

Список изменений в версии 7.3

1. Прекращение обязательств по вечному фьючерсу

В версии 7.3 реализована возможность принудительного прекращения обязательств по вечным фьючерсам (ВФ). Прекращение обязательств по вечным фьючерсам может осуществляться по требованию одной из сторон путем подачи поручений на исполнение. Вечный фьючерс исполняется в ближайший по сроку исполнения обычный фьючерс на тот же самый спот-актив. Поручения на исполнение вечного фьючерса могут подаваться в предпоследний день обращения фьючерса, в который исполняется ВФ. Подача поручений производится с помощью шлюзовой команды FuturesExecutionRequest или через торговый терминал Срочного рынка. Поданные в торговую систему поручения транслируются в шлюзе в таблице fut_exec_orders потока FORTS_REFDATA_REPL и отображаются в торговом терминале Срочного рынка.

В вечернюю клиринговую сессию предпоследнего дня обращения фьючерса, в который исполняется ВФ, производится исполнение, которое состоит из сведения встречных поручений на исполнение и, в случае наличия неудовлетворенных поручений на исполнение и открытых позиций с противоположной направленностью на рынке, процедуры их принудительного удовлетворения. При исполнении позиция по вечному фьючерсу превращается в позицию по обычному фьючерсу, что технически оформляется сделкой закрытия позиции в вечном фьючерсе и сделкой открытия позиции в обычном фьючерсе, которые в таблице сделок помечаются специальными признаками в полях xstatus_sell и xstatus_buy.

Уважаемые Участники торгов, при желании принять участие в тестировании механизма прекращения обязательств по вечному фьючерсу просьба подать заявку на help@moex.com.

2. Доработка системы запретов. Новые клиентские приоритеты

В версии 7.3 произведена доработка системы запретов. Теперь система предоставляет возможность выставлять запреты с указанным пользователем приоритетом, причем, этот приоритет будет выше чем те, что устанавливаются системой автоматически (приоритет с 1 по 9). Такая возможность позволяет более гибко настраивать сценарии конфигурации запретов.

Для выставления запретов с пользовательским приоритетом в команды FutChangeClientProhibit и OptChangeClientProhibit добавлено поле client_priority (i4), которое принимает значение 10, 11 или 12 (низкий, средний, высокий). Если в команде в поле client_priority указано значение 10, 11 или 12, то выставляется запрет с указанным пользовательским приоритетом. Если пользовательский приоритет не указан, то приоритет будет установлен автоматически, в соответствии с параметрами запрета. Выставление запретов с пользовательским приоритетом доступно и в торговом терминале Срочного рынка.

3. Изменения в интерфейсах и API

3.1. CGATE

- В потоке FORTS_FEE_REPL в таблицу adjusted_fee добавлены поля:
 - adjusted_fee_trade_buy (d26.2) - Биржевой сбор по сделке покупателя.
 - adjusted_fee_clearing_buy (d26.2) - Клиринговый сбор по сделке покупателя.
 - adjusted_fee_trade_sell (d26.2) - Биржевой сбор по сделке продавца.
 - adjusted_fee_clearing_sell (d26.2) - Клиринговый сбор по сделке продавца.
- В поток FORTS_PROHIBITION_REPL добавлена таблица событий sys_events.
- В поток FORTS_REFDATA_REPL добавлена таблица fut_exec_orders - Поручения на исполнение однодневных фьючерсов с автопродлонгацией:
 - replID (i8) - Службное поле подсистемы репликации.
 - replRev (i8) - Службное поле подсистемы репликации.
 - replAct (i8) - Службное поле подсистемы репликации.
 - exec_order_id (i8) - Идентификатор поручения на исполнение.
 - client_code (c7) - Код клиента.
 - isin_id (i4) - Уникальный числовой идентификатор инструмента.
 - хamount (i8) - Количество контрактов, подлежащих исполнению.
 - sess_id (i4) - Идентификатор торговой сессии.
 - хamount_apply (i8) - Количество в поручениях на момент промежуточного клиринга.
 - date (t) - Дата и время подачи/изменения поручения.
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL начиная с версии 7.3 поле is_percent из таблиц fut_sess_contents и fut_instruments объявляется устаревшим и будет удалено в версии 7.9. Вместо него следует использовать поле asset_class из таблицы fut_vcb.
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL начиная с версии 7.3 поля d_exec_beg и d_exec_end в таблице opt_sess_contents объявляются устаревшим и будут удалены в версии 7.9. Вместо них следует использовать поле expiration_date из таблицы option_series.
- В потоке FORTS_INFO_REPL из таблицы currency_params удалено поле signs.
- В потоке FORTS_INFO_REPL начиная с версии 7.3 поле is_percent в таблице base_contracts_params объявляется устаревшим и будет удалено в версии 7.9. Вместо него следует использовать поле asset_class.
- В команды FutChangeClientProhibit и OptChangeClientProhibit добавлено поле client_priority (i4). Добавлены новые типы команд FutChangeClientProhibit (msgid=469) и OptChangeClientProhibit (msgid=468).
- Добавлена новая команда FuturesExecutionRequest (msgid=470) - Поручения на исполнение однодневных фьючерсов с автопродлонгацией:
 - broker_code (c4) - Код брокерской фирмы.
 - mode (i4) - Режим работы команды.
 - order_id (i8) - Номер поручения на исполнение.
 - code (c3) - Последние 3 символа клиентского кода.
 - isin (c25) - Код фьючерса.
 - amount (i8) - Количество контрактов к исполнению.
- В команде OptChangeExpiration тип поля order_id изменен на i8. Добавлен новый тип команды OptChangeExpiration (msgid=471).
- Добавлены новые флаги, которые проставляются в полях xstatus_sell и xstatus_buy сделок, сформированных вследствие выхода из вечного фьючерса:

- ePerpetualFuturesExecutionVoluntary (0x10000000000000) - Техническая сделка вследствие добровольного выхода из вечного фьючерса (на основании поданного поручения).
 - ePerpetualFuturesExecutionForced (0x40000000000000) - Техническая сделка вследствие принудительного выхода из вечного фьючерса (реализация неудовлетворённого спроса).
 - ePerpetualFuturesExecution (0x80000000000000) - Техническая сделка в связанном инструменте вследствие выхода из вечного фьючерса.
- Начиная с версии 7.9, не используемые в настоящее время биты, отвечающие за признаки заявок и сделок в статусных масках, будут переопределены по мере необходимости:
 - - eREPOCCStatus - 0x2000
 - eSpotTransferStatus - 0x8000
 - eFairPlayStatus - 0x10000
 - eREPOStatus - 0x20000
 - eInternalHalfTrade - 0x80000000
 - eIqsOrder - 0x800000000

3.2 FAST

- В сообщениях Market Data - Snapshot / Full Refresh (W) и Market Data Incremental Refresh (X) для поля TrdType появилось новое значение:
 - '1004' - выход из однодневного фьючерса с автопродлонгацией.
- Для технических сделок в поле MDFlags добавлена трансляция новых флагов
 - 0x10000000000000 - Сделка вследствие добровольного выхода из однодневного фьючерса с автопродлонгацией (на основании поданного поручения)
 - 0x40000000000000 - Сделка вследствие принудительного выхода из однодневного фьючерса с автопродлонгацией (реализация неудовлетворённого спроса)
 - 0x80000000000000 - Сделка в связанном инструменте вследствие выхода из однодневного фьючерса с автопродлонгацией

3.3. API SpectraIM

Детали описаны в разделе "История изменений" документа http://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/SpectraIM/Test/doc/SpectraIM_API.pdf

4. Изменения в отчетах

- В отчеты: mmfutXXYY, mmopt_strikesXXYY, STATMM_FUT, STATMM_OPT добавлено поле:
 - actual_mm_orders_percent d (5,2) - Доля пассивного объема ММ заявок (регуляторное требование), %
- В отчете clients увеличена размерность поля name до char 200.
- В отчеты f04, f04cl, o04, o04cl, multilegf04, multilegf04cl:
 - вместо поля TYPE добавлены два поля: TYPE_BUY numeric(2) и TYPE_SELL numeric(2)
 - вместо поля SIGNS добавлены два поля: SIGNS_BUY numeric(20) и SIGNS_SELL numeric(20)
- В отчетах f04, f04cl три новых типа сделок:
 - 24 - возникла в результате добровольного исполнения вечного фьючерса (для сделок по вечного фьючерса)
 - 25 - возникла в результате принудительного исполнения вечного фьючерса (для сделок по вечного фьючерса)
 - 26 - возникла в результате исполнения ВФ (для сделок по связанному с вечным фьючерсом инструменту)

5. Изменения в терминале Срочного рынка

- В системе запретов появились новые пользовательские приоритеты:
 - в окно 'Запреты на операции' добавлены новые значения для параметра 'Приоритет: Низкий(10), Средний(11) и Высокий(12);
 - в окна ввода нового запрета и новой группы запретов добавлен новый чек-бокс Пользовательский приоритет, который позволяет установить будет ли использоваться пользовательский приоритет и выбрать его тип: низкий, средний, высокий.
- В окна 'Информация', 'Финансовые инструменты', 'Свои заявки/ поручения', 'Все сделки/ поручения', 'Свои сделки/ поручения' добавлены дополнительные параметры:
 - Биржевой ид. - Биржевой идентификатор инструмента
 - Ид. сессия - Номер текущей сессии
- В окна 'Позиции/ поручения' и 'Позиции по расчетным кодам' добавлен дополнительный параметр:
 - Биржевой ид. - Биржевой идентификатор инструмента
- Для реализации механизма исполнения вечного фьючерса:
 - в окно 'Позиции/ поручения' добавлена новая команда в контекстное меню 'Исполнить фьючерс';
 - для подачи поручений на исполнение фьючерсного контракта разработано специальное окно исполнить фьючерс.
- В окна 'Финансовые инструменты' и 'Информация' добавлен новый параметр 'Размерность котировки' - коэффициент, указывающий на объем базового актива в котировке контракта и страйках опционной серии.

Version 7.3 Changes and Updates

1. Termination of obligations under daily futures contracts with auto-prolongation ('perpetual' futures)

In version 7.3, the possibility of forced termination of obligations on perpetual futures (EF) is implemented. Termination of obligations under perpetual futures can be carried out at the request of one of the side by submitting requests for exercise. A perpetual futures is exercised turning into the nearest standard future on the same spot asset. Requests for exercise of a perpetual futures can be submitted on the penultimate day of the futures circulation, on which the perpetual futures is exercised. The gateway command FuturesExecutionRequest or Moex Spectra Terminal are used for submit requests. Requests submitted to the trading system are transmitted in the gateway in the 'fut_exec_orders' table of the FORTS_REFDATA_REPL stream and displayed in the Moex Spectra Terminal.

The perpetual futures execution consists of matching counter requests for exercising and, in case of unsatisfied requests for exercise and open positions with the opposite direction in the market, the procedure for their forced matching. When exercising, a perpetual futures position becomes a common futures position. Technically, a position closing trade in a perpetual futures and a position opening trade in the nearest futures are formed, which are marked with special signs in the trades table in the 'xstatus_sell' and 'xstatus_buy' fields. The next day, all transferred positions of perpetual futures will be delivered according to standard rules.

Dear Trading Participants, if you wish to take part in testing the perpetual futures termination mechanism, please apply to help@moex.com.

2. Update of the prohibitions system. New custom priorities

In version 7.3, the prohibitions system was finalized. Now the system provides an opportunity to set prohibitions with the priority specified by the user, and this priority will be higher than those that are set by the system automatically (priority from 1 to 9). This feature allows to set prohibitions configuration scenarios more flexible.

To set prohibitions with custom priority, the 'client_priority' (i 4) field was added to the Foot Change Client Prohibit and OptChangeClientProhibit commands, which takes the value 10, 11 or 12 (low, medium, high). If the value 10, 11 or 12 is specified in the 'client_priority' field in the command, then a prohibition is set with the specified custom priority. If the custom priority is not specified, the priority will be set automatically, according to the prohibition parameters. Setting prohibitions with custom priority is also available in the Moex Spectra Terminal.

3. Changes to the user interface and API

3.1. CGATE

- In the FORTS_FEE_REPL stream, the following fields were added to the 'adjusted_fee' table:

- adjusted_fee_trade_buy (d26.2) - Exchange fee for the buyer's trade.
 - adjusted_fee_clearing_buy (d26.2) - Clearing fee for the buyer's trade.
 - adjusted_fee_trade_sell (d26.2) - Exchange fee for the seller's trade.
 - adjusted_fee_clearing_sell (d26.2) - Clearing fee for the seller's trade.
- In the FORTS_PROHIBITION_REPL stream, the 'sys_events' event table was added.
- In the FORTS_REFDATA_REPL stream, the 'fut_exec_orders' table was added - Requests to exercise daily futures contracts with auto-prolongation:
 - replID (i8) - Service field of the replication subsystem.
 - replRev (i8) - Service field of the replication subsystem.
 - replAct (i8) - Service field of the replication subsystem.
 - exec_order_id (i8) – Exercise request ID.
 - client_code (c7) – Client code.
 - isin_id (i4) - Unique numeric instrument ID.
 - xamount (i8) - Number of contracts to be exercised.
 - sess_id (i4) – Trade session ID.
 - xamount_apply (i8) - The quantity in the requests at the time of intraday clearing.
 - date (t) - Date and time of request adding/changing.
- In the FORTS_REFDATA_REPL stream, since version 7.3, the 'is_percent' field in 'fut_sess_contents' and 'fut_instruments' tables is deprecated and will be deleted in version 7.9. Instead, use the 'asset_class' field from the 'fut_vcb' table.
- In the FORTS_REFDATA_REPL stream, since version 7.3, the 'd_exec_beg' and 'd_exec_end' fields in 'opt_sess_contents' are deprecated and will be deleted in version 7.9. Instead, use the 'expiration_date' field from the 'option_series' table.
- In the FORTS_INFO_REPL stream, the 'signs' field was deleted from the 'currency_params' table.
- In the FORTS_INFO_REPL stream, since version 7.3, the 'is_percent' field in 'base_contracts_params' table is deprecated and will be deleted in version 7.9. Instead, use the 'asset_class' field.
- In the FutChangeClientProhibit and OptChangeClientProhibit commands, the 'client_priority (i4)' field was added. New command type were added: FutChangeClientProhibit (msgid=469) and OptChangeClientProhibit (msgid=468).
- The FuturesExecutionRequest (msgid=470) command was added- Requests to exercise daily futures contracts with auto-prolongation:
 - broker_code (c4) - The brokerage firm code.
 - mode (i4) - Operating mode of the command.
 - order_id (i8) - Exercise order number.
 - code (c3) - The last three characters of the client code.
 - isin (c25) – Futures code.
 - amount (i8) - Number of contracts to be exercised.
- In the OptChangeExpiration command the 'order_id' field type was changed to 'i8'. New command type was added - OptChangeExpiration (msgid=471).
- New flags were added, which are set in the 'xstatus_sell' and 'xstatus_buy' fields of the trades formed as a result of the exit from the perpetual futures:
 - ePerpetualFuturesExecutionVoluntary (0x10000000000000) - The technical trade as a result of exiting a daily futures contract with automatic prolongation (based on the submitted requests).

- ePerpetualFuturesExecutionForced (0x4000000000000000) - The technical trade as a result of forced exiting a daily futures contract with automatic prolongation (realization of unsatisfied demand).
- ePerpetualFuturesExecution (0x8000000000000000) - The technical trade with linked instrument as a result of exiting a daily futures contract with automatic prolongation.
- Since version 7.9, currently unused bits responsible for signs of orders and trades in status masks will be redefined as needed:
 - eREPOCCStatus - 0x2000
 - eSpotTransferStatus - 0x8000
 - eFairPlayStatus - 0x10000
 - eREPOStatus - 0x20000
 - eInternalHalfTrade - 0x80000000
 - eIqsOrder - 0x800000000

3.2 FAST

- In 'Market Data - Snapshot / Full Refresh (W)' and 'Market Data – Incremental Refresh (X)' messages, new value for 'TrdType' field:
 - '1004' - exiting a daily futures contract with automatic prolongation.
- New values of 'MDFlags' field for technical trades :
 - 0x1000000000000000 - The technical trade as a result of exiting a daily futures contract with automatic prolongation (based on the submitted requests)
 - 0x4000000000000000 - The technical trade as a result of forced exiting a daily futures contract with automatic prolongation (realization of unsatisfied demand)
 - 0x8000000000000000 - The technical trade with linked instrument as a result of exiting a daily futures contract with automatic prolongation

3.3. API SpectraIM.

Details in document

http://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/SpectraIM/Test/doc/SpectraIM_API.pdf

4. Changes in reports

- In mmfutXXYY, mmopt_strikesXXYY, STATMM_FUT, STATMM_OPT reports, new field was added:
 - actual_mm_orders_percent d (5,2) - Share of passive volume of MM orders (regulatory requirement), %
- In 'clients' report, the 'name' field dimension was increased to char 200
- In f04, f04cl, o04, o04cl, multilegf04, multilegf04cl reports:
 - two fields SIGNS_BUY numeric(20) and SIGNS_SELL numeric(20) were added instead of the SIGNS field
 - two fields TYPE_BUY numeric(2) and TYPE_SELL numeric(2) were added instead of the TYPE field
- In f04, f04cl reports, three new trade types:

- 24 - the technical trade as a result of exiting a perpetual futures (for trades on perpetual futures)
- 25 - the technical trade as a result of forced exiting a perpetual futures (for trades on perpetual futures)
- 26 - the technical trade with linked instrument concluded as a result of exiting a perpetual futures

5. Changes applied to Moex Spectra Terminal

- New custom priorities in prohibition system:
 - 'Prohibitions' window, new values were added for 'Priority' parameter: Low(10), Medium(11) and High(12);
 - 'New prohibition' and 'New group of prohibition's windows, new option was added 'Custom priority', which allows to set whether a custom priority will be used and select its type: low, medium, high.
- New fields were added to 'Information', 'Financial instruments', 'Your orders/ requests', 'All trades/ requests', 'Your trades/ requests' windows:
 - Exchange ID - Exchange identifier of the instrument
 - Session ID - Trading session number
- New field was added to 'Positions/ requests', 'Positions by settlement accounts' windows:
 - Exchange ID - Exchange identifier of the instrument
- For exercising of perpetual futures perpetual futures:
 - new command 'Exercise futures was added to 'Positions/ requests' window;
 - new window 'Exercise futures' for applying of requests for exercise of perpetual futures.
- New parameter was added to 'Information' and 'Financial instruments' windows: 'Lot coefficient' - a coefficient indicating the underlying asset volume in the contract quotation and option series strikes.