

Список изменений в версии 6.6

1. Утренние торги

В версии 6.6 в системе SPECTRA реализована поддержка проведения утренней дополнительной торговой сессии на срочном рынке в период с 03.00 до 10.00 МСК. О времени реальных торгов будет сообщено дополнительно. Параметры утренней торговой сессии:

- Режим торгов - дополнительная торговая сессия на срочном рынке.
- Время торгов - с 3.00 до 10.00 МСК (бесшовный переход от утренней к основной торговой сессии).
- Торгуемые инструменты - все инструменты срочного рынка аналогично вечерней торговой сессии.
- Риск-менеджмент - торги проводятся с использованием риск-параметров, установленных после окончания основной сессии предыдущего дня.
- Клиринг и расчеты - клиринг и расчеты производятся в тоже время, как и раньше.
- Отчеты - сделки отражаются в том календарном дне, в котором они заключены, никаких дополнительных отчетов клиентам не предоставляется, сделки, заключенные в утреннюю сессию, имеют флаг, который отражается в отчетах.
- Обеспечение - возможны переводы профилей между рынками в рамках единого пула, ввод денежных средств работает, вывод денежных средств и ввод/вывод ценных бумаг невозможен.
- Маркет-мейкинг - исполнение маркет-мейкерских обязательств учитывается в течение всей утренней сессии.
- Неторговые операции (управление клиентами) - обеспечивается возможность лимитирования клиентов, установка и снятие запретов в период с 2:00 до 23:50 МСК.
- Режим OTC - в утреннюю сессию доступна IQS-подсистема.
- Клиенты SMA и DMA функционал - SMA и мастер логины работают аналогично основной сессии.
- Добавление инструментов в торги – новые инструменты не торгуются в утреннюю торговую сессию.

2. Ускорение неторговой команды управления клиентскими лимитами

Увеличена производительность системы при обработке команды управления клиентскими лимитами. В SPECTRA добавлена обновленная команда установки клиентских лимитов ChangeClientMoney (msgid=458). Скорость работы новой команды сопоставима со скоростью обработки торговых приказов. Старая версия команды остается доступной в течение ближайших двух релизов, но будет работать значительно медленнее новой. Пользователям рекомендуется переходить на использование новой команды установки клиентских лимитов.

3. Новая парольная политика

В системе в режиме технологической готовности реализована новая парольная политика. В версии Спектра 6.6 данная опция пока будет выключена. Основные положения новой парольной политики:

- Требования к сложности и оригинальности пароля:
 - Пароль должен содержать не менее 8 символов и соответствовать трем из четырех требований:
 - Содержать латинские строчные буквы (от а до z).
 - Содержать латинские заглавные буквы (от А до Z).
 - Содержать цифры (от 0 до 9).
 - Содержать специальные или не буквенно-цифровые символы (@,+,_ и т.д.).
 - Пароль не должен содержать 3 и более повторяющихся символа.
 - Пароль не должен совпадать с одним из ранее использованных паролей.
- Вводится срок действия пароля. После истечения срока действия пароля доступ пользователя в систему невозможен. Срок действия пароля отображается в терминале Срочного рынка и транслируется в шлюзе в таблице user потока FORTS_FUTINFO_REPL (FORTS_REFDATA_REPL).
- Вводится ограничение на количество неудачных попыток ввода пароля. После исчерпания неудачных попыток ввода пароля пользователь на определенное время блокируется.
- Новая парольная политика распространяется на все логины системы.

4. Изменения в терминале Срочного рынка

- Реализованы новые требования парольной политики:
 - в окно 'Пользователи' добавлен новый параметр 'Срок жизни пароля'
 - в настройках терминала появилась новая опция 'Предупреждать о приближении даты истечения пароля'
- Новое расписание торгов по умолчанию для 'Тех.анализа' с учетом утренней сессии - время открытия торговой сессии теперь в 07:00.

5. Изменения в пользовательском шлюзовом интерфейсе CGate

- В потоке FORTS_FUTTRADE_REPL в таблицах orders_log и multileg_orders_log поле local_stamp объявляется устаревшим и будет удалено в версии 6.9.
- В потоке FORTS_OPTTRADE_REPL в таблице orders_log поле local_stamp объявляется устаревшим и будет удалено в версии 6.9.
- В потоке FORTS_TRADE_REPL в таблицах orders_log и multileg_orders_log поле local_stamp объявляется устаревшим и будет удалено в версии 6.9.
- В потоке FORTS_FUTINFO_REPL в таблицах fut_sess_contents и fut_instruments поле d_start объявляется устаревшим и будет удалено в версии 6.9.
- В потоке FORTS_OPTINFO_REPL в таблице opt_sess_contents поле d_start объявляется устаревшим и будет удалено в версии 6.9.
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблицах fut_sess_contents, opt_sess_contents и fut_instruments поле d_start объявляется устаревшим и будет удалено в версии 6.9.

- В потоке FORTS_DEALS_REPL в таблицу deal добавлены поля:
 - xstatus_buy (i8) - Статус сделки со стороны покупателя.
 - xstatus_sell (i8) - Статус сделки со стороны продавца.
- В потоке FORTS_DEALS_REPL в таблицу multileg_deal добавлены поля:
 - xstatus_buy (i8) - Статус сделки со стороны покупателя.
 - xstatus_sell (i8) - Статус сделки со стороны продавца.
- В потоке FORTS_FUTORDERBOOK_REPL в таблицу info добавлено поле:
 - publication_state (i1) - Состояние публикации среза. 0 - in progress (данные не готовы), 1 - done.
- В потоке FORTS_OPTORDERBOOK_REPL в таблицу info добавлено поле:
 - publication_state (i1) - Состояние публикации среза. 0 - in progress (данные не готовы), 1 - done.
- В потоке FORTS_USERORDERBOOK_REPL в таблицу info добавлено поле:
 - publication_state (i1) - Состояние публикации среза. 0 - in progress (данные не готовы), 1 - done.
- В потоке FORTS_ORDBOOK_REPL в таблицу info добавлено поле:
 - publication_state (i1) - Состояние публикации среза. 0 - in progress (данные не готовы), 1 - done.
- В потоке FORTS_FUTINFO_REPL в таблицу user добавлено поле:
 - password_expiration_date (t) - Дата истечения срока действия пароля.
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблицу user добавлено поле:
 - password_expiration_date (t) - Дата истечения срока действия пароля.

6. Изменения в репозитории схем подачи команд

- Обновленная команда установки клиентских лимитов ChangeClientMoney (msgid=458).
 - broker_code (c4) – код брокера
 - mode (u1) – режим работы команды
 - code (c3) – код клиента
 - coeff_im (c17) – коэффициент клиентского ГО
 - is_auto_update_limit (i4) – флаг автоматической коррекции лимита на величину дохода при закачке после клиринга
 - check_limit (i4) – флаг проверки на достаточность средств
 - limit_money (c17) – лимит денежных средств.
- Удалены следующие устаревшие команды: FutAddOrder, OptAddOrder, FutAddMultilegOrder, FutDelOrder, OptDelOrder, FutMoveOrder, OptMoveOrder, FutDelUserOrders, OptDelUserOrders, FutChangeClientMoney, FutChangeBFMoney, FutExchangeBFMoney, FutTransferClientPosition, OptTransferClientPosition, FutChangeBFLimit.
- В команде DelUserOrders поле instrument_mask переименовано в InstrMask.
- Команда OptChangeRiskParameters переименована в OptChangeRiskParametersNextSession.
- В командах поле local_stamp объявляется устаревшим и будет удалено в версии 6.9.
- Начиная с версии 6.9 в командах будет запрещено использование запятой в качестве разделителя целой и дробной частей числа.

7. Изменения в протоколе TWIME

- Версия схемы TWIME изменена на 5.
- SecurityTypeEnum преобразован в SecurityTypeSet.
- Сообщения OrderMassCancelResponse и OrderMassCancelByBFLimitResponse объединены в одно. Теперь в ответ и на OrderMassCancelRequest и на OrderMassCancelByBFLimitRequest WireGate пользователю отправляет сообщение OrderMassCancelResponse. Из сообщения OrderMassCancelResponse удалено устаревшее поле OrdRejReason.
- Удалены сообщения NewOrderReject, OrderCancelReject, OrderReplaceReject. Вместо удаленных сообщений WireGate при отклонении запросов на добавление, изменение или удаление заявок отправляет пользователю сообщение сессионного уровня BusinessMessageReject.
- Удалены устаревшие сообщения NewOrderMultileg и NewOrderMultilegResponse. Вместо них используются NewOrderSingle и NewOrderSingleResponse соответственно.
- Удалены устаревшие сообщения OrderCancelRequest_6_2 и OrderReplaceRequest_6_2.

8. Изменения в протоколе FAST

- В шаблон сообщения SecurityDefinition добавлены два необязательных поля MinPriceIncrementAmountCurr и SettlPriceOpen. Идентификатор этого шаблона сообщения будет изменен на “21”.
 - MinPriceIncrementAmountCurr - Стоимость минимального шага цены, выраженная в валюте;
 - SettlPriceOpen - Расчетная цена на начало сессии.

Поле MinPriceIncrementAmountCurr будет иметь значение в потоках FUT-INFO и IQS-FUT-INFO, а в потоках OPT-INFO, IQS-OPT-INFO, SPOT-INFO будет транслироваться *nullValue*.

Поле SettlPriceOpen будет иметь значение в потоках FUT-INFO, OPT-INFO, IQS-FUT-INFO, IQS-OPT-INFO, а в потоке SPOT-INFO будет транслироваться *nullValue*.

- Новые объединенные потоки (мультикаст группы):
 - FO-TRADES – поток сделок и статистики по фьючерсам, календарным спредам и опционам;
 - FO-BOOK-1 – поток агрегированных Top of Book по фьючерсам, календарным спредам и опционам;
 - FO-BOOK-5 – поток агрегированных стаканов глубиной 5 по фьючерсам, календарным спредам и опционам;
 - FO-BOOK-20 – поток агрегированных стаканов глубиной 20 по фьючерсам, календарным спредам и опционам;
 - FO-BOOK-50 – поток агрегированных стаканов глубиной 50 по фьючерсам, календарным спредам и опционам;

- IQS-TRADES – поток индикативных сделок и статистики по фьючерсам, календарным спредам и опционам;
- IQS-BOOK-1 – поток агрегированных Top of Book по фьючерсам, календарным спредам и опционам из системы индикативных котировок IQS;
- IQS-BOOK-50 – поток агрегированных стаканов глубиной 50 по фьючерсам, календарным спредам и опционам из системы индикативных котировок IQS.

Новые потоки FO являются результатом объединения существующих потоков FUT и OPT.

- Весной 2021 перестанут транслироваться следующие потоки:
 - FUT-BOOK-1, FUT-BOOK-5, FUT-BOOK-20, FUT-BOOK-50, OPT-BOOK-1, OPT-BOOK-5, OPT-BOOK-20, OPT-BOOK-50 – обновления агрегированного стакана.
 - FUT-TRADES, OPT-TRADES – обновления таблицы сделок и статистика срочного рынка;
 - IQS-FUT-BOOK-1, IQS-FUT-BOOK-50, IQS-OPT-BOOK-1, IQS-OPT-BOOK-50 – обновления агрегированного стакана из системы индикативных котировок;
 - IQS-FUT-TRADES, IQS-OPT-TRADES – обновления таблицы квазисделок и статистика системы индикативных котировок.

О прекращении трансляции указанных потоков будет сообщено дополнительно.

Version 6.6 Changes and Updates

1. Morning trades

In version 6.6, the SPECTRA system provides support for an additional morning trading session on the derivatives market from 03.00 AM to 10.00 AM Moscow time. Real trading times will be announced later. Morning trading session parameters:

- Trading board - an additional trading session on the derivatives market.
- Session time - from 03.00 AM to 10.00 AM Moscow time (the morning session goes into the main session without a break in time).
- Instruments - all derivatives market instruments as in the evening trading session.
- Risk management - trades are performed using risk parameters set after the end of the previous day main session.
- Clearing and settlement - clearing and settlement is done at the same time as before.
- Reports - trades are reflected in the calendar day in which they were made, no additional reports are provided to clients; the trades made in the morning session have a flag, which is reflected in the reports.
- Funds - possible transfers of profiles between markets within a single pool, deposit funds is possible, withdrawal of funds and deposit/ withdrawal of securities is not possible.
- Market making - fulfillment of market maker obligations is taken into account throughout the morning session.
- Non-trading operations (client management) - it is possible to set clients limit , to set and remove prohibitions in the period from 2:00AM to 11:50PM Moscow time.
- OTC - IQS-subsystem is available in the morning session.
- SMA clients and DMA functional - SMA and master logins work similarly to the main session.
- Adding instruments to trades – new instruments are not traded in the morning trading session.

2. Accelerating the non-trading command of managing client limits

System performance was increased for processing a command to manage client limits. An updated command for setting client limits 'ChangeClientMoney' (msgid=458) was added to SPECTRA. The speed of the new command is comparable to the speed of processing trade orders. The old version of the command will be available over the next two releases, but it will be much slower than the new one. We recommend that users switch to using the new command to manage client limits.

3. New password policy

A new password policy was implemented in the system in technological readiness mode. This option will be disabled in Spectra version 6.6. Main provisions of the new password policy:

- Requirements for password complexity and originality:

- The password must be at least 8 characters long and meet three of the four requirements:
 - contain latin lowercase letters (from 'a' to 'z');
 - contain latin capital letters (from 'A' to 'Z');
 - contain numerals (from '0' to '9');
 - contain special or non-alphanumeric characters (@,+,_ , etc).
- Password must not contain 3 or more repeating characters.
- The password must not match one of the previously used passwords.
- The password now has an expiration date. The user cannot access the system after the password expires. The password expiration date is displayed in the Moex Spectra Terminal and broadcast in the gateway in the 'user' table of the FORTS_FUTINFO_REPL stream (FORTS_REFDATA_REPL).
- The number of failed password attempts is limited. The user will be blocked for a certain time when this limit will be exhausted.
- The new password policy applies to all system logins.

4. Changes applied to Moex Spectra Terminal

- New password policy requirements have been implemented:
 - new parameter 'Password lifetime' was added to 'Users' window;
 - new setting option 'Notification when password expiration date is approaching'.
- New default trading sessions schedule for 'Tech. analysis' taking into account the morning session - the opening time of the trading session is now at 07:00.

5. Changes applied to user interface of CGate gateway

- In the stream FORTS_FUTTRADE_REPL in the 'orders_log' and 'multileg_orders_log' tables, the 'local_stamp' field is deprecated and will be removed in version 6.9.
- In the stream FORTS_OPTTRADE_REPL in the 'orders_log' table, the 'local_stamp' field is deprecated and will be removed in version 6.9.
- In the stream FORTS_TRADE_REPL in the 'orders_log' and 'multileg_orders_log' tables, the 'local_stamp' field is deprecated and will be removed in version 6.9.
- In the stream FORTS_FUTINFO_REPL in the 'fut_sess_contents' and 'fut_instruments' tables, the 'd_start' field is deprecated and will be removed in version 6.9.
- In the stream FORTS_OPTINFO_REPL in the 'opt_sess_contents' table, the 'd_start' field is deprecated and will be removed in version 6.9.
- In the stream FORTS_REFDATA_REPL in the 'fut_sess_contents', 'opt_sess_contents' and 'fut_instruments' tables, the 'd_start' field is deprecated and will be removed in version 6.9.
- In the streams FORTS_DEALS_REPL in the 'deal' and 'multileg_deal' tables, the new fields were added:
 - xstatus_buy (i8) - Status of the trade from the buyer's side.
 - xstatus_sell (i8) - Status of the trade from the seller's side.
- In the streams FORTS_FUTORDERBOOK_REPL, FORTS_OPTORDERBOOK_REPL, FORTS_USERORDERBOOK_REPL, FORTS_ORDBOOK_REPL in the 'info' table, the new field was added:

- publication_state (i1) - State of the snapshot publication: 0 - in progress (data not ready), 1 - done.
- In the streams FORTS_FUTINFO_REPL and FORTS_REFDATA_REPL in the 'user' table, the new field was added:
 - password_expiration_data (t) - Password expiration date.

6. Changes applied to command scheme repository

- Updated command for setting client limits 'ChangeClientMoney' (msgid=458):
 - broker_code (c4) – Brokerage Firm code
 - mode (u1) – mode
 - code (c3) – client code
 - coeff_im (c17) – clients collateral ratio
 - is_auto_update_limit (i4) – flag of automatic adjustment of the limit by the amount of income after clearing
 - check_limit (i4) – funds sufficiency verification flag
 - limit_money (c17) – funds limit
- Following commands were removed as deprecated: FutAddOrder, OptAddOrder, FutAddMultilegOrder, FutDelOrder, OptDelOrder, FutMoveOrder, OptMoveOrder, FutDelUserOrders, OptDelUserOrders, FutChangeClientMoney, FutChangeBFMoney, FutExchangeBFMoney, FutTransferClientPosition, OptTransferClientPosition, FutChangeBFLimit.
- In the 'DelUserOrders' command, the 'instrument_mask' field was renamed to 'InstrMask'.
- The 'OptChangeRiskParameters' command was renamed to 'OptChangeRiskParametersNextSession'.
- In commands, the 'local_stamp' field is deprecated and will be removed in version 6.9.

7. Changes applied to TWIME

- TWIME schema version was changed to '5'.
- 'SecurityTypeEnum' was replaced to 'SecurityTypeSet'.
- Messages 'OrderMassCancelResponse' and 'OrderMassCancelByBFLimitResponse' were merged into one. WireGate now sends an 'OrderMassCancelResponse' message to the user in response to 'OrderMassCancelByBFLimitRequest'. Deprecated field 'OrdRejReason' was removed from 'OrderMassCancelResponse'.
- The 'NewOrderReject', 'OrderCancelReject', 'OrderReplaceReject' were removed. When rejection of requests to add, modify or delete orders, WireGate sends a 'BusinessMessageReject' session layer message instead of removed messages.
- Deprecated 'NewOrderMultileg' and 'NewOrderMultilegResponse' messages were removed. Instead, 'NewOrderSingle' and 'NewOrderSingleResponse' messages are used, accordingly.
- Deprecated 'OrderCancelRequest_6_2' (message id=6002) and 'OrderReplaceRequest_6_2' (message id=6003) messages were removed.

8. Changes applied to FAST

- New optional fields were added to ‘Security Definition (d)’ message template: ‘MinPriceIncrementAmountCurr’ and ‘SettlPriceOpen’. The ID of this message template will be changed to “21”:
 - MinPriceIncrementAmountCurr - value of the minimum increment in USD;
 - SettlPriceOpen - settlement price at the start of the session.

The ‘MinPriceIncrementAmountCurr’ field will have a value in the FUT-INFO and IQS-FUT-INFO streams, and ‘nullValue’ will be broadcast in the OPT-INFO, IQS-OPT-INFO, SPOT-INFO streams.

The ‘SettlPriceOpen’ field will have a value in the FUT-INFO, OPT-INFO, IQS-FUT-INFO, IQS-OPT-INFO streams, and ‘nullValue’ will be broadcast in the SPOT-INFO stream.

- New combined streams (multicast groups):
 - FO-TRADES – stream of trades and statistics on futures, calendar spreads and options;
 - FO-BOOK-1 – stream of aggregated Top of Book for futures, calendar spreads and options;
 - FO-BOOK-5 – stream of aggregated order books with a depth of 5 for futures, calendar spreads and options;
 - FO-BOOK-20 – stream of aggregated order books with a depth of 20 for futures, calendar spreads and options;
 - FO-BOOK-50 – stream of aggregated order books with a depth of 50 for futures, calendar spreads and options;
 - IQS-TRADES – stream of indicative trades and statistics on futures, calendar spreads and options;
 - IQS-BOOK-1 – stream of aggregated Top of Book for futures, calendar spreads and options from the system of indicative quotes IQS;
 - IQS-BOOK-50 – stream of aggregated order books with a depth of 50 for futures, calendar spreads and options from the system of indicative quotes IQS.

The new FO streams are the result of combining existing FUT and OPT streams.

- The following streams will stop broadcasting in spring 2021:
 - FUT-BOOK-1, FUT-BOOK-5, FUT-BOOK-20, FUT-BOOK-50, OPT-BOOK-1, OPT-BOOK-5, OPT-BOOK-20, OPT-BOOK-50 – aggregate Order-book data refresh;
 - FUT-TRADES, OPT-TRADES – trade table and Derivatives market statistics data refresh;
 - IQS-FUT-BOOK-1, IQS-FUT-BOOK-50, IQS-OPT-BOOK-1, IQS-OPT-BOOK-50 – aggregate IQS Order-book data refresh.

The termination of the broadcast of these streams will be announced additionally.