

# Список изменений в версии 7.12

## 1. Премияльные опционы на валюту (1 этап)

В версии 7.12 на Срочном рынке планируется запуск новых производных инструментов – европейских премиальных расчетных опционов на валюту. На первом этапе опционы на валюту будут запускаться на платформе и опционной модели (прайсинг, маржирование) существующих в системе опционов на акции (ОНА), ввода каких-либо дополнительных параметров не планируется. По аналогии с опционами на акции запускаемые опционы (опционные серии) привязываются к коллатеральному фьючерсному инструменту, базовым активом для коллатерального фьючерсного инструмента является валютный курс (`asset_class=2`). Таким образом, иерархическая структура инструментов не меняется.

Модель маржирования, алгоритм расчета кривой волатильности и формулы ценообразования для опционов на валюту полностью наследуются из модели реализованных в системе опционов на акции. Порядок расчета `NetOptionValue` также аналогичен расчету этого параметра для ОНА.

Поскольку запускаемые опционы на валюту являются европейскими и расчетными, исполняться будут только опционы, находящиеся "в деньгах", в автоматическом режиме, и заявки на исполнение/отказ от исполнения по таким опционам приниматься не будут. Для определения финансового результата исполнения опциона в день экспирации используется цена БА, вычисленная аналогично цене исполнения фьючерсов на данный БА. Детальное описание можно посмотреть в соответствующих спецификациях контрактов.

## 2. Изменения в интерфейсах и API

### 2.1. CGATE

- В потоке `FORTS_COMMON_REPL` в таблицу `sys_events` добавлено поле:
  - `event_type (i4)` - Тип синхрособытия
- В потоке `FORTS_COMMON_REPL` начиная с версии 7.12 поле `type` в таблице `sys_events` объявляется устаревшим и будет удалено в версии 7.18. Вместо него следует использовать поле `event_type`.
- В потоке `FORTS_REFDATA_REPL` из таблицы `opt_sess_contents` удалены устаревшие поля `d_exec_beg` и `d_exec_end`. Вместо них следует использовать поле `expiration_date` из таблицы `sess_option_series`.
- В потоке `FORTS_REFDATA_REPL` из таблицы `opt_sess_contents` удалено устаревшее поле `step_price`. Вместо него следует использовать поле `step_price` из таблицы `sess_option_series`.
- В потоке `FORTS_REFDATA_REPL` начиная с версии 7.12 поле `opt_sess_id` в таблице `session` объявляется устаревшим и будет удалено в версии 7.18. Вместо него следует использовать поле `sess_id`.
- В потоке `FORTS_REFDATA_REPL` в таблицу `sess_option_series` добавлены поля:
  - `step_price_clr (d16.5)` - Стоимость шага цены вечернего клиринга.
  - `step_price_interclr (d16.5)` - Стоимость шага цены промежуточного клиринга.
- В потоке `FORTS_CLR_REPL` из таблиц `fut_pos`, `opt_pos`, `fut_pos_sa` и `opt_pos_sa` удалены поля `vat_ex` и `vat_cc`.
- В потоке `RTS_INDEX_REPL` начиная с версии 7.12 поле `value` в таблице `rts_index` объявляется устаревшим и будет удалено в версии 7.18. Вместо него следует использовать поле `value_highprec`.

### 2.2 SIMBA SPECTRA

- В сообщениях `SecurityDefinition (msg id=12)` и `SecurityStatus (msg id=9)` в поле `SecurityTradingStatus` добавлена трансляция нового значения:
  - '20' - Неизвестное состояние торгов по инструменту.
  - '122' - Сессия по инструменту приостановлена. Нельзя ставить заявки, но можно удалять по этому инструменту.

- В сообщениях SecurityDefinition (msg id=12) и SecurityStatus (msg id=9) в поле SecurityTradingStatus изменено описание для значения '2' - Приостановка торгов по всем инструментам. Нельзя ставить заявки, но можно удалять.
- В сообщении SecurityDefinition (msg id=12):
  - Для поля NoEvents изменились допустимые значения:
    - '1' - для фьючерсов.
    - '2' - для опционов.
  - Прекращена трансляция полей с EventType=5 (Дата ввода инструмента в обращение) и EventType=100 (Дата начала экспирации инструмента).
  - Для поля CFICode добавлены новые значения:
    - 'OCECCS' - европейский расчетный опцион Call на валюту
    - 'OPECCS' - европейский расчетный опцион Put на валюту

### 2.3 FAST

- В сообщениях Security Definition (d) и Security Status (f) для атрибута SecurityTradingStatus:
  - '122' - новое значение - Сессия по инструменту приостановлена. Нельзя ставить заявки, но можно удалять по этому инструменту.
  - для значения '2' изменено описание - Приостановка торгов по всем инструментам. Нельзя ставить заявки, но можно удалять.
- В сообщении SecurityDefinition (d):
  - для атрибута EventType больше не транслируется значение '100' - Дата начала экспирации инструмента
  - для атрибута NoEvents изменились допустимые значения:
    - '1' - для фьючерсов.
    - '2' - для опционов.
  - добавлены новые CFI коды для опционов на валюту:
    - 'OCECCS' - европейский расчетный опцион Call на валюту
    - 'OPECCS' - европейский расчетный опцион Put на валюту

### 3. Изменения в репозитории схем подачи команд

Медленные версии команды ChangeClientMoney (версии команд с ID in = 4, 60, 63, 67, 409, 425 / Reply ID out = 104 ) начиная с версии 7.12 объявляются устаревшими и будут удалены в версии 7.18. Используйте более быструю версию команды ChangeClientMoney с ID in = 458 / Reply ID out = 187.

### 4. Изменения в отчетах

В заголовке отчета multilegf04cl\_XXY.csv удален лишний пробел (между NCC\_REQUEST\_BUY и NCC\_REQUEST\_SELL).

### 5. Изменения в терминале Срочного рынка

- В окне 'Финансовые инструменты' добавлен новый параметр 'Тип контракта' - Тип базового контракта.
- Границы виджетов в боковой панели теперь могут смещаться по желанию пользователя, а сами плашки виджетов могут перемещаться.
- Из окна 'Все сделки' удален неиспользуемый параметр 'Статус' (Статус сделки) в целях уменьшения потребления памяти.

### 6. Изменения в интерфейсах, планируемые в будущих релизах

Напоминаем, что в интерфейсе CGATE в версии 7.15 планируются следующие изменения:

- Планируется удаление следующих полей:
  - FORTS\_REFDATA\_REPL:investor:status
  - FORTS\_REFDATA\_REPL:sess\_option\_series:state
- Планируется удаление таблицы FORTS\_REFDATA\_REPL:option\_series

# Version 7.12 Changes and Updates

## 1. Premium Currency options (Stage 1)

In version 7.12, it is planned to launch new derivative instruments on the Derivatives Market – European premium cash-settled currency options. At the first stage, currency options launch will be based on the platform and the option model (pricing, margining) for the equity options, any additional parameters are not planned. By analogy with equity options, new options (option series) are tied to a collateral futures instrument, the underlying asset for a collateral futures instrument is the exchange rate (asset\_class=2). Thus, the hierarchical structure of the instruments does not change.

The margining model, the calculation algorithm for the volatility curve and the pricing formulas for currency options are completely inherited from the equity options model. The calculating procedure for NetOptionValue is also similar to calculating of this parameter for equity option.

Since the currency options are European and cash-settled, only in-the-money options will be exercised in automatically mode, and orders to exercise/not exercise on such options will not be accepted. To determine the financial result of the option exercise on the expiration day, the underlying asset price the is used, which is calculated similarly to the exercise price of futures for this underlying asset. A detailed description can be found in the relevant contract specifications.

## 2. Changes to the user interface and API

### 2.1. CGATE

- In FORTS\_COMMON\_REPL stream, new field in 'sys\_events' table:
  - event\_type (i4) – Synchro-event type
- In FORTS\_COMMON\_REPL stream, since version 7.12 'type' field in 'sys\_events' table is deprecated and will be removed in version 7.18. Instead, use the 'event\_type' field.
- In FORTS\_REFDATA\_REPL stream, deprecated 'd\_exec\_beg' and 'd\_exec\_end' fields were removed from 'opt\_sess\_contents' table. Instead, use the 'expiration\_date' field from 'sess\_option\_series' table.
- In FORTS\_REFDATA\_REPL stream, deprecated 'step\_price' field was removed from 'opt\_sess\_contents' table. Instead, use the 'step\_price' field from 'sess\_option\_series' table.
- In FORTS\_REFDATA\_REPL stream, since version 7.12 'opt\_sess\_id' field in 'session' table is deprecated and will be removed in version 7.18. Instead, use the 'sess\_id' field.
- In FORTS\_REFDATA\_REPL stream, new fields in 'sess\_option\_series' table:
  - step\_price\_clr (d16.5) - Evening clearing price step cost.
  - step\_price\_interclr (d16.5) - Intraday clearing price step cost.
- In FORTS\_CLR\_REPL stream, 'vat\_ex' and 'vat\_cc' fields were removed from 'fut\_pos', 'opt\_pos', 'fut\_pos\_sa' and 'opt\_pos\_sa' tables.
- In RTS\_INDEX\_REPL stream, since version 7.12 'value' field in 'rts\_index' table is deprecated and will be removed in version 7.18. Instead, use the 'value\_highprec' field.

### 2.2 SIMBA SPECTRA

- In the 'SecurityDefinition (msg id=12)' and 'SecurityStatus (msg id=9)' messages, new value in the 'SecurityTradingStatus' field:
  - '20' - Unknown trading status for the instrument.
  - '122' - Session for the instrument is suspended. You can't place orders, but you can cancel orders on this instrument.
- In the 'SecurityDefinition (msg id=12)' and 'SecurityStatus (msg id=9)' messages, the 'SecurityTradingStatus' field has a new description for the value '2' - Trading in all instruments is suspended. You can't place orders, ut you can cancel orders.

- In the 'SecurityDefinition (msg id=12)' message:
  - Allowed values were changed for 'NoEvents' field:
    - '1' - for futures.
    - '2' - for options.
- Broadcasting was stopped for following fields: 'EventType=5 (Instrument trading start date)' and 'EventType=100 (Instrument exercise start date)'.
- New values for 'CFI-codes' field:
  - 'OCECCS' - European cash-settled currency option Call
  - 'OPECCS' - European cash-settled currency option Put

## 2.3 FAST

- In Security Definition (d) and Security Status (f) messages for SecurityTradingStatus:
  - '122' - new value - Session for the instrument is suspended. You can't place orders but you can cancel orders on this instrument
  - 
  - new description for value '2' - Session for all instruments is suspended. You can't place orders, but you can cancel orders.
- In SecurityDefinition (d) message:
  - for EventType attribute, value '100' is no longer broadcast - Instrument exercise start date
  - 
  - allowed values were changed for NoEvents attribute:
    - '1' - for futures
    - '2' - for options
  - new CFI-codes values for currency options:
    - 'OCECCS' - European cash-settled currency option Call
    - 'OPECCS' - European cash-settled currency option Put

## 3. Changes in command scheme repository

Starting from version 7.12, slow versions of the ChangeClientMoney command (with ID in = 4, 60, 63, 67, 409, 425 / Reply ID out = 104) are deprecated and will be removed in version 7.18. Use a faster version of the ChangeClientMoney command with ID in = 458 / Reply ID out = 187.

## 4. Changes in reports

Extra space was removed in multilegf04cl\_XXYY.csv report title (between NCC\_REQUEST\_BUY and NCC\_REQUEST\_SELL).

## 5. Changes applied to MOEX Spectra Terminal

- New parameters in Financial instruments window: Contract type.
- Widget borders in the side panel can be moved at the request of the user and the widgets sections can be moved.
- In the All trades/ requests window, unused parameter Status (Trade status) was deleted to reduce memory consumption.

## 6. Interface's changes planned for future releases

We remind you that the following changes are planned in the CGATE interface in version 7.15:

- The following fields are planned to remove:
  - FORTS\_REFDATA\_REPL:investor:status
  - FORTS\_REFDATA\_REPL:sess\_option\_series:state

- The 'FORTS\_REFDATA\_REPL:option\_series' table is planned to remove.