

Переход торговой платформы FORTS на Plaza II

Текущая ситуация

План

- Текущая ситуация
- Технические характеристики новой Plaza II
- Готовность разработчиков торговых систем
- Организационные аспекты и тарифы

Текущая ситуация

На 22 апреля 2010 года

- Произведена полная выверка реестров ODBC логинов и согласована карта перехода на Plaza II с 30 участниками
- На Plaza II переведено 4 промсервера участников и провайдеров торговых платформ
- Выдано 146 шлюзов Plaza II и 43 терминала Plaza II
- Успешно проведено три этапа нагрузочного тестирования с участием разработчиков торговых систем и брокеров
- В настоящее время развернуто 3 промсервера для подключения Участников по протоколу Plaza II

Технические характеристики Plaza II.

•1 мая 2010 года состоится масштабный апгрейд торговой системы FORTS.

Появится

–Рынок РЕПО (только в шлюзе Plaza II)

–Поддержка многопоточной модели COM (только Plaza II)

–В таблицу orders_log будут добавлены поля с номером сделки и ценой сделки. Т. О. появится возможность знать позиции, не получая таблицу сделок (возможна оптимизация систем алгоритмической торговли)

–Риск-параметры для модуля расчета гарантийного обеспечения (продукт ClientGO) будут транслироваться в шлюзе (только Plaza II)

•Терминал FORTS Plaza II уже поддерживает рынок РЕПО (доступен для апгрейда с 19.04.2010)

Plaza II версии 173. 23.04.2010 выпущена в тестовую эксплуатацию версия 175.

Служба технической поддержки РТС доступна по телефону +7(495) 733-9507, +7(495) 500-3848 или по e-мэйл help@rts.ru

Готовность разработчиков торговых систем

–SmartTrade (разработчик компания Ай Ти инвест)

Промсервер, обслуживающий собственные позиции, переведен на Plaza II и готов к промышленной эксплуатации.

–Алор-Трейд (разработчик компания «АЛОП+»)

Резервный контур полностью переведен на Plaza II. После апгрейда будет произведен перевод основного контура, т.е. полный переход на Plaza II.

–NetInvestor (разработчик компания «МФД-Инфоцентр»)

Готовность с 15 мая

–QUIK (разработчик компания ARQA Technologies)

После апгрейда боевой торговой системы 1 мая планируется 2 недели на тестирование. После успешного окончания тестирования начнется последовательный апгрейд брокерских систем клиентов на Plaza II.

–Orc Software (разработчик компания Orc Software)

Апгрейд брокерских систем клиентов произойдет в течение лета 2010 года

–Transaq (разработчик компания «Скрин маркет системз»)

Ведется доработка шлюза Plaza II и эксплуатация в тестовом режиме. План предоставления функционала Plaza II клиентам будет предоставлен после апгрейда 1 мая.

–SunGard (разработчик компания SunGard)

Готовность к внедрению после успешного завершения апгрейда торговой системы FORTS.

Организационный аспект

- С 1 апреля введены тарифы на логины Plaza II.

Тариф зависит от: типа логина, производительности, подключения возможности подключения к серверам биржи.

Заявка на получение логина Plaza II и тарифы размещены на сайте www.rts.ru

- С 01 июня будет введена плата за SQL логины в размере 1 000 рублей.
- С 01 сентября плата за SQL логины будет повышена до 4 000 рублей.
- Разрешена одновременная торговля на одном регистре через ODBC и Plaza II без ограничений по времени.
- При апгрейде промсерверов на Plaza II предоставляется 3 недельный период параллельной работы без взимания платы.
- Поддерживается возможность быстрого поднятия ODBC промсервера участника из резерва.

Тарифная сетка

| п/п | Технология | Подключение | Тип доступа | Стоимость согласно текущему тарифу | | Тариф на SQL и Plaza II логины с 01.04.2010 | | Тариф на SQL и Plaza II логины с 01.06.2010 | Тариф на SQL и Plaza II логины с 01.09.2010 |
|-----|------------|----------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--------------------------------|---|--------------------------------|---|---|
| | | | | Подключе ние | Абонентск ая плата в мес | Подключе ние | Абонентск ая плата в мес | Абонентск ая плата в мес | Абонентск ая плата в мес |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 7 | 8 | 5 | 6 | 9 | 10 |
| 1 | SQL | Промсервер Биржи \ Брокера | Терминал FORTS торговый | 6 000 | 2 000 | 6 000 | 4 000 | 4 000 | 4 000 |
| 2 | SQL | | Терминал FORTS клиентский | 2 000 | 1 200 | 2 000 | 2 000 | 2 000 | 2 000 |
| 3 | SQL | | Шлюз | 6 000 | 2 000 | 6 000 | 2 000 | 2 000 | 2 000 |
| 4 | SQL | | Шлюзовой логин | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 000 | 4 000 |
| 5 | Плаза 2 | | Терминал FORTS, основной логин | n/a | n/a | 4 000 | 4 000 | 4 000 | 4 000 |
| 6 | Плаза 2 | | Терминал FORTS, просмотрный логин | n/a | n/a | 2 000 | 2 000 | 2 000 | 2 000 |
| 7 | Плаза 2 | Промсервер Биржи | Шлюз, Основной логин | n/a | n/a | 4 000 | 4 000 | 4 000 | 4 000 |
| 8 | Плаза 2 | | Шлюз, Транзакционный логин | n/a | n/a | 2 000 | 2 000 | 2 000 | 2 000 |
| 9 | Плаза 2 | | Шлюз, Просмотрный логин | n/a | n/a | 2 000 | 2 000 | 2 000 | 2 000 |
| 10 | Плаза 2 | Промсервер Брокера | Шлюз, Основной логин | n/a | n/a | 4 000 | 2 000 | 2 000 | 2 000 |
| 11 | Плаза 2 | | Шлюз, Транзакционный логин | n/a | n/a | 2 000 | 1 000 | 1 000 | 1 000 |
| 12 | Плаза 2 | | Шлюз, Просмотрный логин | n/a | n/a | 2 000 | 1 000 | 1 000 | 1 000 |
| 13 | FIX | Промсервер Биржи | Шлюз, Транзакционный логин | 6 000 | 2 000 | 2 000 | 2 000 | 2 000 | 2 000 |
| 14 | FAST | Промсервер Биржи | Шлюз, Просмотрный логин | n/a | n/a | 2 000 | 2 000 | 2 000 | 2 000 |

Технологии риск-менеджмента PТС

Клиентские приложения

Изменения в расчете алгоритма расчета ГО

Модуль расчета рисков ClientGO

- Реализован новый алгоритм расчёта кривой волатильности на рынке опционов (кривая волатильности, рассчитываемая по 6 параметрам)
- шестой параметр кривой волатильности - S
- новая кривая заливается также в дневном клиринге
- Риск-параметры для работы ClientGO транслируются в Plaza II шлюзе

Модуль расчета рисков для разработчиков

- Кросс-платформенное приложение для разработчиков для интеграции расчета гарантийного обеспечения и вариационной маржи в – в эксплуатации.
- Написано на Python (алгоритм легок для понимания и реализации в системе интернет-трейдинга разработчиками).
- Риск-параметры для расчета ГО по всем инструментам в формате XML (risk-arrays), генерируются РТС два раза в день и передаются участникам.
- Со стороны РТС возможен расчет рисков по инструментам других рынков \ с нестандартными параметрами с их включением в файл risk-arrays.

Спасибо за внимание!

Павел Ефимов

Руководитель управления продаж

Департамента инфраструктурных проектов

infrastructure@rts.ru

Рассылки департамента инфраструктурных проектов

- Для разработчиков: developers@rts.ru
- Для бизнеса: infrastructure_news@rts.ru

Подписка по адресу efimov@rts.ru или на сайте www.rts.ru