

Список изменений в версии 7.21

1. Ввод сервиса TAS (Trade at Settlement)

В ТС СПЕКТРА реализована опция Trade at Settlement (TAS) на фьючерсном Контракте - это возможность указать в заявке спред TAS и купить или продать фьючерсный контракт по будущей расчетной цене текущего торгового дня, определяемой в вечерний клиринг, плюс некий спред, который участник готов заплатить/уступить дополнительно от расчетной цены контракта. TAS позволяет хеджировать позиции с меньшими транзакционными издержками и является инструментом управления позициями для институциональных инвесторов.

Технически TAS в торговой системе реализован как обычный фьючерсный контракт, заключаемый на основании заявок с указанием спреда TAS (TAS-фьючерс), у которого есть опорный (базисный) фьючерсный контракт (БА-фьючерс). Основные особенности реализации TAS-инструментов:

- Фьючерсный контракт, заключаемый на основании заявок с указанием спреда TAS (TAS-фьючерс), действует с момента заключения контракта до ближайшей вечерней клиринговой сессии.
- TAS-фьючерс реализован в стандартной иерархии инструментов как фьючерс с отдельным ФБК.
- Опорными (БА-фьючерсами) для TAS-фьючерсов служат квартальные фьючерсы (включая поставочные) с конкретным сроком исполнения.
- AssetClass, лотность котирования, шаг цены, стоимость шага цены совпадает с БА-фьючерсом.
- Код TAS-инструмента формируется путем прибавления суффикса "-TAS" к коду ФБК БА-фьючерса (например, ФБК БА-фьючерса – GL, ФБК TAS-фьючерса – GL-TAS).
- Заявки по инструментам TAS можно выставлять в течение утренней, дневной и вечерней торговых сессий. Поддерживаемые типы заявок: Day, IOC, FOK. GTD заявки запрещены. Аукциона открытия нет. Неисполненные активные заявки удаляются в вечерний клиринг.
- По TAS-фьючерсам рассчитывается и уплачивается вариационная маржа, размер которой зависит от цены заключенной сторонами сделки. Формулы и детальное описание можно найти в спецификациях контрактов.
- Расчет сделки по заявке с указанием спреда TAS осуществляется в вечернюю клиринговую сессию. В результате позиция по TAS-фьючерсу превращается в позицию по БА-фьючерсу, что технически оформляется технической сделкой закрытия позиции в TAS-фьючерсе по цене 0 и сделкой открытия позиции в БА-фьючерсе по расчетной цене БА-фьючерса. Сделки в таблице сделок помечаются специальным признаком в полях xstatus_sell и xstatus_buy (бит 0x10000 (TASSettlement) - Расчет сделки по заявке с указанием спреда TAS).
- Для отличия в справочнике торгуемых инструментов TAS-фьючерсы имеют специальный флаг (бит 0x100000 в поле signs таблицы fut_sess_contents потока FORTS_REFDATA_REPL).

2. Доработка Адресного режима с мэтчингом по уникальному коду

Произведена доработка нового режима адресных торгов. Теперь в режиме "Адресный режим с мэтчингом по уникальному коду" при выставлении адресной заявки в качестве контрагента (поле broker_to в терминах транзакции AddOrder шлюза) следует обязательно указывать НКЦ (код фирмы с флагом dealer.status 0x10000 – NCC).

3. Тип ввода заявки Участником торгов

У Участников появилась техническая возможность маркировать заявки по способу их создания. Для этого в терминале и шлюзах PLAZA II/FIX/TWIME в команды добавления и изменения заявок добавлено новое поле ComplianceID - Способ ввода заявки. Возможные значения поля:

- ' ' (пробел) или " (пустая строка) – Не заполнено / Не задано;
- 'M' - Ручной ввод;
- 'S' - В результате срабатывания условного поручения (стоп-лосс);

- 'R' - В результате работы алгоритма-робота;
- 'A' - В результате алгоритма автоследования;
- 'D' - Закрытие позиции в результате не исполненного MarginCall.

Обращаем внимание, что новый параметр не влияет на заключение сделки, не проходит никакой проверки на допустимые значения и без изменений отображается в шлюзе (FORTS_TRADE_REPL:orders_log/multileg_orders_log, FORTS_USERORDERBOOK_REPL:orders) и передается в отчеты Регулятора. Исправить его постфактум невозможно.

4. Изменение интервалов пересчета/выдачи информации сервисами волатильности

Изменяется интервал пересчета и выдачи в шлюз временных срезов волатильности и лимитов премий опционов в потоке FORTS_VOLAT_REPL. Новый интервал раздачи равен 10 минутам.

5. Изменения в интерфейсах и API

5.1. CGATE

- В потоке FORTS_TRADE_REPL в таблицы orders_log и multileg_orders_log добавлено новое поле:
- compliance_id (c1) - Способ ввода заявки.
- В потоке FORTS_USERORDERBOOK_REPL в таблицу orders добавлено новое поле:
- compliance_id (c1) - Способ ввода заявки.
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблицу sys_messages добавлено новое поле:
- type_id (i4) - Тип сообщения.
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL удалены устаревшие таблицы fut_rejected_orders и opt_rejected_orders. Вместо этих таблиц надо использовать таблицу rejected_orders потока FORTS_REJECTEDORDERS_REPL.
- Начиная с версии 7.21 поток FORTS_MISCINFO_REPL объявляется устаревшим и будет удален в версии 7.27. Вместо него надо использовать потоки FORTS_RISKINFOBLACK_REPL и FORTS_RISKINFOBACH_REPL.
- В потоке FORTS_INFO_REPL в таблицу futures_params добавлено новое поле:
- tas_base_fut_isin_id (i4) - Идентификатор (isin_id) БА-фьючерса для TAS-фьючерса.

5.2 SIMBA SPECTRA

- Добавлена трансляция нового значения для поля UnderlyingFutureID в сообщении SecurityDefinition (msg id=18): Идентификатор фьючерса (SecurityID) для режима TAS (Trade at Settlement).

5.3 FAST

- Добавлена трансляция нового значения для поля UnderlyingFutureID в сообщении SecurityDefinition: Идентификатор фьючерса (SecurityID) для режима TAS (Trade at Settlement).
- Для поля TrdType добавлено новое значение: '1005' - расчет сделки по заявке с указанием спреда TAS.
- Новый флаг 0x10000 - 'Расчет сделки по заявке с указанием спреда TAS' в поле MDFlags.

5.4 FIX

- Добавлена трансляция в шлюзе FIX в сообщениях New Order Single, Cancel/Replace Request и Execution Report нового поля:
- ComplianceID (tag 376) – Маркировка способа создания заявки.

5.5 TWIME

- Добавлено новое перечисление ComplianceIDEnum.
- В сообщения NewOrderSingle (message id=6000), NewOrderIceberg (message id=6008), NewOrderIcebergX (message id=6011), OrderReplaceRequest (message id=6007),

OrderIcebergReplaceRequest (message id=6010), NewOrderSingleResponse (message id=7015), NewOrderIcebergResponse (message id=7016), OrderReplaceResponse (message id=7018) добавлено поле ComplianceID.

- В EstablishmentRejectCodeEnum добавлено новое значение: "TooFastReconnect" - Пользователь пытается выполнить привязку сессии слишком часто.
- В сообщении EstablishmentReject (message id=5002) в поле EstablishmentRejectCode добавлена трансляция нового значения: "6" TooFastReconnect - Пользователь пытается выполнить привязку сессии слишком часто.
- Версия схемы сообщений (атрибут version в элементе sbe:messageSchema) изменена с 6 на 7.

6. Изменения в репозитории схем подачи команд

- В команду AddOrder добавлено поле compliance_id (c1). Добавлен новый тип команды AddOrder (msgid=474).
- В команду IcebergAddOrder добавлено поле compliance_id (c1). Добавлен новый тип команды IcebergAddOrder (msgid=475).
- В команду MoveOrder добавлено поле compliance_id (c1). Добавлен новый тип команды AddOrder (msgid=476).
- В команду IcebergMoveOrder добавлено поле compliance_id (c1). Добавлен новый тип команды IcebergAddOrder (msgid=477).

7. Изменения в отчетах

- В отчетах fordlogXXYY.csv, oordlogXXYY.csv, multilegordlog_XXYY.csv новое поле: compliance_id char(1) - Способ ввода заявки.
- В отчетах f04_XXYY.csv, f04clXXYYZZZ.csv:
 - новое значение для полей type_buy\type_sell: 28 - "Расчет сделки по заявке с указанием спреда TAS".
 - новый бит в полях signs_buy\signs_sell: TASSettlement (0x10000) - "Расчет сделки по заявке с указанием спреда TAS".
- В отчетах clientsXX00.csv, clientsXXYY.csv новые поля:
 - Category varchar(20) - Категория клиента
 - ClientType varchar(2) - Тип зарегистрированного клиента
- Отчеты multilegordlog_XXYY.csv, onlineregXXYY.csv перенесены из пакета FOYYYYMMDD_2.zip – «ВК - отчеты по итогам клиринга» в пакет EXCHANGEYYYYMMDD.zip – «Вечерние торговые отчеты срочного рынка». Пакет FOYYYYMMDD_2.zip подписывается представителем НКЦ. Пакет EXCHANGEYYYYMMDD.zip подписывается представителем Биржи.

8. Изменения в терминале Срочного рынка

- В окно 'Свои заявки/поручения' добавлен новый параметр: 'Способ ввода' - Способ ввода заявки, тип управления портфелем или причина ('A' - Автоследование, 'M' - Ручной ввод, 'R' - Робот, 'S' - Стоп-лосс, 'D' - MarginCall).