

Список изменений в версии 6.18 от 04.04.2022

1. Однодневные фьючерсы с автопродолжением

В версии 6.18 в ТС Спектра реализован новый тип инструментов Срочного рынка - однодневные фьючерсные контракты с автопродолжением на курс иностранной валюты к российскому рублю. Близкими аналогами таких контрактов на рынке могут служить CFD (Contract For Difference) или NDF (Non-Deliverable Forward).

Базисными активами однодневных фьючерсов являются курсы иностранных валют по отношению к российскому рублю.

На первом этапе планируется запустить 3 контракта: USDRUBF, EURRUBF, CNYRUBF на USD, EUR, CNY, соответственно.

Основные особенности новых инструментов:

- У однодневного фьючерса нет даты исполнения ("вечный" фьючерс). Технически же последняя дата торгов будет установлена далеко в будущем.
- Расчетные цены будут формироваться на основании рыночных данных с Валютного рынка Московской биржи.
- Вариационная маржа вечернего клиринга определяется с учётом новой составляющей: ставка за перенос позиции в следующую сессию (SwapRate).

Формулы и детальное описание можно найти в спецификациях контрактов.

Индикативная вариационная маржа для однодневных фьючерсов в версии Спектра 6.18 будет рассчитываться и публиковаться без учета SwapRate.

В справочнике торгуемых инструментов однодневные фьючерсы помечаются специальным признаком (бит 0x4000 в поле signs таблицы fut_sess_contents потока FORTS_REFDATA_REPL).

2. Изменения в интерфейсах и API

2.1. CGate

- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблице fut_sess_contents для поля signs появился новый бит:

- 0x4000 - Однодневный фьючерсный контракт с автопродлонгацией.
- В потоке FORTS_CLR_REPL в таблицу fut_sess_settl добавлено поле:
 - swap_rate (d16.5) - Ставка за перенос позиции по "вечному" фьючерсу в следующую торговую сессию.

2.2. FAST

- Добавлен новый CFI код для фьючерсов: 'JFTXCC' - Однодневный фьючерсный контракт с автопродлонгацией (CFD - Contract for difference, Cash Settled).
- В сообщениях Market Data - Snapshot / Full Refresh (W) и Market Data - Incremental Refresh (X) для поля MDEntryType появилось новое значение: 'u' - Swap rate - ставка за перенос позиции по 'вечному' фьючерсу в следующую торговую сессию. Транслируется в потоке FO-TRADES.

Шаблоны FAST остаются текущими. Смена шаблона состоится с релизом SPECTRA 7.0 в мае 2022 года.

2.3. SIMBA

- Добавлен новый CFI код для фьючерсов: 'JFTXCC' - Однодневный фьючерсный контракт с автопродлонгацией (CFD - Contract for difference, Cash Settled).

3. Изменения в отчетах

В отчете f07.csv добавлено поле SWAP_RATE - ставка за перенос позиции в следующую сессию. Для обычных фьючерсов заполняется нулевым значением.

Version 6.18 Changes and Updates from 04.04.2022

1. Daily futures contract with automatic prolongation

In version 6.18 TS Spectra, a new type of Derivatives Market instruments - daily futures contract with automatic prolongation at the foreign exchange to Russian ruble rate. CFD (Contract For Difference), as well as NDF (Non-Deliverable Forward) may be as an analogue of such contracts on the market.

The underlying asset of daily futures is the corresponding foreign currencies to the Russian ruble exchange rates.

At the first stage, it is planned to launch three contracts: USDRUBF, EURRUBF, CNYRUBF on USD, EUR, CNY, accordingly.

The main features of the new instruments:

- Daily futures have no exercise date. Technically, the last trading date will be set far in the future.
- Settlement prices will be formed on the basis of market data from the Foreign Exchange Market of the Moscow Exchange.
- The variation margin of the evening clearing is determined taking into account a new component: the rate for transferring a position to the next session (SwapRate).

Formulas and detailed description can be found in contract specifications.

In Spectra 6.18 version, indicative variation margin for daily futures will be calculated and published excluding SwapRate for now.

In the directory of trade instruments, daily futures are marked with a special sign: bit 0x4000 (CFD) in 'signs' field of 'fut_sess_contents' table of FORTS_REFDATA_REPL stream.

2. Changes to interfaces and API

2.1. CGate

- A new bit in FORTS_REFDATA_REPL stream in 'fut_sess_contents' table for 'signs' field:

- 0x4000 - Daily futures contract with automatic prolongation (CFD - Contract for difference)
- A new field in FORTS_CLR_REPL stream in 'fut_sess_settl' table:
 - swap_rate (d16.5) - Rate for transferring a position on a CFD futures to the next trading session.

2.2. FAST

- In SecurityDefinition message, new CFI Code for Futures in Moscow Exchange: 'JFTXCC' - Daily futures contract with automatic prolongation (CFD - Contract for difference, Cash Settled)
- In 'Market Data - Snapshot / Full Refresh (W)' and 'Market Data - Incremental Refresh (X)' messages, new value for 'MDEntryType' field: 'u' - Swap rate - rate for transferring a position on a CFD futures to the next trading session.

FAST templates remain unchanged. The template change will take place with the release of SPECTRA 7.0 in May 2022.

2.3. SIMBA

- In SecurityDefinition message, new CFI Code for Futures in Moscow Exchange: 'JFTXCC' - Daily futures contract with automatic prolongation (CFD - Contract for difference, Cash Settled)

3. Changes to reports

- New field in the 'f07' report: SWAP_RATE- rate for transferring a position on a CFD futures to the next trading session. For common futures, it is filled with a zero value.