – 3 дня) VEB – поставка ЦБ через Внешэкономбанк СССР (стандартный срок поставки – 3 дня) для корпоративных и субфедеральных облигаций дополнительно к вышеуказанному – RTS – поставка ЦБ осуществляются путем подачи адресных заявок на ОАО РТС MCX - поставка ЦБ осуществляются путем подачи адресных заявок в РПС ММВБ
delivery_date	t	Дата перерегистрации ценной бумаги.
Свойства из Issue		
lstg	c7	Название листинга без префикса list (например: A, BOARD, BOND, BONDG, GTS, IPO).
market	u1	Признак рыночности сделки. Принимает значения: '0' – состояние неопределено '1' – не рыночная сделка '2' – рыночная сделка

Таблица CommonQuote: котировки

Таблица CommonQuote содержит данные о котировках ценных бумаг.

Таблица 5. Поля таблицы CommonQuote

Поле	Тип	Описание
moment	t	Время выставления или изменения котировки.
type	c1	Тип котировки ('A' – продажа, 'B' – покупка).
issueID	i8	Уникальный идентификатор записи (id) из таблицы Issue.
issue_name	c7	Сокращенное наименование эмитента в РТС.
i_code	t_isin	Код выпуска ценной бумаги
wks	c31	Код рабочей станции

Поле	Тип	Описание
price	s16.5	Цена текущей котировки.
qty	s16.0	Объем торгового лота.
paycond	c1	Условия расчетов по сделке ('B' – RUB, 'S' – USD, 'J' – любая валюта из разрешенных листингом).
dcc	c3	Способ поставки ЦБ. Для инструментов биржевого рынка допускаются следующие значения GTS – расчеты T+0 CCP – расчет через центрального контрагента РТС на рынке электронных котировок (T+4) Для инструментов небиржевого рынка допускаются следующие значения: для акций и облигаций: "(пустая строка) – поставка ЦБ через реестр или свободная поставка ОВГЗ NBU – поставка ОВГЗ на рынке котировок биржи УБ DCC – поставка ЦБ через депозитарий ДКК (стандартный срок поставки – 4 дня) PVD – расчет с использованием схемы Поставка Против Платежа (стандартный срок поставки – 4 дня) для еврооблигаций, дополнительно к вышеуказанному : BVT – поставка ЦБ через ОАО Внешторгбанк (стандартный срок поставки – 3 дня) ECL – поставка ЦБ через Euroclear Bank (стандартный срок поставки – 3 дня) VEB – поставка ЦБ через Внешэкономбанк СССР (стандартный срок поставки – 3 дня) для корпоративных и субфедеральных облигаций дополнительно к вышеуказанному – RTS – поставка ЦБ осуществляются путем подачи адресных заявок на ОАО РТС MCX - поставка ЦБ осуществляются путем подачи адресных заявок в РПС ММВБ
delivery_days	u1	Количество дней на перерегистрацию ценных бумаг.
Коды групп счетов		
depo_accounts	c3	Код (название) депозитарной группы счетов
bank_accounts	c3	Код (название) банковской группы счетов
Свойства из Issue		
visible	u1	Признак анонимности из таблицы Issue 'N_VIS' – анонимная, по умолчанию – не анонимная (видно название фирмы).
lstg	c7	Название листинга без префикса list (например: A, AA, BOARD, BOND, BONDE, BONDG, GAZ, GTS, IPO ¹) из таблицы Issue.

¹ Список существующих листингов описан в п.4.1 и может изменяться решением бирж без предварительного уведомления.

ipo	u1	Признак первичного размещения: IPO > 1, другое – 0. Обозначение типа аукциона для первичного размещения: 1 – встречный аукцион (открытый), 2 – закрытый аукцион с единой ценой (американский), 3 – стандартный закрытый аукцион (европейский), 4 – смешанный закрытый аукцион.
Поля для аукциона		
quote_order	u1	Параметр, уточняющий тип заявки: котировка – 0, заявка – 1, заявка на рынке анонимной классики - 2.
order_type	u1	Тип заявки 0 – рыночная, 1 – лимитированная, 2 – closing session (в течение установленного времени для послеторговой сессии разрешается ввод заявок с пометкой “closing_session”, которые удовлетворяются по средневзвешенной цене.
all_non	u1	Параметр исполнения заявки. Принимает значения: 1 – исполнять только в полном объеме, 0 – возможно частичное исполнение.
leave	u2	Время жизни заявки . Может принимать следующие значения: 0 – заявка будет немедленно обработана, 1 – заявка будет храниться 1 день, 65000 – заявка будет храниться неограниченный период времени, но до момента снятия ее с торгов клиентом.
nkd_1	s16.5	Накопленный купонный доход 1 в валюте номинальной цены эмитента из таблицы Issue.
yield	s16.6	Доходность.