

## Список изменений в версии 6.9

### 1. Маржирование и исполнение обязательств по уплате налога в TS SPECTRA

В TS SPECTRA в версии 6.9 реализован функционал маржирования и исполнения обязательств Участников клиринга-нерезидентов по уплате налога на Срочном рынке, учитываемых по Расчетным кодам, не являющимся Расчетными кодами Единого пула. Объем обязательств Участников клиринга по уплате суммы, соответствующей сумме налога, рассчитывается НКЦ и поступают в TS SPECTRA для целей маржирования и списания. Учет суммы налога ведется в TS SPECTRA в разрезе Расчетных кодов Участников клиринга-нерезидентов по специальным разделам (blocked\_tax), открытым в рамках данных Расчетных кодов. Средства, учитываемые на специальном разделе, блокируются, уменьшая тем самым величину Свободного лимита по Расчетному коду.

Средства, заблокированные под уплату налогов, транслируются в шлюзе:

- в таблицах part\_sa и money\_clearing\_sa в поле blocked\_tax.

Выводятся в отчетах:

- В отчетах monXXYY.csv/mon\_newXXYY.csv для ПК Участников клиринга-нерезидентов значение блокируемого налога (blocked\_tax) учитывается в поле go.
- В отчете daymonXXYY.csv для ПК Участников клиринга-нерезидентов значение блокируемого налога (blocked\_tax) учитывается в поле gol2.

И отображаются в терминале Срочного рынка:

- В окне 'Средства по расчетным кодам' - параметр 'Забл. Налог'

Окончательное списание суммы налога производится в режиме онлайн по команде от НКЦ. Списание окончательных сумм налога проводится в TS SPECTRA по специальным Брокерским фирмам, открытым в рамках Расчетных кодов Участников клиринга-нерезидентов.

### 2. Регистрация привязки 7кк - ClientCode (на ФР) через ЕРК

В TS SPECTRA в режиме технологической готовности реализован механизм привязки к 7-значному разделу краткого кода клиента на Фондовом рынке через интерфейс Единой регистрации клиентов. В интерфейс ЕРК добавлен новый параметр ClientCodeSM - Идентификатор на Фондовом рынке. Участник с помощью данного параметра может как указывать привязку в момент регистрации 7-значного раздела (включая "активацию болванки"), так и менять или удалять привязку для существующих разделов. Возможные значения параметра:

- NULL - не менять привязку;
- (пусто) – удалить привязку;
- любое значимое - зарегистрировать\изменить привязку.

### 3. Перенос времени расчета индикативного курса с 18:30 на 18:44

В рамках программы по ускорению пост-трейдинговых, клиринговых и пре-трейдинговых операций в TS SPECTRA осуществлен перенос времени фиксации индикативных курсов для расчета вариационной маржи с 18:30 на 18:44. Данное изменение времени включает в себя все индикативные курсы: USD/RUB, EUR/RUB, CAD/RUB, CHF/RUB, CNY/RUB, JPY/RUB, TRY/RUB, USD/CHF, USD/JPY и т.д. При этом фиксация индикативного курса для вариационной маржи промклиринга остается неизменным - 13:45.

#### **4. Отмена комиссионного вознаграждения по сделкам урегулирования на срочном рынке**

В целях унификации порядка взимания/невзимания комиссионного вознаграждения по сделкам урегулирования на всех рынках Группы «Московская Биржа», на Срочном рынке отменено взимание биржевого сбора и комиссионного вознаграждения за клиринговые услуги по следующим сделкам урегулирования:

- закрывающие Срочные контракты, заключенные в рамках процедуры кросс-дефолта;
- закрывающие Срочные контракты, заключенные в связи с неисполнением Маржинального требования;
- закрывающие Срочные контракты, заключенные в связи с неисполнением Обязательства по поставке по поставочным Срочным контрактам на драгоценные металлы;
- балансирующие Срочные контракты, заключенные с Добросовестным участником клиринга без подачи заявок.

Признак сделок урегулирования транслируется в шлюзе в таблицах своих заявок `orders_log` и `multileg_orders_log` (поле `reason`) и сделок `user_deal` и `user_multileg_deal` (поля `reason_buy` и `reason_sell`), а также в отчетах `f04`, `f04cl`, `o04`, `o04cl`.

Вместо комиссии с Недобросовестных участников клиринга взимается штраф за заключение закрывающих Срочных контрактов в случае заключения их от имени Недобросовестного участника клиринга:

- закрывающие Срочные контракты, заключенные в рамках процедуры кросс-дефолта;
- закрывающие Срочные контракты, заключенные в связи с неисполнением Маржинального требования;
- закрывающие Срочные контракты, заключенные в связи с неисполнением Обязательства по поставке по поставочным Срочным контрактам на драгоценные металлы.

Штрафы за заключение сделок урегулирования от имени Добросовестного участника клиринга (балансирующие Срочные контракты, заключенные с Добросовестным участником клиринга без подачи заявок) с ДУКа не взимаются.

Сумма штрафа за заключение закрывающих Срочных контрактов равна сумме 5 биржевых сборов, установленных ПАО Московская Биржа, и 5 комиссионных вознаграждений за клиринг от суммы закрывающих Срочных контрактов, без применения скальперской скидки.

Штраф рассчитывается по каждой сделке урегулирования и учитывается по 7-значному разделу Участника клиринга, который указан в сделке урегулирования.

Информация о штрафах транслируется в шлюзе в таблице `part` потока `FORTS_PART_REPL` (суммарно по 7-значному разделу), а также в новой таблице `penalty` потока `FORTS_FEE_REPL` (в разрезе сделок).

Штрафы за заключение закрывающих Срочных контрактов не взимаются:

- Если в отношении Участника клиринга проводится процедура Ликвидационного неттинга.
- Если Участник клиринга находится в статусе «Приостановка клирингового обслуживания Участника клиринга по причине аннулирования лицензии на осуществление профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг».

Информация по данным блокировкам транслируется в шлюзе в таблице `clearing_members` потока `FORTS_REFDATA_REPL`.

Сделки урегулирования, по которым штрафы не взимались по причине аннулирования лицензии на осуществление профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, помечаются в таблицах сделок в полях `xstatus_sell` и `xstatus_buy` специальным признаком:

- `eDontFineRF (0x80000000000000)` - Признак невзимания штрафа за сделки урегулирования.

## 5. Изменения в терминале Срочного рынка

- Изменения в окне 'Запреты на операции':
  - добавлен новый параметр 'Окончание' (дата окончания обращения фьючерса);
  - добавлен фильтр по дате окончания обращения фьючерса;
  - добавлена возможность устанавливать одиночный запрет по опционам логину HE Главного трейдера.
- В окне 'Средства по расчетным кодам' добавлен новый параметр 'Забл. Налог' - сумма, заблокированная для уплаты налога.
- В окне 'Средства по расчетным кодам в клиринге' добавлен новый параметр 'Забл. Налог' - сумма, заблокированная для уплаты налога на начало сессии.

## 6. Изменения в пользовательском шлюзовом интерфейсе CGate

- Удалены потоки `FORTS_FUTTRADE_REPL` и `FORTS_OPTTRADE_REPL`. Вместо них следует использовать поток `FORTS_TRADE_REPL`.
- Удалены потоки `FORTS_FUTORDERBOOK_REPL` и `FORTS_OPTORDERBOOK_REPL`. Вместо них следует использовать поток `FORTS_USERORDERBOOK_REPL`.
- Удалены потоки `FORTS_FUTCOMMON_REPL` и `FORTS_OPTCOMMON_REPL`. Вместо них следует использовать поток `FORTS_COMMON_REPL`.
- Удалены потоки `FORTS_FUTINFO_REPL` и `FORTS_OPTINFO_REPL`. Вместо них следует использовать поток `FORTS_REFDATA_REPL`.
- Удалены потоки `FORTS_FUTAGGR5_REPL`, `FORTS_FUTAGGR20_REPL`, `FORTS_FUTAGGR50_REPL`, `FORTS_OPTAGGR5_REPL`, `FORTS_OPTAGGR20_REPL` и `FORTS_OPTAGGR50_REPL`. Вместо них следует использовать потоки `FORTS_AGGR5_REPL`, `FORTS_AGGR20_REPL` и `FORTS_AGGR50_REPL`.
- В потоке `FORTS_TRADE_REPL` из таблиц `orders_log` и `multileg_orders_log` удалено поле `local_stamp`.
- В потоке `FORTS_TRADE_REPL` в таблицы `orders_log` и `multileg_orders_log` добавлено поле:
  - `reason (i4)` - Признак (причина) заявки, выставленной для заключения сделки урегулирования обязательств.
- В потоке `FORTS_TRADE_REPL` в таблицы `user_deal` и `user_multileg_deal` добавлены поля:
  - `reason_buy (i4)` - Признак (причина) сделки урегулирования покупателя.
  - `reason_sell (i4)` - Признак (причина) сделки урегулирования продавца.
- В потоке `FORTS_USERORDERBOOK_REPL` в таблицу `orders` добавлено поле:
  - `reason (i4)` - Признак (причина) заявки, выставленной для заключения сделки урегулирования обязательств.
- В поток `FORTS_FEE_REPL` добавлена таблица `penalty`:
  - `replID (i8)` - Служебное поле подсистемы репликации.
  - `replRev (i8)` - Служебное поле подсистемы репликации.
  - `replAct (i8)` - Служебное поле подсистемы репликации.
  - `sess_id (i4)` - Номер сессии.
  - `id_deal (i8)` - Номер сделки.
  - `id_deal_multileg (i8)` - Номер сделки по связке.
  - `moment (t)` - Время заключения сделки.
  - `moment_ns (u8)` - Время заключения сделки (UNIX-время в наносекундах по стандарту UTC).
  - `code_buy (c7)` - Код покупателя.
  - `code_sell (c7)` - Код продавца.

- penalty\_buy (d26.2) - Штраф по сделке покупателя.
  - penalty\_sell (d26.2) - Штраф по сделке продавца.
- В потоке FORTS\_PART\_REPL в таблицу part добавлено поле:
  - penalty (d26.2) - Штраф за сделки урегулирования, заключенные при проведении процедуры принудительного закрытия позиций Недобросовестного Участника клиринга.
- В потоке FORTS\_PART\_REPL в таблицу part\_sa добавлено поле:
  - blocked\_tax (d26.2) - Средства, заблокированные под выплату налогов.
- В потоке FORTS\_REFDATA\_REPL из таблиц fut\_sess\_contents, fut\_instruments и opt\_sess\_contents удалено поле d\_start.
- В потоке FORTS\_REFDATA\_REPL в таблицу prohibition добавлено поле:
  - xprohibition\_id (i8) - Номер запрета
- В потоке FORTS\_REFDATA\_REPL в таблице prohibition начиная с версии 6.9 поле prohib\_id объявляется устаревшим и будет удалено в версии 6.15.
- В потоке FORTS\_REFDATA\_REPL таблица usd\_online начиная с версии 6.9 объявляется устаревшей и будет удалена в версии 6.15. Вместо этой таблицы надо использовать таблицу curr\_online потока MOEX\_RATES\_REPL.
- В потоке FORTS\_CLR\_REPL в таблицу money\_clearing\_sa добавлено поле:
  - blocked\_tax (d26.2) - Средства, заблокированные под выплату налогов.

## 7. Изменения в репозитории схем подачи команд

- Из команд AddOrder, MoveOrder, DelOrder, DelUserOrders, IcebergAddOrder, IcebergMoveOrder и IcebergDelOrder удалено поле local\_stamp. Добавлены новые типы команд: AddOrder (msgid=465), MoveOrder (msgid=460), DelOrder (msgid=461), DelUserOrders (msgid=466), IcebergAddOrder (msgid=462), IcebergMoveOrder (msgid=463) и IcebergDelOrder (msgid=464).
- Удалена устаревшая команда FutTransferRisk.

## 8. Изменения в отчетах

- В отчеты f04, f04cl, o04, o04cl, fut\_deal, opt\_deal в поле Type добавлены новые типы платежа, отражающие информацию о штрафах:
  - отчеты о сделках с фьючерсами f04, f04cl, fut\_deal:
    - «21» – для закрывающих Срочных контрактов, заключенных в рамках процедуры кросс-дефолта;
    - «22» – для закрывающих Срочных контрактов, заключенных в связи с неисполнением Маржинального требования;
    - «23» – для закрывающих Срочных контрактов, заключенных в связи с неисполнением Обязательства по поставке по поставочным Срочным контрактам на драгоценные металлы.
    - «3» - для балансирующих Срочных контрактов, заключенных с Добросовестными участниками клиринга без подачи заявок.
  - отчеты о заключенных опционных контрактах o04, o04cl, opt\_deal :
    - «6» – для закрывающих Срочных контрактов, заключенных в рамках процедуры кросс-дефолта;
    - «7» – для закрывающих Срочных контрактов, заключенных в связи с неисполнением Маржинального требования.
    - «3» - для балансирующих Срочных контрактов, заключенных с Добросовестным участником клиринга без подачи заявок.
- В отчетах раuXXYY.csv и раuclXXYY.csv штрафы учитываются в состоянии текущей денежной позиции.
- В отчетах monXXYY.csv/mon\_newXXYY.csv для ПК Участников клиринга-нерезидентов значение блокируемого налога (blocked\_tax) учитывается в поле go.

- В отчете daumonXXYY.csv для ПК Участников клиринга-нерезидентов значение блокируемого налога (blocked\_tax) учитывается в поле gol2.

## 9. Изменения в протоколе FAST

- Разъединенные потоки для фьючерсов и опционов выводятся из эксплуатации, необходимо использовать объединенные потоки. Вместо FUT-BOOK-1, FUT-BOOK-5, FUT-BOOK-20, FUT-BOOK-50, OPT-BOOK-1, OPT-BOOK-5, OPT-BOOK-20, OPT-BOOK-50, FUT-TRADES, OPT-TRADES, IQS-FUT-BOOK-1, IQS-FUT-BOOK-50, IQS-OPT-BOOK-1, IQS-OPT-BOOK-50, IQS-FUT-TRADES, IQS-OPT-TRADES необходимо использовать FO-TRADES, FO-BOOK-1, FO-BOOK-5, FO-BOOK-20, FO-BOOK-50, IQS-TRADES, IQS-BOOK-1, IQS-BOOK-50. Обе группы доступны в промышленном и тестовом контурах.
- В сообщении SecurityDefinition (d) в поле MDFeedTypes добавляются все объединенные потоки и убираются разъединенные.
- В потоках FUT-INFO, OPT-INFO, IQS-FUT-INFO, IQS-OPT-INFO в сообщениях SecurityDefinition (d) значение поля MarketSegmentID заменено на 'D'.
- В потоках FO-TRADES, FO-BOOK-1, FO-BOOK-5, FO-BOOK-20, FO-BOOK-50, IQS-TRADES, IQS-BOOK-1, IQS-BOOK-50 в сообщении Trading Session Status (h) значение поля MarketSegmentId меняется на "D".
- В xml-описаниях конфигураций потоков FUT-INFO, OPT-INFO, IQS-FUT-INFO, IQS-OPT-INFO значение атрибута marketID меняется на 'D'.
- Для фьючерсов, календарных спредов и опционов в сообщении SecurityDefinition (d) прекращена трансляция группы полей с EventType=5 - Дата ввода инструмента в обращение.
- Добавлены новые значения поля Flags (тэг 20008) в сообщении SecurityDefinition(d).

## 10. Изменения в протоколе FIX

- В поле SecondaryClOrdID в шлюзе FIX и в сервисе FIX Drop Copy прекращена трансляция технической информации типа \$XX\$ в первых четырех символах. Теперь комментарий пользователя, указанный при добавлении заявки, транслируется без изменений в протоколе FIX. Ранее в случае переполнения клиентом допустимого размера этого поля значение обрезалось, теперь клиенту отправляется Reject с информацией о некорректности значения поля SecondaryClOrdID.
- Добавлена трансляция поля Flags (tag 20008) в шлюзе FIX в сообщениях Execution Report по сделкам, и в сервисе FIX Drop Copy во всех сообщениях Execution Report.

## Version 6.9 Changes and Updates

### 1. Margining and execution of obligations to pay tax in TS SPECTRA

TS SPECTRA version 6.9 implements the functionality of margining and execution of obligations of the Clearing Members – non-residents for payment of tax on the Derivatives Market, accounted on Settlement Accounts that are not the Settlement Accounts of the Unified Collateral Pool. The obligations of the Clearing Members to pay the tax amount are calculated by NCC and transferred to TS SPECTRA for the purposes of margin and write-off.

The tax amounts are accounted for in TS SPECTRA in the context of the Settlement Accounts of the non-resident Clearing Members on special sections (blocked\_tax) opened within these Settlement Accounts.

Funds accounted for in special account are blocked, reducing the amount of the Free Limit for the Settlement Account.

Funds blocked for taxes are broadcast in the gateway:

- in tables 'part\_sa' and 'money\_clearing\_sa' in 'blocked\_tax' field.

Shown in reports:

- In 'monXXYY.csv/mon\_newXXYY.csv' reports for SA of the Clearing Members – non-residents the value of the blocked tax ('blocked\_tax') is accounted for in the 'go' field.
- In the 'daymonXXYY.csv' report for SA of the Clearing Members – non-residents the value of the blocked tax ('blocked\_tax') is accounted for in the 'gol2' field.

And displayed in the Moex Spectra Terminal:

- In the 'Settlement account assets' window - parameter 'Blocked tax'

The final write-off of the tax amount is made online at the command from the NCC. The accounting and writing off of the final tax amounts is carried out in TS SPECTRA for special Brokerage Firms, opened within the Settlement Accounts, for which the accounting of interim tax amounts corresponding to the written off final tax amounts was made.

### 2. Registration of binding the seven-digit section code to ClientCode (on Securities Market) via Unified Customer Registration service (UCR)

The mechanism of binding the seven-digit section code to the short ClientCode (on Securities market) via UCR is done in TS SPECTRA and is in technological readiness mode. New 'ClientCodeSM' parameter (Identifier on Securities Market) was added into UCR interface. Using this parameter, the participant can indicate the binding at the time of registration of a 7-digit section (switching on "activation of the blank"), change or remove the binding for existing sections.

Possible parameter values:

- NULL - do not change the binding;
- (empty) – remove binding;
- any value - register \change binding.

### 3. Postponement of the calculation of the indicative rate from 18:30 to 18:44

As part of the program to accelerate post-trading, clearing and pre-trading operations in TS SPECTRA, the time of fixing indicative rates for calculating the variation margin was postponed from 18:30 to 18:44. This time change includes all indicative rates: USD/RUB, EUR/RUB, CAD/RUB, CHF/RUB, CNY/RUB, JPY/RUB, TRY/RUB, USD/CHF, USD/JPY etc. At the same time, the fixing time of the indicative rate for the variation margin in intraday clearing session remains unchanged - 13:45.

#### **4.Cancellation of commission on settlement trades in the Derivatives Market**

For unification of the procedure for charging / not charging commissions for settlement trades in all markets of the Moscow Exchange Group, the exchange fees and commissions for clearing services was canceled in the Derivatives Market for the following settlement trades:

- closing Derivatives contracts entered into under the cross-default procedure;
- closing Derivatives Contracts entered into upon non-fulfillment of the Margin Call;
- closing Derivatives contracts entered into in into upon non-fulfillment of the Delivery Obligation on the deliverable Derivatives contracts for precious metals;
- balancing Derivatives contracts entered into with the Non-defaulting Clearing Member without submitting orders.

The sign of settlement trades is broadcast in the gateway in the tables of yours orders 'orders\_log' and 'multileg\_orders\_log' ('reason' field) and of trades 'user\_deal' and 'user\_multileg\_deal' ('reason\_buy' and 'reason\_sell' fields), and also in 'f04', 'f04cl', 'o04', 'o04cl' reports.

If the closing Derivatives contract is concluded on behalf of the Defaulting Clearing Member, then a penalty is charged instead of a commission:

- closing Derivatives contracts entered into under the cross-default procedure;
- closing Derivatives Contracts entered into upon non-fulfillment of the Margin Call;
- closing Derivatives contracts entered into in into upon non-fulfillment of the Delivery Obligation on the deliverable Derivatives contracts for precious metals.

Penalties for concluding settlement trades on behalf of the Non-Defaulting Clearing Member (balancing Derivatives contracts entered into with the Non-Defaulting Clearing Member without submitting orders) are not charged from the Non-Defaulting Clearing Member.

The penalty amount for concluding the closing Derivatives contracts is equal to the sum of 5 exchange fees (established by Moscow Exchange) and 5 clearing commissions from the amount of the closing Derivatives contracts, without applying a scalper discount.

The penalty is calculated for each settlement trade and is accounted for under the 7-digit section of the Clearing Member specified in the settlement trade.

Information about penalties is broadcast in the gateway in the 'part' table of the FORTS\_PART\_REPL stream (in total for the 7-digit section), as well as in the new 'penalty' table of the FORTS\_FEE\_REPL stream (in terms of trades).

No penalties are charged for the conclusion of Closing Derivatives contracts:

- If the Clearing Member is subject to the Liquidation Netting procedure.
- If the Clearing Member is in the status "Suspension of clearing services for the Clearing Member due to cancellation of the license to carry out professional activities in the Securities Market".

Information on these blocking is broadcast in the gateway in the 'clearing\_members' table of the FORTS\_REFDATA\_REPL stream.

Settlement trades for which no fines were charged due to the cancellation of the license to carry out professional activities in the Securities Market are marked in the tables of trades in the 'xstatus\_sell' and 'xstatus\_buy' fields with a special sign:

- eDontFineRF (0x80000000000000) - Sign of no penalty for settlement trades.

#### **5.Changes applied to Moex Spectra Terminal**

- Changes in the 'Prohibitions' window :

- new parametr 'End date' (futures end date);
- new filtr 'Futures end date';
- now not only Chief Trader can set prohibitions for options but the Brokerage Firm too.
- New parameter 'Blocked tax' (Amount blocked for tax) was added into the 'Settlement account assets' window.
- New parameter 'Blocked tax' (Amount blocked for tax at the beginning of the session) was added into the 'Settlement account assets (clearing)' window.

## 6. Changes applied to user interface of CGate gateway

- FORTS\_FUTTRADE\_REPL and FORTS\_OPTTRADE\_REPL streams were deleted. Use the FORTS\_TRADE\_REPL stream instead.
- FORTS\_FUTORDERBOOK\_REPL and FORTS\_OPTORDERBOOK\_REPL streams were deleted. Use the FORTS\_USERORDERBOOK\_REPL stream instead.
- FORTS\_FUTCOMMON\_REPL and FORTS\_OPTCOMMON\_REPL streams were deleted. Use the FORTS\_COMMON\_REPL stream instead.
- FORTS\_FUTINFO\_REPL and FORTS\_OPTINFO\_REPL streams were deleted. Use the FORTS\_REFDATA\_REPL stream instead.
- FORTS\_FUTAGGR5\_REPL, FORTS\_FUTAGGR20\_REPL, FORTS\_FUTAGGR50\_REPL, FORTS\_OPTAGGR5\_REPL, FORTS\_OPTAGGR20\_REPL and FORTS\_OPTAGGR50\_REPL streams were deleted. Use the FORTS\_AGGR5\_REPL, FORTS\_AGGR20\_REPL and FORTS\_AGGR50\_REPL streams instead.
- The 'local\_stamp' field was deleted from 'orders\_log' and 'multileg\_orders\_log' tables in FORTS\_TRADE\_REPL stream.
- New field was added into 'orders\_log' and 'multileg\_orders\_log' tables in FORTS\_TRADE\_REPL stream:
  - reason (i4) - The flag (reason) of the order submitted for the making of the settlement trade of obligations.
- New fields was added into 'user\_deal' and 'user\_multileg\_deal' tables in FORTS\_TRADE\_REPL stream:
  - reason\_buy (i4) - The flag(reason) of the buyer's settlement trade.
  - reason\_sell (i4) - The flag(reason) of the seller's settlement trade.
- New field was added into 'orders' table in FORTS\_USERORDERBOOK\_REPL stream:
  - reason (i4) - The flag (reason) of the order submitted for the making of the settlement trade of obligations.
- New 'penalty' table was added into FORTS\_FEE\_REPL stream:
  - replID (i8) - Service field of the replication subsystem.
  - replRev (i8) - Service field of the replication subsystem.
  - replAct (i8) - Service field of the replication subsystem.
  - sess\_id (i4) - Trading session ID.
  - id\_deal (i8) - Deal ID number.
  - id\_deal\_multileg (i8) - Deal ID number for multileg deals.
  - moment (t) - Time when the deal was made.
  - moment\_ns (u8) - Time when the deal was made, nanoseconds since Unix epoch, UTC
  - code\_buy (c7) - Buyer's code.
  - code\_sell (c7) - Seller's code.
  - penalty\_buy (d26.2) - Penalty of the buyer's deal.
  - penalty\_sell (d26.2) - Penalty of the seller's deal.



- New field was added into 'part' table in FORTS\_PART\_REPL stream:
  - penalty (d26.2) - Penalty for settlement trades made into during the procedure of forced closing of positions of the Defaulting Clearing Member.
- New field was added into 'part\_sa' table in FORTS\_PART\_REPL stream:
  - blocked\_tax (d26.2) – Assets blocked for tax payments.
- The 'd\_start' field was deleted from 'fut\_sess\_contents', 'fut\_instruments' and 'opt\_sess\_contents' tables in FORTS\_REFDATA\_REPL stream.
- New field was added into 'prohibition' table FORTS\_REFDATA\_REPL stream:
  - xprohibition\_id (i8) - Number of prohibition.
- In FORTS\_REFDATA\_REPL stream, starting with version 6.9, the 'prohib\_id' field in the 'prohibition' table is deprecated and will be removed in version 6.15.
- In FORTS\_REFDATA\_REPL stream, starting with version 6.9, the 'usd\_online' table is deprecated and will be removed in version 6.15. Use the 'curr\_online' table of MOEX\_RATES\_REPL stream instead.
- New field was added into 'money\_clearing\_sa' table in FORTS\_CLR\_REPL stream:
  - blocked\_tax (d26.2) – Assets blocked for tax payments.

## 7. Changes applied to command scheme repository

- The 'local\_stamp' field was deleted from the following commands: AddOrder, MoveOrder, DelOrder, DelUserOrders, IcebergAddOrder, IcebergMoveOrder and IcebergDelOrder.
- New types of commands were added: AddOrder (msgid=465), MoveOrder (msgid=460), DelOrder (msgid=461), DelUserOrders (msgid=466), IcebergAddOrder (msgid=462), IcebergMoveOrder (msgid=463) and IcebergDelOrder (msgid=464).
- The deprecated command 'FutTransferRisk.' was removed.

## 8. Changes applied to reports

- New pay types were added to 'Type' field in 'f04', 'f04cl', 'o04', 'o04cl', 'fut\_deal', 'opt\_deal' reports:
  - Futures trades reports 'f04', 'f04cl', 'fut\_deal':
    - «21» – Closing Derivatives contracts entered into under the cross-default procedure
    - «22» – Closing Derivatives Contracts entered into upon non-fulfillment of the Margin Call
    - «23» – Closing Derivatives contracts entered into in into upon non-fulfillment of the Delivery Obligation on the deliverable Derivatives contracts for precious metals
    - «3» - – Balancing Derivatives contracts entered into with the Non-defaulting Clearing Member without submitting orders
  - Reports on concluded option contracts 'o04', 'o04cl', 'opt\_deal':
    - «6» – Closing Derivatives contracts entered into under the cross-default procedure
    - «7» – Closing Derivatives Contracts entered into upon non-fulfillment of the Margin Call
    - «3» - Balancing Derivatives contracts entered into with the Non-defaulting Clearing Member without submitting orders
- The 'payXXYY.csv' and 'payclXXYY.csv' reports take into account penalties in the state of the current money position.

- In 'monXXYY.csv/mon\_newXXYY.csv' reports for SA of the Clearing Members – non-residents the value of the blocked tax ('blocked\_tax') is accounted for in the 'go' field.
- In the 'daymonXXYY.csv' report for SA of the Clearing Members – non-residents the value of the blocked tax ('blocked\_tax') is accounted for in the 'gol2' field.

## 9. Changes applied to FAST

- The separate streams for futures and options are decommissioned, please switch to the united ones. Instead of FUT-BOOK-1, FUT-BOOK-5, FUT-BOOK-20, FUT-BOOK-50, OPT-BOOK-1, OPT-BOOK-5, OPT-BOOK-20, OPT-BOOK-50, FUT-TRADES, OPT-TRADES, IQS-FUT-BOOK-1, IQS-FUT-BOOK-50, IQS-OPT-BOOK-1, IQS-OPT-BOOK-50, IQS-FUT-TRADES, IQS-OPT-TRADES please use FO-TRADES, FO-BOOK-1, FO-BOOK-5, FO-BOOK-20, FO-BOOK-50, IQS-TRADES, IQS-BOOK-1, IQS-BOOK-50 Both are available in production and test environments.
- 'MDFeedTypes' field of the 'SecurityDefinition (d)' message is extended with the united streams, while the separate ones are removed.
- In FUT-INFO, OPT-INFO, IQS-FUT-INFO, IQS-OPT-INFO streams in 'SecurityDefinition (d)' messages, the 'MarketSegmentID' field value was replaced with 'D'.
- In FO-TRADES, FO-BOOK-1, FO-BOOK-5, FO-BOOK-20, FO-BOOK-50, IQS-TRADES, IQS-BOOK-1, IQS-BOOK-50 streams in 'Trading Session Status (h)' messages, the 'MarketSegmentID' field value was replaced with 'D'.
- In the FUT-INFO, OPT-INFO, IQS-FUT-INFO, IQS-OPT-INFO streams xml configuration the 'marketID' attribute is changing to 'D'.
- The group of fields with 'EventType'=5 (Instrument trading start date) is no longer broadcast in the 'SecurityDefinition (d)' message for futures, calendar spreads and options
- New values of the 'Flags' (tag 20008) field of the 'SecurityDefinition (d)' message were added.

## 10. Changes applied to FIX

- Technical information like '\$XX\$' is no longer broadcast in the first four characters of the 'SecondaryClOrdID' field in the FIX gateway and in the FIX Drop Copy service. Now the user's comment specified when adding an order is broadcast without changes in the FIX protocol. Previously, if the client overflowed the allowed size of this field, the value was truncated. But now the client receives a Reject with information about the incorrect value of the 'SecondaryClOrdID' field.
- The 'Flags' (tag 20008) field is now broadcast in the 'Execution Report' message for trades in the FIX gateway and in the all 'Execution Report' messages in the FIX Drop Copy service.