

Фондовый рынок

Вечерняя сессия

Основная информация по вводу дополнительной (вечерней) сессии была анонсирована ранее и содержится в документах по ссылке: http://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/ASTS/docs/evening_session/
Раздел с ответами на наиболее частые вопросы: <https://www.moex.com/a7170>

В дополнение к опубликованной ранее информации:

Шлюзовой интерфейс (начиная с версии IFCBroker36): в таблицу FIRMS добавляется поле EVENINGSESSION - Доступность в дополнительной сессии. Если флаг установлен как 'Y' – фирма может подавать заявки в вечернюю сессию.

Запускаются новые торговые отчеты:

«Ежедневный отчет об исполнении обязательств маркет-мейкеров» - SEM85
«Ежемесячный отчет об исполнении обязательств маркет-мейкеров» - SEM86

Вэб-сайт: карточки инструментов будут дополнены информацией, относящейся к вечерней сессии. В данных по объемам и ходу торгов теперь будет учитываться и вечерняя сессия. Архив sl.zip (iss.moex.com/file/stock_boardsecid/SL.ZIP) содержащий dbf-файл с данными инструментов будет дополнен полем EVENINGSES - «Признак допуска бумаги к вечерней сессии».

Айсберг-заявки в безадресных режимах РЕПО с ЦК, РЕПО с ЦК с КСУ, Депозиты с ЦК

Согласно пожеланиям участников реализована возможность отправки айсберг-заявок в указанных секциях рынка. Для таких заявок будут действовать следующие ограничения:

- Минимальное значение реквизита «видимое количество ценных бумаг» составляет не менее чем 20% от суммы сделки.
- Максимальное значение реквизита «видимое количество ценных бумаг» составляет не более чем 80% от суммы сделки.
- Общая сумма айсберг-заявки должна быть больше либо равна 500 млн. руб. Для айсберг-заявок в валюте 10 млн. (USD, EUR, CNY).

До конца 2020 года для айсберг-заявок в перечисленных режимах торгов установлен маркетинговый период - дополнительная комиссия взиматься не будет.

Изменения в интерфейсах (начиная с версии IFCBroker36):

- В таблицы ORDERS и ONEORDER добавляется поле VISIBLEREPOVALUE - Сумма РЕПО видимой части.
- В таблицы ORDERS и ONEORDER добавляется поле VISIBILITYFACTOR - Видимая часть в общей сумме заявки в %.
- В транзакцию CCP_REPO_ORDER добавляется поле VISIBILITYFACTOR - Видимая часть в общей сумме заявки в %.

Изменения в отчетах:

Для рынка депозитов с ЦК нода RECORDS отчета SEM02D «Выписка из реестра заявок на заключение депозитных договоров» будет дополнена полем DepoValueVisible - Видимая сумма депозита. Указывается только для айсберг-заявок.

Отправка адресных заявок в режиме переговорных сделок (РПС) конкретному пользователю

Подача адресных заявок дополняется возможностью отправить заявку конкретному пользователю фирмы. Функциональность реализована с помощью поля ALIAS – кодового идентификатора пользователя. Данная доработка также ограничивает область видимости полученных заявок

фирмы. Теперь пользователь с ALIAS будет видеть только заявки, направленные непосредственно ему.

Для привязки ALIAS к идентификатору пользователя своей фирмы в стандартную форму заказа идентификаторов будет добавлено новое поле.

Доработки шлюзового интерфейса (начиная с версии IFCBroker36): Таблица USERS->USERALIAS – Псевдоним участника. Транзакция NEGDEAL->CPUSERALIAS – Псевдоним адресата.

Новый тип пользовательского идентификатора – технологический администратор

Пользователь с полномочиями технологического администратора имеет возможность менять пароль других идентификаторов фирмы, а также принудительно отключать их от торговой системы. Технологический идентификатор не имеет доступа к информации по заявкам, сделкам и позициям фирмы, а также не может исполнять торговых поручений. Возможность заказа идентификаторов данного типа будет добавлена в заявления на создание логинов.

Завершится перевод облигаций из T0 в T+

Все облигации, оставшиеся в режимах T0, будут переведены в режимы торгов T+ 22.06.2020. Все новые размещаемые облигации также будут допускаться к вторичным торгам в режимы торгов T+.

Добавляются новые T+ борды для облигаций с расчетами в евро:

BOARDID	Название	Английское название	Код расчетов	Валюта расчетов
TQOE	T+ Облигации (расч.в EUR)	T+ Bonds EUR	Y2	EUR
PTOE	РПС с ЦК: Облигации (расч.EUR)	Neg. deals with CCP: Bonds EUR	Yn, n=[0;7]	EUR

Добавляются новые режимы торгов с «Облигациями Д»:

BOARDID	Название	Английское название	Код расчетов	Валюта расчетов
TQRD	T+ Облигации Д	T+ D bonds	Y1	SUR
TQUD	T+ Облигации Д (расч. в USD)	T+ D bonds USD	Y2	USD
TQED	T+ Облигации Д (расч. в EUR)	T+ D bonds EUR	Y2	EUR
PTDB	РПС с ЦК: Д Облигации	NDM with CCP: bonds	Yn, n=[0;7]	SUR
PTED	РПС с ЦК: Д Облигации (расч.EUR)	Neg. deals with CCP: Bonds EUR	Yn, n=[0;7]	EUR
PTUD	РПС с ЦК: Д Облигации (расч.USD)	Neg. deals with CCP: Bonds USD	Yn, n=[0;7]	USD
PSED	Облигации Д – РПС (расч.в EUR)	Neg. deals: D bonds EUR	T0; Z0; Bn, n=[0;30]	EUR
PSUD	Облигации Д - РПС (расч.в USD)	Neg. deals: D bonds USD	T0; Z0; Bn, n=[0;30]	USD

Сектор повышенного инвестиционного риска (ПИР)

Производится упорядочивание списка режимов торгов фондового рынка. В его рамках планируется выделить в отдельные режимы торгов ценные бумаги компаний, включенных в сектор компаний

повышенного инвестиционного риска. Список бумаг, находящихся в секторе повышенного инвестиционного риска доступен по ссылке:

<https://www.moex.com/ru/markets/risksector/>

Допущенные в новый режим торгов ПИР бумаги исключаются из режима торгов с которого они переводятся с даты перевода. Параметры бумаг: точность знака после запятой, минимальный шаг цены, размер лота сохраняются. Также в обратную сторону, если бумага исключается из сектора ПИР, она исключается из режима торгов ПИР и переводится в обычные режимы торгов при улучшении ее состояния, либо в дефолтные режимы при ухудшении ее состояния (для облигаций). Дефолтные борды для акций прекращают использоваться.

Добавляются новые режимы торгов для бумаг, включенных в сектор повышенного инвестиционного риска (ПИР):

BOARDID	Название	Английское название	Код расчетов	Валюта расчетов
TQIR	T+ Облигации ПИР	T+ Bonds inv. risk	Y1	RUB
PSIR	РПС Облигации ПИР	Neg. deals: inv. risk bonds	T0; Z0; Bn, n=[0;30]	RUB
PTIR	РПС с ЦК Облигации ПИР	NDM with CCP: inv. risk bonds	Yn, n=[0;7]	RUB
TQIU	T+ Облигации ПИР (расч.в USD)	T+ Bonds inv. risk (USD)	Y2	USD
PSIU	РПС Облигации ПИР (расч.в USD)	Neg. deals: inv. risk bonds USD	T0; Z0; Bn, n=[0;30]	USD
PTIU	РПС с ЦК Облигации ПИР (расч.в USD)	NDM with CCP: inv. risk bonds USD	Yn, n=[0;7]	USD
TQIE	T+ Облигации ПИР (расч.в EUR)	T+ Bonds inv. risk (EUR)	Y2	EUR
PSIE	РПС Облигации ПИР (расч.в EUR)	Neg. deals: inv. risk bonds EUR	T0; Z0; Bn, n=[0;30]	EUR
PTIE	РПС с ЦК Облигации ПИР (расч.в EUR)	NDM with CCP: inv. risk bonds EUR	Yn, n=[0;7]	EUR
TQIY	T+ Облигации ПИР (расч.в CNY)	T+ Bonds inv. risk (CNY)	Y1	CNY
PSIY	РПС Облигации ПИР (расч.в CNY)	Neg. deals: inv. risk bonds CNY	T0; Z0; Bn, n=[0;30]	CNY
PTIY	РПС с ЦК Облигации ПИР (расч.в CNY)	NDM with CCP: inv. risk bonds CNY	Yn, n=[0;7]	CNY
TQPI	T+ Акции ПИР	T+ stocks inv. risk	Y2	RUB
PSPI	РПС Акции ПИР	Neg. deals: inv. risk stocks	T0; Z0; Bn, n=[0;30]	RUB
PTPI	РПС с ЦК Акции ПИР	NDM with CCP: inv. risk stocks	Yn, n=[0;7]	RUB

Также в рамках упорядочивания режимов торгов фондового рынка планируются следующие изменения в шлюзовых интерфейсах (начиная с версии IFCBroker36):

- В таблицу «Финансовые инструменты» добавляется новый признак «Повышенный инвестиционный риск», принимающий значение = Y, если бумага в секторе повышенного инвестиционного риска (ПИР), N – если нет.
- В таблицу «Финансовые инструменты» добавляется новый признак «Бумага для квал. инвесторов», принимающий значение = Y, если бумага предназначена к покупке только квал. инвесторами, N – если нет. Система торгов не позволит выставить заявку клиенту, не являющемуся квал.инвестору. Возможность продать бумагу для клиента – не квал. инвестора (полученную в наследство и т.д.) сохраняется. Все бумаги, торгующиеся в режимах для квал. инвесторов будут торговаться в обычных режимах торгов. Прекращаются использоваться отдельные режимы торгов для квал. инвесторов.

Новый режим торгов «Аукцион: адресные заявки»

Вводится дополнительный режим «Аукцион: адресные заявки» (boardId:РАСТ). В новом режиме будет проводиться размещение Банком России ОФЗ и КОБР. Пользователям доступны два типа заявок: конкурентная (с указанием цены и объема) и не конкурентная (с общим объемом денежных средств на покупку с учетом комиссии, заявки данного типа недоступны при размещении КОБР). После формирования реестра заявок метчинг происходит исходя из наличия встречных заявок и средневзвешенной цены (для не конкурентных заявок). Новый режим запускается в режиме технической готовности. О начале проведения размещений ОФЗ и КОБР будет сообщено дополнительно. До этого момента все аукционы по размещению КОБР и ОФЗ будут проводиться по-прежнему в АУСТ.

РЕПО с ЦБ с плавающей ставкой

Реализуется проведение операций РЕПО с плавающей ставкой (по отношению к бэнчмарку, в текущей реализации бэнчмарком выступает Ключевая ставка БР). Такие операции будут проводиться как отдельными выпусками бумаг (single stock) с клирингом в НКЦ, так и корзиной бумаг с клирингом в НРД. Для этого создается новый режим торгов для сделок с плавающими ставками с расчетами в рублях. Новый режим торгов «РЕПО с ЦБ РФ: Аукцион поав. ставки» (boardID: FFCB). В режиме торгов РЕПО с ЦБ допускается заключение сделок через купонную выплату. Режим торгов предполагает сроки РЕПО до 380 дней.

Изменения в шлюзовых интерфейсах (начиная с версии IFCBroker36):

- Таблицы ALL_TRADES, NEGDEALS, ONENEGDEAL, TRADES, USTRADES. Новое поле BENCHMARK – Идентификатор бэнчмарка;
- Таблица Boards. Новое поле BENCHMARKID – Идентификатор бэнчмарка;
- Появляется новая не обновляемая таблица BENCHMARKS – Бэнчмарки.

Изменения в отчетах:

Отчеты «Выписка из реестра заявок» SEM02, «Выписка из реестра сделок» SEM03

Нода RECORDS дополняется полями:

- RateType - Для РЕПО с фиксированной ставкой – «FIX», для РЕПО с плавающей ставкой – «FLOATING»;
- Benchmark - Код бенчмарка для РЕПО с плавающей ставкой. Для РЕПО с фиксированной ставкой не используется;
- Изменяется поле RepoRate, теперь оно соответствует Ставка РЕПО для РЕПО с фиксированной ставкой или Спред к бенчмарку для РЕПО с плавающей ставкой в %.

Доработки видимости SMA

SMA-идентификаторы, добавленные в группу, будут видеть другие идентификаторы в этой же группе, включая их заявки и сделки. SMA-администратор, добавленный в группу, сможет выставлять SMA-ограничения только SMA-пользователями в рамках группы и на эту группу в целом. SMA-администратор, не включенный в группу, будет видеть всех SMA-пользователей, даже если у него установлено ограничение по ТКС.

Валютный рынок

Проверка указания кода клиента при подаче заявок с указанием ТКС 2-го и 3-го уровней

Порядок указания в заявках кода клиента участником торгов, совпадающим в одном лице с участником клиринга, поданных с указанием ТКС 2-го или 3-го уровня соответствует действующему порядку при подаче заявок с указанием ТКС 1-го уровня:

- при подаче заявки с указанием ТКС 2-го или 3-го уровня, которым соответствует клиентский расчетный код 1-го уровня или расчетный код ДУ, код клиента должен быть указан обязательно;
- при подаче заявки с указанием ТКС 2-го или 3-го уровня, которым соответствует собственный расчетный код 1-го уровня, код клиента может быть не указан.

Дополнительные проверки клиентских поручений для SMA-идентификаторов

Для стандартизации функциональности реализуются pre-trade проверки для SMA-идентификаторов, аналогичные реализованным на фондовом рынке.

Параметры EURUSD_SPT в режиме OTCF

Размер лота меняется на 1 евро (синхронизация с OTCF), при этом, фиксированные бенды, возможные для подачи заявок в OTCF – 1, 2, 5 и 10 млн. евро.

Обновление и декомиссия шлюзовых интерфейсов

Напоминаем о том, что на 22 июня 2020 намечен запуск в промышленную среду новой версии брокерского интерфейса IFCBroker36 для фондового и валютного рынков. С описанием вы можете ознакомиться по ссылке http://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/ASTS/Bridge_Interfaces/. Запланировано удаление устаревших версий брокерского интерфейса версий 26, 27, 28. Все изменения уже доступны на T1-полигоне (INET).

FIX/FAST сервисы

Изменения в работе сервиса FAST UDP multicast market data отсутствуют. Об изменениях в работе сервисов MFIX Transactional подробно написано в ранее опубликованной новости <https://www.moex.com/n28526/?nt=107>.

Терминалы MOEX Trade SE и MOEX Trade Currency

На дату релиза запланирован выпуск обновлений терминалов MOEX Trade SE и MOEX Trade Currency. Всем пользователям будет предложено установить автоматическое обновление при подключении к торговой системе. Дистрибутивы для ручной установки будут доступны на FTP-сервере (<ftp://ftp.moex.com/pub/Terminals/ASTS/>) с 19 июня 2020.

Новые версии систем уже доступны на тестовых контурах INETCUR_GATEWAY и INET_GATEWAY.