

Список изменений в версии 6.15 от 26.10.2021

1. Закрытие неавторизованного доступа - включение отчетов 07 в ИСС

Начиная с версии 6.15 вся информация из отчетов f07, o07 будет включена в Итоги по срочному рынку (ИСС). По истечении периода параллельной эксплуатации (3 месяца) отчеты f07, o07 перестанут выкладываться на ftp. Поэтому всем клиентам, которые получают эти отчеты через ftp, рекомендуется оформить подписку на информационные сервисы Московской Биржи, предоставляемые через WEB (ИСС).

С условиями оформления подписки можно ознакомиться на сайте Московской Биржи по адресу: <http://moex.com/ru/orders>.

2. Унификация клирингового сбора за исполнение контракта

В целях унификации клирингового сбора за исполнение фьючерсных и опционных контрактов с другими видами сборов на Срочном рынке, в ТС Спектра версии 6.15 реализована замена фиксированной ставки сбора за исполнение на ее процентное значение. Такой подход позволяет реализовать более гибкое управление сбором и учет в нем различных рыночных факторов.

Процентное значение ставки сбора за исполнение устанавливается НКЦ и задается на уровне базового контракта (принадлежность к соответствующей тарифной группе). Ставка сбора в рублях рассчитывается для каждого фьючерсного или опционного контракта по следующей формуле

для фьючерсов:

$$\text{ExpFutFee} = \text{Round}(\text{Round}(\text{abs}(\text{FutPrice}) \times \text{Round}(\text{W}(f)/\text{R}(f); 5); 2) \times \text{ExpFutFee}\%; 2),$$

где

- FutPrice - расчетная цена в вечерний клиринг, предшествующий дню исполнения;
- ExpFutFee% - ставка клирингового сбора за исполнение в процентах, определяется тарифной группой, к которой привязан инструмент;
- W(f) - стоимость шага цены на вечерний клиринг, предшествующий дню исполнения;
- R(f) - шаг цены;

для опционов на фьючерсы:

$\text{ExpOptFutFee} = \text{Round}(\text{Round}(\text{abs}(\text{Strike}) \times \text{Round}(\text{W}(\text{o})/\text{R}(\text{o}); 5); 2) \times \text{ExpOptFutFee}\%; 2)$, где

- Strike - страйк опциона;
- ExpOptFutFee% - ставка клирингового сбора за исполнение опциона в процентах, определяется тарифной группой, к которой привязан инструмент;
- W(o) - стоимость шага цены на вечерний клиринг предшествующий дню исполнения;
- R(o) - шаг цены.

Ставка сбора за исполнение в рублях рассчитывается в вечерний клиринг и действует на весь следующий торговый день, до начала следующей торговой сессии, что позволяет участникам точно прогнозировать стоимость исполнения контрактов. Рассчитанная ставка сбора отображается на сайте Биржи в карточке инструмента и транслируется в шлюзе в поле exp_clearing_fee в таблицах futures_rate и option_rate потока FORTS_FEERATE_REPL.

3. Отмена переводов средств между брокерскими фирмами через терминал

Начиная с версии 6.15 в терминале срочного рынка (MoexSpectraTerminal) и в шлюзе (транзакция ExchangeBFMoney) запрещен перевод денежных средств между БФ, принадлежащих разным расчетным кодам. Перевод между БФ одного РК по-прежнему доступен.

4. Расчетный период и период экспирации для процентных фьючерсов (доработка процентных деривативов)

Для процентных фьючерсов (месячные процентные фьючерсы на индексы RUONIA, рублевый RUSFAR, долларовый RUSFAR, на ставку MosPrime.) вводится понятие расчетного периода. В результате доработки появляется возможность для процентных фьючерсов отдельно выделить следующие параметры:

- **дата экспирации;**
- **торговый период** - период времени с даты первого до последнего торгового дня, в который может быть заключена сделка покупки/продажи контракта;
- **расчетный период** - период времени, который определяет дни, за которые берется значение ставки для определения Расчетной цены контракта в день исполнения.

Проведенная доработка позволяет для процентных фьючерсов корректно обрабатывать ситуацию переноса дня исполнения контракта, приходящегося на выходные и праздничные дни, и исключить неявное влияние праздничных и выходных дней на цену исполнения контракта.

5. Учет жизненного цикла торговых сессий в сервисе расчета вариационной маржи

Произведена доработка сервиса расчета и публикации индикативной вариационной маржи, теперь расчет и публикация данных учитывает жизненный цикл торговой сессии. В период проведения промежуточного и основного клиринга вариационная маржа не рассчитывается и не публикуется в шлюзе, что позволяет избежать "пляски" значения VM в период проведения клиринга.

6. Нотификация клиентов об использовании устаревших интерфейсов

В версии 6.15 в ТС Спектра реализован механизм нотификация клиентов об использовании устаревших команд, таблиц и полей в схемах. Информация об устаревших полях и транзакциях содержится в deprecated_SPECTRA.ini. Библиотека CGate получает схему deprecated_SPECTRA.ini при первом открытии соединения. Lsn repl после открытия проверяет, что имя потока, таблицы и поля в таблицах не входят в [deprecated:streams] в deprecated_SPECTRA.ini, в случае вхождения, пишет ошибки в лог. Pub mq после открытия проверяет, что id сообщений не входят в [deprecated::transactions] в deprecated_SPECTRA.ini. в случае вхождения, пишет ошибки в лог. Служба поддержки, при работе с обращениями, будет обращать внимание на эти сообщения.

7. Изменения в терминале срочного рынка

- В соответствии с политикой декомиссии программного обеспечения начиная с версии 6.15 в системе SPECTRA прекращается поддержка возможности проброса риска между Валютным и Срочным рынками. В терминале удалены инструменты переноса риска, соответствующие тип инструмента и режим торгов.
- По решению НКЦ с 01.11.2021 запрещен вывод денежных средств с использованием торгового терминала. У участников сохранится возможность вывода средств через web-клиринг и клиринговый терминал. Из терминала удален режим вывода средств 'Администрирование/ Поручения на ввод/вывод денежных средств'.
- В окна 'Финансовые инструменты' и 'Информация' добавлен новый параметр 'Сбор за исполнение' - ставка клирингового сбора за исполнение контракта.

8. Доработка утилиты для смены пароля (change_password.exe)

В ТС Спектра версии 6.15 произведены доработки утилиты для смены пароля (change_password.exe):

- В строку запуска добавлен параметр `app_name` (имя приложения).
- В строку запуска добавлен параметр `local_pass` (пароль для локального соединения с роутером).
- Из возможных ключей строки запуска удален ключ `key`.

9. Изменения в пользовательском шлюзовом интерфейсе CGate

- Добавлен новый поток `FORTS_PROHIBITION_REPL`. В потоке транслируется одна единственная таблица `prohibition`, аналогичная такой же таблице в потоке `FORTS_REFDATA_REPL`. В течение двух релизов предполагается параллельное использование этих таблиц, в дальнейшем (версия 7.3) таблица `prohibition` из потока `FORTS_REFDATA_REPL` будет удалена.
- В потоке `FORTS_INFO_REPL` в таблице `currency_params` начиная с версии 6.15 поле `signs` объявляется устаревшим и будет удалено в версии 7.3.
- В потоке `FORTS_REFDATA_REPL` таблица `prohibition` начиная с версии 6.15 объявляется устаревшей и будет удалена в версии 7.3. Вместо этой таблицы надо использовать таблицу `prohibition` потока `FORTS_PROHIBITION_REPL`.

Version 6.15 Changes and Updates of 26.10.2021

1. Closing unauthorized access - including reports 07 into ISS

From version 6.15 all information from reports f07, o07 will be included in the data on the derivatives market provided through ISS. After the period of parallel expires (3 months), reports f07, o07 will no longer be uploaded to ftp. Therefore, all clients who receive these reports via ftp are advised to subscribe to the information services of the Moscow Exchange, provided through the WEB (ISS).

The subscription terms can be found on the Moscow Exchange website at:
<http://moex.com/ru/orders>.

2. Unification of the clearing fee for contract exercising

To unify the clearing fee for the exercising of futures and options contracts with other types of fees in the Derivatives Market, in the TS Spectra version 6.15, the fixed rate of fee for the exercising was replaced with its percentage. This approach allows for more flexible manage of fee and take into account various market factors.

The percentage value of the exercising fee rate is set by the NCC and is set at the level of the underlying contract (belonging to the corresponding tariff group). The fee rate in rubles is calculated for each futures or options contract using the following formula

for futures:

ExpFutFee = Round(Round(abs(FutPrice) x Round(W(f)/R(f); 5); 2) x ExpFutFee%; 2),
where

- FutPrice - settlement price in the evening clearing previous to the exercise day;
- ExpFutFee% - the rate of the clearing fee for exercising in percentage, determined by the tariff group to which the instrument is linked;
- W(f) - cost of step price in the evening clearing previous to the exercise day;
- R(f) - step price;

for options on futures:

ExpOptFutFee = Round(Round(abs(Strike) x Round(W(o)/R(o); 5); 2) x
ExpOptFutFee%; 2), where

- Strike - option strike;

- ExpOptFutFee% - the rate of the clearing fee for exercising of an option in percentage, determined by the tariff group to which the instrument is linked;
- W(o) - cost of step price in the evening clearing previous to the exercise day;
- R(o) - step price.

The rate of the execution commission in rubles is calculated at evening clearing and is valid throughout the next trading day until the start of the next trading session, which allows participants to accurately predict the cost of contract execution. The calculated fee rate is displayed on the MOEX website in the instrument card and is broadcast in the gateway in the 'exp_clearing_fee' field in the 'futures_rate' and 'option_rate' tables of the FORTS_FEERATE_REPL stream.

3. Cancellation of funds transfers between brokerage firms via the terminal

Starting from version 6.15, the transfer of funds between BFs belonging to different Settlement Accounts prohibited in the derivatives market terminal (MoexSpectraTerminal) and in the gateway (ExchangeBFMoney transaction). Transfer between BFs of the same SA is still available.

4. Settlement period and expiration period for interest rate futures (revision of interest rate derivatives)

The concept of a settlement period is introduced for interest rate futures (monthly interest rate futures for RUONIA indices, ruble RUSFAR, dollar RUSFAR, MosPrime rate). As a result, it becomes possible for interest rate futures to separately highlight the following parameters:

- **expiration date;**
- **trading period** - the period of time from the date of the first to the last trading day in which a contract buy / sell trade can be made;
- **settlement period** - a period of time that defines the days for which the rate value is taken to determine the Settlement Price of the contract on the day of exercising.

This revision allows for interest rate futures to correctly process the situation of transferring the day of contract exercising, which falls on weekends and holidays, and to exclude the implicit influence of holidays and weekends on the contract exercising price.

5. Accounting for the life cycle of trading sessions in the service for calculating the variation margin

The service for calculating and publishing the indicative variation margin was changed, now the calculation and publication of data takes into account the life cycle of a trading session. During the intermediate and main clearing, the variation margin is not calculated and is not published in the gateway, which allows avoiding the changing of the VM value during the clearing period.

6. Notifying clients about using deprecated interfaces

In TS Spectra version 6.15, a mechanism for notifying clients about the use of deprecated commands, tables and fields in schemas was implemented. Information about deprecated fields and transactions is contained in the 'deprecated_SPECTRA.ini' schema. The CGate library gets the 'deprecated_SPECTRA.ini' schema the first time a connection is opened. After opening, 'Lsn repl' checks that the name of the stream, tables and fields in the tables are not included in [deprecated: streams] in 'deprecated_SPECTRA.ini', otherwise it writes errors to the log. After opening, 'Pub mq' checks that messages IDs are not included in [deprecated::transactions] in 'deprecated_SPECTRA.ini', otherwise it writes errors to the log. The support service will pay attention to these messages, when working with requests.

7. Changes applied to Moex Spectra Terminal

- In accordance with the software decommissioning policy, starting from version 6.12 in the SPECTRA system, the risk balancing between the Derivatives Market and FX Market will no longer be supported.
- By the decision of NCC, the withdrawal of funds using the trading terminal is prohibited. The trading participants will still be able to withdraw funds via web-clearing and the clearing terminal. 'Management/ Requests to deposit/withdraw funds' mode was removed from the terminal.
- New parameter 'Exercise fee' was added to 'Financial instruments' and 'Information' windows.

8. Password change utility was improved (change_password.exe)

In TS Spectra version 6.15, the utility for changing the password (change_password.exe) was improved:

- new parameter 'app_name' (application name) was added to run;
- new parameter 'local_pass' (password for the local connection to the router) was added to run;
- the parameter 'key' was deleted from command to run.

9. Changes applied to user interface of CGate gateway

- New stream FORTS_PROHIBITION_REPL. The stream broadcasts the 'prohibition' table only, which is the same as in the FORTS_REFDATA_REPL stream. During two releases, these tables are supposed to be used in parallel, in the version 7.3 the 'prohibition' table will be removed from the FORTS_REFDATA_REPL stream.
- Since version 6.15, in the FORTS_INFO_REPL stream in the 'currency_params' table, the 'signs' field is deprecated and will be removed in version 7.3.
- Since version 6.15, in the FORTS_REFDATA_REPL stream, the 'prohibition' table is deprecated and will be removed in version 7.3. Please, use the 'prohibition' table of FORTS_PROHIBITION_REPL stream.