



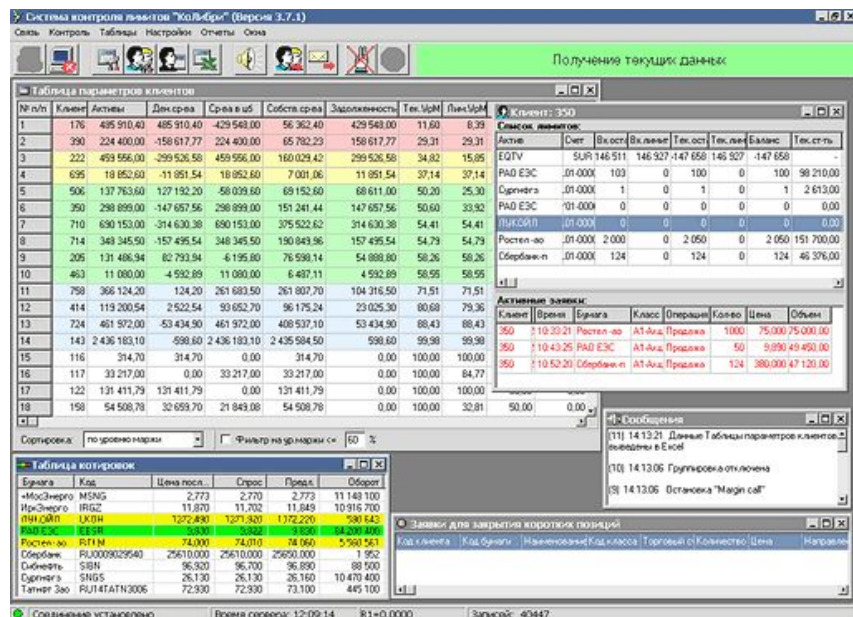
Презентация COLIBRI:

краткое знакомство с программой
для решения комплекса задач по
маржинальному кредитованию
клиентов брокера

ARQA Technologies

quik.ru

Интерфейс



Интерфейс программы состоит из таблиц

и окон, отображающих информацию.

На панели инструментов сосредоточены кнопки для быстрого вызова основных функций программы.

В правой части панели инструментов расположен цветной индикатор, показывающий состояние приема данных

и активность режима «Margin call».

Основная таблица

Система контроля ливентов "КОЛИБРИ" (Версия 3.7.1)
 Сеть Контроль Таблицы Настройки Оплаты Очки
 Получение текущих данных

Таблица параметров клиентов

№ п/п	Клиент	Активы	Дек.ср-ва	Ср-ва в уд.	Собств. ср-ва	Задолженность	Тек. УрМ	Лик.УрМ	Мак.УрМ	Shot
1	176	495 910.40	485 910.40	430 708.00	55 202.40	430 708.00	11.36	8.22	50.00	430 708.00
2	390	224 700.00	158 617.77	224 700.00	66 982.23	158 617.77	29.41	29.41	50.00	0.00
3	222	460 084.50	299 526.58	460 084.50	160 957.92	299 526.58	34.90	15.90	50.00	0.00
4	695	18 879.00	-11 851.54	18 879.00	7 027.46	11 851.54	37.22	37.22	50.00	0.00
5	506	137 764.80	127 192.20	58 171.40	69 020.80	68 744.00	50.10	25.25	50.00	68 744.00
6	390	299 614.00	147 657.56	299 614.00	151 956.44	147 657.56	50.72	34.03	50.00	0.00
7	710	690 329.50	-214 630.38	690 329.50	375 699.12	314 630.38	54.42	54.42	50.00	0.00
8	714	348 702.50	-157 495.54	348 702.50	191 206.96	157 495.54	54.83	54.83	50.00	0.00
9	205	131 545.94	82 793.94	6 243.20	76 990.74	54 995.20	58.19	58.19	50.00	0.00
10	463	11 040.00	-4 932.89	11 040.00	6 447.11	4 932.89	56.40	56.40	50.00	0.00
11	798	366 124.20	134.20	281 490.50	261 614.70	104 509.50	71.46	71.46	50.00	0.00
12	414	119 385.04	2 522.54	93 794.60	96 317.14	23 067.90	80.68	79.25	50.00	0.00
13	724	462 951.00	53 434.90	462 951.00	409 116.10	53 434.90	88.45	88.45	50.00	0.00
14	143	2 438 014.10	598.60	2 438 014.10	2 437 415.50	598.60	99.98	99.98	50.00	0.00
15	116	314.70	314.70	0.00	314.70	0.00	100.00	100.00	50.00	0.00
16	117	33 217.00	0.00	33 217.00	33 217.00	0.00	100.00	84.77	50.00	0.00
17	122	131 411.79	131 411.79	0.00	131 411.79	0.00	100.00	100.00	50.00	0.00
18	198	54 543.67	32 659.70	21 883.97	54 543.67	0.00	100.00	32.78	50.00	0.00

Сортировка: по уровню маржи | Фильтр на уд. маржи: 60 %

Меню: Создать таблицу клиента, Редактировать список ливентов, Калькулятор, Поиск клиента, Снять заявки, Установить ливенты на сервере, Автоматическая проверка ливентов на сервере, Закрыть короткие позиции по всем клиентам, Закрыть короткие позиции по клиенту 714, Не отсылать margin call по клиенту 714

Таблица параметров клиентов (детализированная)

№ п/п	Клиент	Активы	Дек.ср-ва	Ср-ва в уд.	Собств. ср-ва	Задолженность	Тек. УрМ	Лик.УрМ	Мак.УрМ	Shot
1	176	495 910.40	485 910.40	430 708.00	55 202.40	430 708.00	11.36	8.22	50.00	430 708.00
2	390	224 700.00	158 617.77	224 700.00	66 982.23	158 617.77	29.41	29.41	50.00	0.00
3	222	460 084.50	299 526.58	460 084.50	160 957.92	299 526.58	34.90	15.90	50.00	0.00
4	695	18 879.00	-11 851.54	18 879.00	7 027.46	11 851.54	37.22	37.22	50.00	0.00
5	506	137 764.80	127 192.20	58 171.40	69 020.80	68 744.00	50.10	25.25	50.00	68 744.00
6	390	299 614.00	147 657.56	299 614.00	151 956.44	147 657.56	50.72	34.03	50.00	0.00
7	710	690 329.50	-214 630.38	690 329.50	375 699.12	314 630.38	54.42	54.42	50.00	0.00
8	714	348 702.50	-157 495.54	348 702.50	191 206.96	157 495.54	54.83	54.83	50.00	0.00
9	205	131 545.94	82 793.94	6 243.20	76 990.74	54 995.20	58.19	58.19	50.00	0.00
10	463	11 040.00	-4 932.89	11 040.00	6 447.11	4 932.89	56.40	56.40	50.00	0.00
11	798	366 124.20	134.20	281 490.50	261 614.70	104 509.50	71.46	71.46	50.00	0.00
12	414	119 385.04	2 522.54	93 794.60	96 317.14	23 067.90	80.68	79.25	50.00	0.00
13	724	462 951.00	53 434.90	462 951.00	409 116.10	53 434.90	88.45	88.45	50.00	0.00
14	143	2 438 014.10	598.60	2 438 014.10	2 437 415.50	598.60	99.98	99.98	50.00	0.00
15	116	314.70	314.70	0.00	314.70	0.00	100.00	100.00	50.00	0.00
16	117	33 217.00	0.00	33 217.00	33 217.00	0.00	100.00	84.77	50.00	0.00
17	122	131 411.79	131 411.79	0.00	131 411.79	0.00	100.00	100.00	50.00	0.00
18	198	54 543.67	32 659.70	21 883.97	54 543.67	0.00	100.00	32.78	50.00	0.00

Состояние установлено | Время сервера: 12:19:49 | R1=0,0000 | Занесено: 42712

В таблице предусмотрена сортировка счетов по ключевым параметрам: текущему уровню маржи и величине задолженности клиента перед брокером.

Фильтрация по значению уровня маржи предназначена для отображения в таблице только «проблемных» клиентов.

В зависимости от уровня маржи строки таблицы могут изменять цвет, что облегчает менеджеру работу с длинными списками.

Также предусмотрен поиск определенного кода клиента.

Позиции и заявки клиента

Система контроля лимитов "КОЛИБРИ" (Версия 3.7.1)

Получение текущих данных

Таблица параметров клиентов

№/л/л	Клиент	Активы	Дек.срва	Срва в уд	Собств.срва
1	176	495 910,40	485 910,40	-426 968,00	56 942,40
2	390	224 886,00	-158 617,77	224 886,00	66 268,23
3	222	460 747,50	299 526,56	460 747,50	161 220,92
4	695	18 928,20	-11 951,54	18 928,20	7 076,66
5	506	137 770,20	127 192,20	58 492,00	68 700,20
6	350	299 733,50	-148 290,04	299 733,50	151 434,46
7	710	690 687,50	314 630,38	690 687,50	376 257,12
8	714	337 686,50	-146 890,61	337 686,50	191 067,89
9	295	131 589,94	82 793,94	4 480,00	76 303,94
10	463	11 116,00	-4 932,69	11 116,00	6 522,11
11	789	368 124,20	134,20	261 008,00	261 132,20
12	414	119 400,04	2 522,54	93 703,10	96 225,64
13	724	463 900,00	53 434,90	463 900,00	410 465,10
14	143	2 436 182,55	598,60	2 436 182,55	2 435 983,95
15	116	314,70	314,70	0,00	314,70
16	117	33 230,70	0,00	33 230,70	33 230,70
17	122	131 411,79	131 411,79	0,00	131 411,79
18	158	54 500,00	0,00	0,00	54 500,00

Клиент: 350

Список лимитов:

Актив	Счет	Вх.ост.	Вх.лвлет	Тек.ост.	Тек.лвч	Баланс	Тек.ст-ть
EQT V	SUR	146 511	146 927	-148 299	146 927	-148 299	
РАО ЭЭС	,01-0000	103	0	100	0	100	98 270,0
Сургнргз	,01-0000	1	0	1	0	1	2 623,0
РАО ЭЭС	,01-0000	0	0	0	0	0	0,0
ЛУКОЙЛ	,01-0000	0	0	0	0	0	0,0
Ростел -ао	,01-0000	2 000	0	2 050	0	2 050	151 597,5
Сбербанк-п	,01-0000	124	0	0	0	0	0,0
+МосЭнерго	,01-0000	0	0	170	0	170	47 243,0

Активные заявки:

Время	Бумага	Класс	Операция	Колво	Цена	Объем
10:33:21	Ростел -ао	A1-Акц	Продажа	1000	75,000	75 000,00
10:43:25	РАО ЭЭС	A1-Акц	Продажа	50	9,890	49 450,00
12:22:53	РАО ЭЭС	A1-Акц	Продажа	50	9,860	49 300,00

Подтверждение: Снять заявку № 2233173307

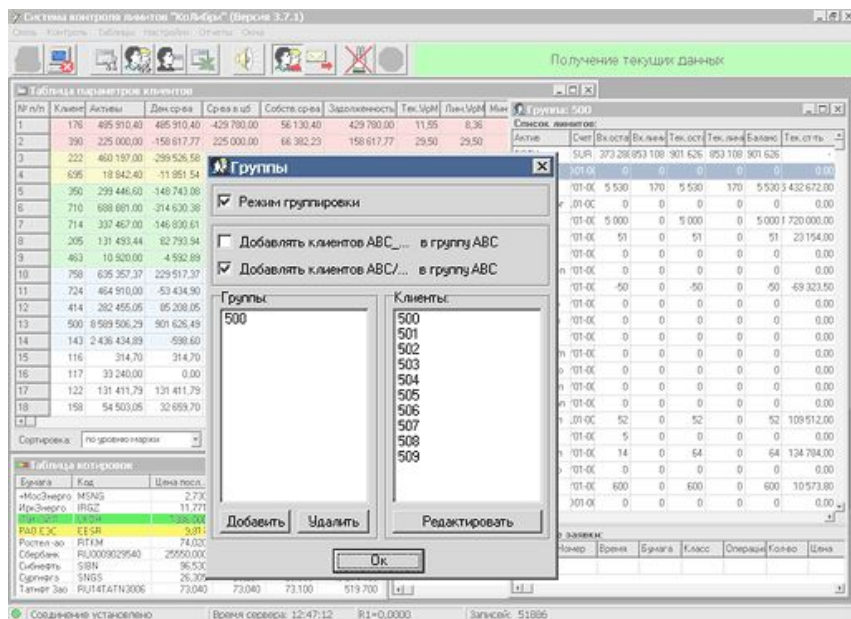
Создатель установленно | Время сервера: 12:31:26 | R1=0,0000 | Занесено: 46378

«Таблица клиента» состоит из двух частей:

в верхней отображаются позиции клиента в деньгах и бумагах, в нижней - активные заявки клиента.

Таблица позволяет посмотреть состояние позиций определенного клиента, настроить список счетов и бумаг, участвующих в расчете параметров маржинального кредитования, снять активные заявки клиента, а также реформировать его короткие позиции сделками РЕПО.

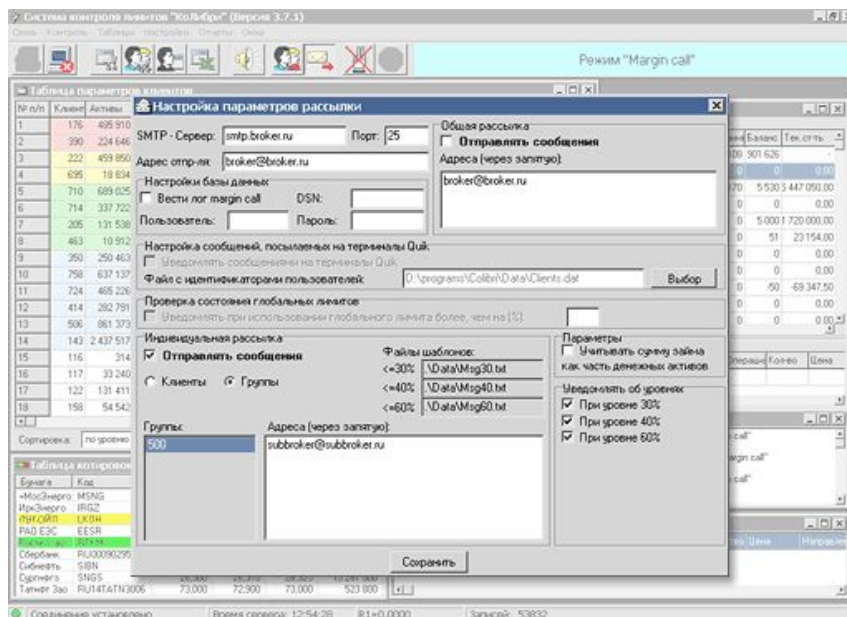
Группировка клиентов



Программа CoLibri может контролировать параметры не только клиентов, но и групп клиентов.

Например, группировка может использоваться для оценки задолженности субброкера, имеющего несколько счетов клиентов. Включение/отключение режима группировки производится нажатием специальной кнопки на панели инструментов.

Режим «Margin call»

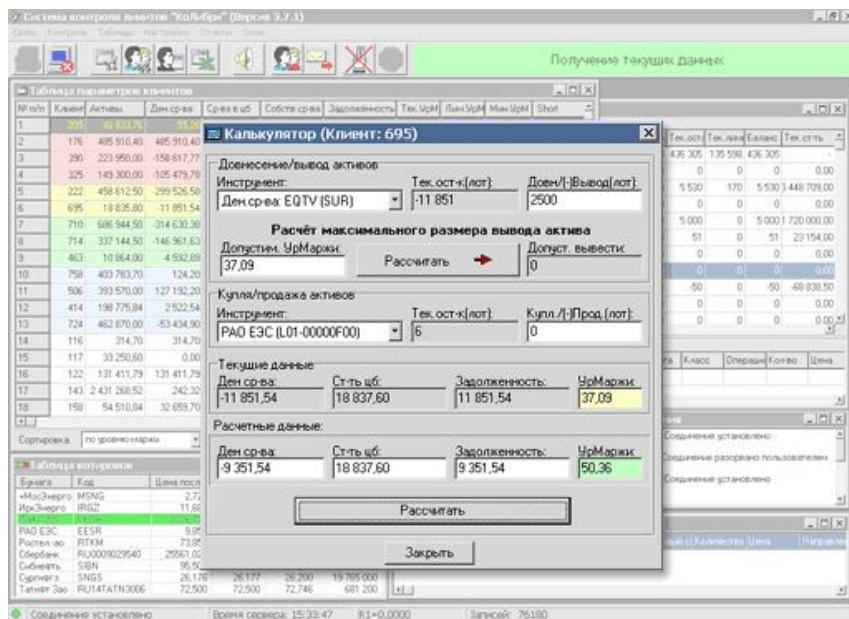


Режим «Margin call» предназначен для автоматического контроля уровней маржи по клиентам и формирования сообщений при достижении критических значений.

Такие сообщения могут быть отправлены непосредственно в системе QUIK или по электронной почте.

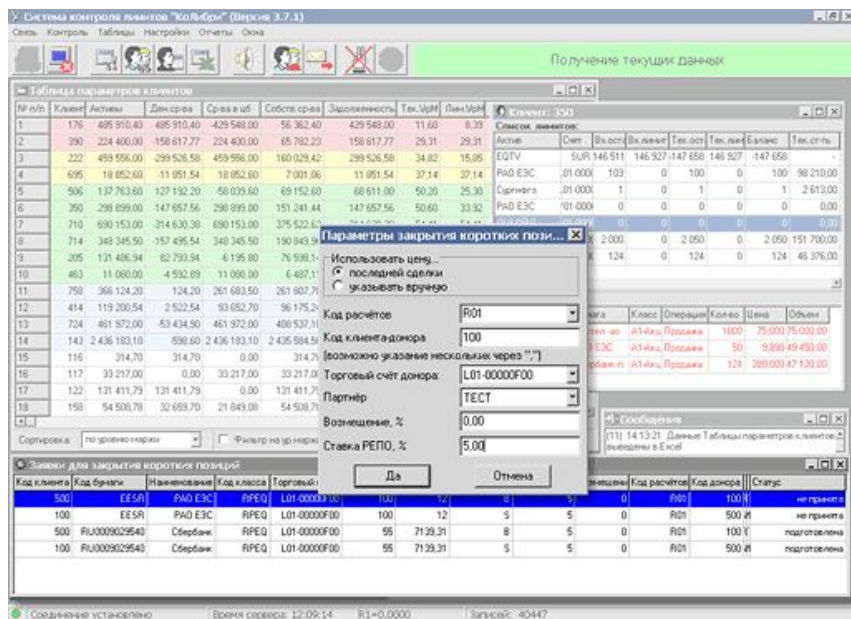
Режим включается нажатием специальной кнопки на панели инструментов.

Калькулятор



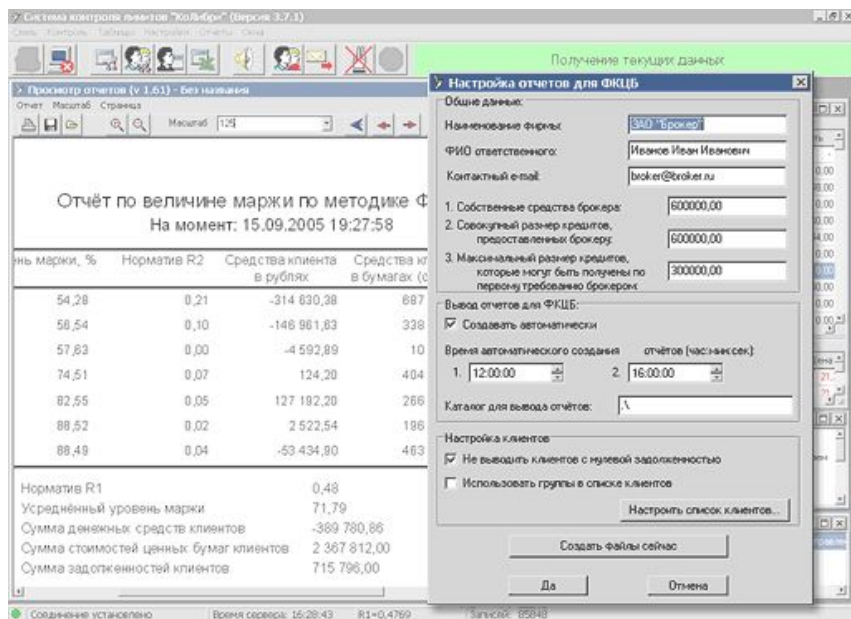
Встроенный калькулятор помогает рассчитать необходимую величину доведения средств на счет (в деньгах, либо бумагах), либо величину закрытия части позиций в случае недостаточности обеспечения клиента по маржинальному кредиту. Калькулятор также применим для оценки изменения показателей кредитования в случае планируемого клиентом вывода средств.

Заккрытие коротких позиций



Короткие позиции клиентов, незакрытые самостоятельно до конца торговой сессии, могут быть реформированы (перенесены на следующий день) путем заключения сделок РЕПО. Функция закрытия позиций может быть применена как к выбранному клиенту, так и ко всем клиентам. При запуске функции будет сформирован пакет сделок РЕПО, которые отображаются в специальной таблице «Заявки для закрытия коротких позиций» и далее могут быть отправлены в торговую систему.

Подготовка отчетов



Программа CoLibri позволяет также создавать отчеты по маржинальному кредитованию в формате, требуемом ФСФР. Отчеты могут создаваться как вручную, так и автоматически, по заданному расписанию. Предусмотрено редактирование списка клиентов (и групп клиентов), включаемых в отчет.

Подготовленный отчет можно посмотреть в специальном окне, сохранить в файл или распечатать.



Программный комплекс

Презентация COLIBRI

Поддержка

Вопросы по функционированию QUIK можно задавать на форуме пользователей:

quik.ru/user/forum

E-mail: support@quik.ru

Горячая линия: +7 383 219 16 06