

Шлюз Plaza-2 для срочного рынка Украинской биржи

Содержание

Описание схемы репликации FOUX	1
Поток FOUX_FUTRADE_REPL - Фьючерсы: заявки и сделки.....	1
Поток FOUX_OPTTRADE_REPL - Опционы: заявки и сделки.....	2
Поток FOUX_FUTINFO_REPL - Фьючерсы: справочная и сессионная информация.....	2
Поток FOUX_OPTINFO_REPL- Опционы: справочная и сессионная информация.....	4

Описание схемы репликации FOUX

Поток FOUX_FUTRADE_REPL - Фьючерсы: заявки и сделки

Схема данных

Таблицы:

- deal - Журнал сделок
- multileg_deal - Журнал сделок по связкам

Таблица deal: Журнал сделок

Таблица 1. Поля таблицы deal

Поле	Тип	Описание
repID	i8	Служебное поле подсистемы репликации
repRev	i8	Служебное поле подсистемы репликации
repAct	i8	Служебное поле подсистемы репликации
id_deal	i8	Номер сделки
sess_id	i4	Идентификатор торговой сессии
isin_id	i4	Уникальный числовой идентификатор инструмента
price	d16.5	Цена
amount	i4	Объем, кол-во единиц инструмента
moment	t	Время заключения сделки
id_ord_sell	i8	Номер заявки продавца
id_ord_buy	i8	Номер заявки покупателя
pos	i4	Кол-во позиций по инструменту на рынке после сделки

Таблица multileg_deal: Журнал сделок по связкам

Таблица 2. Поля таблицы multileg_deal

Поле	Тип	Описание
repID	i8	Служебное поле подсистемы репликации
repRev	i8	Служебное поле подсистемы репликации

replAct	i8	Служебное поле подсистемы репликации
id_deal	i8	Номер сделки
sess_id	i4	Идентификатор торговой сессии
isin_id	i4	Идентификатор инструмента-связки
price	d16.5	Цена первой части парной связки
amount	i4	Объем, кол-во единиц инструмента
moment	t	Время заключения сделки
id_ord_sell	i8	Номер заявки продавца
id_ord_buy	i8	Номер заявки покупателя
rate_price	d16.5	Ставка сделки
swap_price	d16.5	Своп-цена сделки
buyback_amount	d16.2	Сумма обратного выкупа для сделок Репо

Поток FOUX_OPTRADE_REPL - Опционы: заявки и сделки

Схема данных

Таблицы:

- deal - Журнал сделок

Таблица deal: Журнал сделок

Таблица 3. Поля таблицы deal

Поле	Тип	Описание
replID	i8	Служебное поле подсистемы репликации
replRev	i8	Служебное поле подсистемы репликации
replAct	i8	Служебное поле подсистемы репликации
id_deal	i8	Номер сделки
sess_id	i4	Идентификатор торговой сессии
isin_id	i4	Уникальный числовой идентификатор инструмента
price	d16.5	Цена
amount	i4	Объем, кол-во единиц инструмента
moment	t	Время заключения сделки
id_ord_sell	i8	Номер заявки продавца
id_ord_buy	i8	Номер заявки покупателя
pos	i4	Кол-во позиций по инструменту на рынке после сделки

Поток FOUX_FUTINFO_REPL - Фьючерсы: справочная и сессионная информация

Схема данных

Таблицы:

- fut_vcb - справочник торгуемых активов
- session - информация о торговой сессии
- fut_sess_contents - справочник торгуемых инструментов
- multileg_dict - справочник связей

Таблица fut_vcb: справочник торгуемых активов

Таблица 4. Поля таблицы fut_vcb

Поле	Тип	Описание
replID	i8	Служебное поле подсистемы репликации
replRev	i8	Служебное поле подсистемы репликации
replAct	i8	Служебное поле подсистемы репликации
code_vcb	c25	Код базового актива
name	c75	Наименование
exec_type	c1	Тип исполнения
curr	c3	Валюта платежа
section	c50	Наименование Секции

Таблица session: информация о торговой сессии

Таблица 5. Поля таблицы session

Поле	Тип	Описание
replID	i8	Служебное поле подсистемы репликации
replRev	i8	Служебное поле подсистемы репликации
replAct	i8	Служебное поле подсистемы репликации
sess_id	i4	Идентификатор торговой сессии
begin	t	Время начала
end	t	Время окончания
state	i4	Состояние сессии
opt_sess_id	i4	Номер соответствующей опционной сессии
inter_cl_begin	t	Время начала пром. клиринга
inter_cl_end	t	Время окончания пром. клиринга
inter_cl_state	i4	Состояние пром. клиринга
eve_on	i1	Признак того, что доп. вечерняя сессия будет проводиться
eve_begin	t	Время начала доп. вечерней сессии
eve_end	t	Время окончания доп. вечерней сессии
mon_on	i1	Признак того, что доп. утренняя сессия будет проводиться
mon_begin	t	Время начала доп. утренней сессии
mon_end	t	Время окончания доп. утренней сессии

Таблица fut_sess_contents: справочник торгуемых инструментов

Таблица 6. Поля таблицы fut_sess_contents

Поле	Тип	Описание
replID	i8	Служебное поле подсистемы репликации
replRev	i8	Служебное поле подсистемы репликации
replAct	i8	Служебное поле подсистемы репликации
sess_id	i4	Идентификатор торговой сессии
isin_id	i4	Уникальный числовой идентификатор инструмента
short_isin	c25	Описатель инструмента
isin	c25	Символьный код инструмента
name	c75	Наименование инструмента
inst_term	i4	Смещение от спота
code_vcb	c25	Код базового актива
roundto	i4	Количество знаков после запятой в цене

min_step	d16.5	Минимальный шаг цены
lot_volume	i4	К-во единиц базового актива в инструменте
step_price	d16.5	Стоимость шага цены
d_pg	t	Дата окончания обращения инструмента
d_exp	t	Дата исполнения инструмента
is_percent	i1	Признак того, что фьючерс торгуется в процентах. 1 - торгуется в процентах, 0 – торгуется не в процентах
last_cl_quote	d16.5	Котировка после последнего клиринга
signs	i4	Поле признаков
is_trade_evening	i1	Признак торговли в вечернюю сессию
ticker	i4	Уникальный числовой код Главного Спота
state	i4	Состояние торговли по инструменту
price_dir	i1	Направление цены инструмента
multileg_type	i4	Тип связки
legs_qty	i4	Количество инструментов в связке
step_price_clr	d16.5	Стоимость шага цены вечернего клиринга
step_price_interclr	d16.5	Стоимость шага цены пром. клиринга
step_price_curr	d16.5	Стоимость минимального шага цены, выраженная в валюте
d_start	t	Дата ввода инструмента в обращение

Таблица multileg_dict: Справочник связок

Таблица 7. Поля таблицы multileg_dict

Поле	Тип	Описание
repIID	i8	Служебное поле подсистемы репликации
repIRev	i8	Служебное поле подсистемы репликации
repIAct	i8	Служебное поле подсистемы репликации
sess_id	i4	Идентификатор торговой сессии
isin_id	i4	Уникальный числовой код связки
isin_id_leg	i4	Уникальный код инструмента, входящего в связку
qty_ratio	i4	Коэффициент количества

Поток FOUX_OPTINFO_REPL - опционы: справочная и сессионная информация

Схема данных

Таблицы:

- opt_vcb - Справочник торгуемых активов
- opt_sess_contents - Справочник торгуемых инструментов

Таблица opt_vcb: Справочник торгуемых активов

Таблица 8. Поля таблицы opt_vcb

Поле	Тип	Описание
repIID	i8	Служебное поле подсистемы репликации
repIRev	i8	Служебное поле подсистемы репликации

replAct	i8	Служебное поле подсистемы репликации
code_vcb	c25	Код базового актива
name	c75	Наименование
exec_type	c1	Тип исполнения
curr	c3	Валюта платежа

Таблица opt_sess_contents: Справочник торгуемых инструментов

Таблица 9. Поля таблицы opt_sess_contents

Поле	Тип	Описание
replID	i8	Служебное поле подсистемы репликации
replRev	i8	Служебное поле подсистемы репликации
replAct	i8	Служебное поле подсистемы репликации
sess_id	i4	Идентификатор торговой сессии
isin_id	i4	Уникальный числовой идентификатор инструмента
isin	c25	Символьный код инструмента
short_isin	c25	Описатель инструмента
name	c75	Наименование инструмента
code_vcb	c25	Код базового актива
fut_isin_id	i4	Код фьючерсного инструмента
old_kotir	d16.5	Котировка (Теоретическая цена опциона) предыдущей сессии
europе	i1	Разновидность опциона. 0 - американский опцион, 1 - европейский опцион
put	i1	Тип опциона. 0 - Call опцион, 1 - Put опцион
strike	d16.5	Цена страйк
roundto	i4	Количество знаков после запятой в цене
min_step	d16.5	Минимальный шаг премии
lot_volume	i4	К-во единиц базового актива в инструменте
step_price	d16.5	Стоимость шага премии
d_pg	t	Дата окончания обращения инструмента
d_exec_beg	t	Дата начала экспирации инструмента
d_exec_end	t	Дата окончания экспирации инструмента
signs	i4	Поле признаков
last_cl_quote	d16.5	Расчетная Цена (Теоретическая цена опциона) после последнего клиринга
base_isin_id	i4	Числовой идентификатор базового инструмента
d_start	t	Дата ввода инструмента в обращение