

Список изменений в версии 6.7

1. Ограничение доступа к торгам на срочном рынке в утреннюю торговую сессию

В рамках развития функционала "Утренние торги на СР" в системе SPECTRA в версии 6.7 реализован механизм ограничения доступа участников к торгам на срочном рынке в утреннюю торговую сессию. Участники, не желающие участвовать в утренних торгах, подают заявление на установку (снятие) ограничений на доступ к торгам в утреннюю сессию для своих БФ. Под ограничением доступа понимается отсутствие возможности у БФ и ее клиентов выставить или изменить заявки, включая "поручения к НКЦ", в утреннюю торговую сессию. Операции снятия заявок и "поручений к НКЦ", включая массовые, разрешены.

Ограничения доступа к торгам вступают в силу в ближайшую утреннюю торговую сессию, если заявление на установку ограничений направлено организатору торгов до 18:00 МСК. Если же заявление направлено после 18:00 МСК, то ограничения доступа к торгам вступят в силу через одну утреннюю сессию. Ограничение доступа действует с начала утренней сессии до 10:00 МСК. В 10:00 МСК ограничение снимается одновременно для всех участников и их БФ.

Глобально ограничение допуска к торгам в утреннюю сессию будет действовать до тех пор, пока участник торгов не направит организатору торгов заявление на снятие ограничений. Ограничения снимаются в ближайшую утреннюю торговую сессию, если заявление на снятие ограничений направлено организатору торгов до 18:00 МСК. Если же заявление направлено после 18:00 МСК, то ограничения снимаются через одну утреннюю сессию.

Информация об установленных для участников ограничениях транслируется в шлюзе в таблице dealer (поле `order_allowed_in_morning_session`) в потоках FORTS_FUTINFO_REPL, FORTS_REFDATA_REPL, FORTS_INFO_REPL.

2. Декомиссия старого функционала

В соответствии с политикой декомиссии программного обеспечения с 1 февраля 2021 года в системе SPECTRA прекращается поддержка сервиса балансировки риска между срочным и валютным рынками с последующим удалением соответствующих инструментов (RSK) и транзакции FutTransferRisk.

Начиная с версии 6.7 прекращает свою работу сервис IQS_SRV (IQS Proxy), ранее использовавшийся для доступа в подсистему IQS. Для отправки команд в обе подсистемы (IQS и RFS) теперь следует использовать единый сервис OTC_SRV (OTC Proxy).

3. Изменения в пользовательском шлюзовом интерфейсе CGate

- В потоке FORTS_FUTINFO_REPL в таблицу dealer добавлено поле:

order_allowed_in_morning_session (i1) - Доступ к торгам в утреннюю торговую сессию. 0 - доступ к торгам в утреннюю торговую сессию ограничен, 1 - доступ к торгам в утреннюю торговую сессию разрешен.

- В потоке FORTS_INFO_REPL в таблицу dealer добавлено поле:

order_allowed_in_morning_session (i1) - Доступ к торгам в утреннюю торговую сессию. 0 - доступ к торгам в утреннюю торговую сессию ограничен, 1 - доступ к торгам в утреннюю торговую сессию разрешен.

- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблицу dealer добавлено поле:

order_allowed_in_morning_session (i1) - Доступ к торгам в утреннюю торговую сессию. 0 - доступ к торгам в утреннюю торговую сессию ограничен, 1 - доступ к торгам в утреннюю торговую сессию разрешен.

4. Изменения в репозитории схем подачи команд

- Начиная с версии 6.7 процедура FutTransferRisk объявляется устаревшей и будет удалена в последующих версиях.

5. Изменения в отчетах

- При формировании отчетов tranfeeXXYY и tranerrfeeXXYY.csv сбор за Flood Control теперь будет рассчитываться за текущую завершенную сессию, а не за предыдущую. То есть данные в отчетах будут день в день, а не вчерашние.

Version 6.7 Changes and Updates

1. Access limitation to the derivatives market trading during the early trading session

Since version 6.7, participants' access to the derivatives market trading during the early trading session may be limited. Participants who don't want to take part in the morning trading, submit an application to set limits on access to trading in the early session for their BF. If access is limited, BF and its clients cannot add or modify orders, including requests to NCC, during the early trading session. But they can cancel orders and requests to NCC, including mass cancellations.

If an application for limitation is sent to the Moscow Exchange before 6:00 PM Moscow time, then the limitations of access take effect in the nearest early trading session. If an application for limitation is sent to the Moscow Exchange after 6:00 PM Moscow time, then the limitations of access take effect after one early trading session only. Access limitation is in effect from the beginning of the early session until 10:00 AM Moscow time. At 10:00 AM Moscow time, the limitation is lifted simultaneously for all participants and their BF.

Globally, the access limitation in the early session will be actually until the participant submits an application to the Moscow Exchange to remove the limitation. If an application for limitation is sent to the Moscow Exchange before 6:00 PM Moscow time, then the limitations of access take effect in the nearest early trading session. If an application for limitation is sent to the Moscow Exchange after 6:00 PM Moscow time, then the limitations of access take effect after one early trading session only. If an application for limitation remove is sent to the Moscow Exchange before 6:00 PM Moscow time, then the limitations of access will be removed in the nearest early trading session. If an application for limitation remove is sent to the Moscow Exchange after 6:00 PM Moscow time, then the limitations of access will be removed after one early trading session only.

Information about the access limitation set for participants is broadcast via the gateway in the 'deale'r table ('order_allowed_in_morning_session' field) in FORTS_FUTINFO_REPL, FORTS_REFDATA_REPL, FORTS_INFO_REPL streams.

2. The old functionality decommissioning

In accordance with the software decommissioning policy, since February 1, 2021, the SPECTRA system stops supporting the risk balancing service between the derivatives and FX markets, with the subsequent removal of the corresponding instruments (RSK) and the 'FutTransferRisk' transaction.

The IQS_SRV (IQS Proxy) service for access to the IQS subsystem will not be used since version 6.7. Now the OTC_SRV service (OTC Proxy) will be used to send commands to both subsystems (IQS and RFS).

3. Changes applied to user interface of CGate gateway

- In the stream FORTS_FUTINFO_REPL in the 'dealer' table, the new field was added:

order_allowed_in_morning_session (i1) - Access to trading during the early trading session. 0 - Access to trading during the early trading session is limited., 1 - Access to trading during the early trading session is allowed.
- In the stream FORTS_INFO_REPL in the 'dealer' table, the new field was added:

order_allowed_in_morning_session (i1) - Access to trading during the early trading session. 0 - Access to trading during the early trading session is limited., 1 - Access to trading during the early trading session is allowed.
- In the stream FORTS_REFDATA_REPL in the 'dealer' table, the new field was added:

order_allowed_in_morning_session (i1) - Access to trading during the early trading session. 0 - Access to trading during the early trading session is limited., 1 - Access to trading during the early trading session is allowed.

4. Changes applied to command scheme repository

- Since version 6.7, the 'FutTransferRisk' procedure is deprecated and will be removed in future versions.

5. Changes applied to reports

- Now the Flood Control fee for 'tranfeeXXYY' and 'tranerrfeeXXYY.csv' reports is calculated for the current ended session, and not for the previous one. That is, the reports data will be day to day, not yesterday's.