

Плановый релиз систем валютного и фондового рынков 9 декабря 2024 г.

English version below.

Фондовый рынок

Новая версия шлюзового интерфейса Broker52 и BrokerRisk52

В дату релиза будет выпущена новая версия шлюзового интерфейса брокера для подключения к торговой системе на фондовом рынке. Описание новой версии шлюзовых интерфейсов, а также сравнение с предыдущей версией опубликовано на FTP-сервере

Биржи: https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/ASTS/Bridge_Interfaces/Equities/test.

- В таблицу CLIENTCODES будет добавлено новое поле CATEGORY, определяющее категорию клиента.

Расчёт доходности к разным датам

Дополнительно к существующей доходности добавляется отдельно расчёт доходности к дате колл-опциона по средневзвешенной цене. При этом добавляются новые поля:

1. В таблицу «Финансовые инструменты» SECURITIES:
 - поле CALLOPTIONYIELD — доходность к колл-опциону по средневзвешенной цене;
 - поле CALLOPTIONDURATION — дюрация к дате колл-опциона;
 - поле CALLOPTIONDATE — дата колл-опциона. Если даты колл-опциона нет, поле CALLOPTIONDATE не заполняется, доходность и дюрация к дате колл-опциона не рассчитываются.
2. В таблицу «Котировки» EXT_ORDERBOOK:
 - поле CALLOPTIONYIELD — «Доходность к колл-опциону» для каждой цены на покупку и на продажу.
3. В отчёт SEM21 «Биржевая информация на фондовом рынке»:
 - YieldAtWAPCal — доходность к дате колл-опциона по средневзвешенной цене;
 - DateCal — дата колл-опциона;
 - DurationCal — дюрация к дате колл-опциона.

Обновлённая спецификация форматов отчётов размещена на сайте биржи: <https://fs.moex.com/files/943>.

Обновлённые файлы схем и стилей для печатных форм отчётов опубликованы на FTP-сервере биржи: <https://ftp.moex.com/pub/Reports/Equities>.

Доработка к процедуре расчета НКД по облигациям с плавающим купоном и увеличение сроков в РЕПО с ЦК по таким облигациям

Планируется, что по облигациям с купонами, привязанным к различным бенчмаркам (флоутерам), увеличиваются сроки в РЕПО с ЦК до 1 года. Коды расчетов в РЕПО с ЦК увеличиваются до 1 календарного года (366 дней) в адресном РЕПО с ЦК (борды PSRP, PSRY) и в безадресном РЕПО с ЦК до 3 мес. (борды EQTP, EQTY - код расчетов Y0/Y3M).

Планируется, что для всех режимов РЕПО торговой системой будут рассчитываться и транслироваться прогнозные значения НКД на все будущие даты (от даты фактически известных значений НКД до 1 года). В случае отсутствия данных о фактическом НКД торговой системой будет транслироваться величина «прогнозного» НКД.

Приостановка размещений облигаций между датой фиксации и датой купона

Для всех облигаций в режиме «Размещение: Адресные заявки» (борд PSAU, PACY) устанавливается ограничение допустимых кодов расчётов, не допускающее заключение сделок, дата исполнения которых попадает в период между датой фиксации списка владельцев и датой окончания соответствующего купонного периода.

Автоматическое заполнение поля «Партнер» для режимов размещения и выкупов

В таблицу UNDERWRITERS шлюзового интерфейса брокера для подключения к торговой системе будет добавлено новое поле ISDEFAULT, определяющее андеррайтера по умолчанию.

Расширенный список обеспечения

Планируется, что у участников клиринга появляется возможность подать заявление на приём в обеспечение под сделки с частичным обеспечением ценных бумаг, включённых в Расширенный список обеспечения (т. е. на их учёт в составе Единого лимита). Приём таких бумаг в обеспечение производится по торгово-клиринговому счёту, указанному в заявлении участника клиринга, на платной основе. Для поля FeeType в отчёте EQM15 «Отчет по обязательствам участника клиринга по комиссионному вознаграждению» вводятся новые возможные значения:

- «370» «Фондовый рынок. Комиссия за учет обеспечения, включенного в расширенный список обеспечения»;
- «371» «Фондовый рынок. Комиссия за учет обеспечения, включенного в расширенный список обеспечения (досрочное взимание)».

Валютный рынок

Новая версия шлюзового интерфейса Broker52 и BrokerRisk52

В дату релиза будет выпущена новая версия шлюзового интерфейса брокера для подключения к торговой системе на валютном рынке. Описание новой версии шлюзовых интерфейсов, а также сравнение с предыдущей версией опубликовано на FTP-сервере

Биржи: https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/ASTS/Bridge_Interfaces/Currency/test.

- В таблицу CLIENTCODES будет добавлено новое поле CATEGORY, определяющее категорию клиента.

Уменьшение лотности инструментов в режиме CPCL

В режиме CPCL добавляются новые инструменты с размером лота 0,01 ед. валюты лота. Для некоторых существующих инструментов размер лота меняется с 1 на 0,01. Для инструментов с размером лота 0,01 устанавливается размер заявки, равный 1 единице валюты лота.

Новые инструменты с размером лота 0,01:

- CNYRUB_TDS, CNYRUB_TMS, CNYRUBTDSTMS;
- BYNRUB_TDS, BYNRUB_TMS, BYNRUBTDSTMS;
- TRYRUB_TDS, TRYRUB_TMS, TRYRUBTDSTMS;
- RUBKZT_TDS, RUBKZT_TMS, RUBKZTTDSTMS;
- RUBBYN_TDS, RUBBYN_TMS, RUBBYNTDSTMS;
- RUBKGS_TDS, RUBKGS_TMS, RUBKGSTDSTMS;
- RUBUZS_TDS, RUBUZS_TMS, RUBUZSTDSTMS.

Существующие инструменты с изменяющимся размером лота:

- KZTRUB_1TD, KZTRUB_1TM, KZT_1TD1TM;
- AMDRUB_1TD, AMDRUB_1TM, AMD_1TD1TM;
- KGSRUB_1TD, KGSRUB_1TM, KGS_1TD1TM;
- TJSRUB_1TD, TJSRUB_1TM TJS_1TD1TM.

Planned changes in the securities and FX markets system

Securities market

ASTS Bridge broker interface update

On the release date, the new versions of ASTS Bridge broker interface, IFCBroker52 and IFCBrokerRisk52, are planned to be introduced. The new version specifications and changes from the current version of ASTS Bridge broker interface are available on the MOEX FTP

server: https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/ASTS/Bridge_Interfaces/Equities/test.

- A new field, CATEGORY, determining the client category, will be added to the CLIENTCODES table.

Yield calculation for different dates

In addition to the existing yield calculation, a separate yield calculation at call option date at the weighted-average price will be added. New fields will be added:

1. To the SECURITIES table:
 - Field CALLOPTIONYIELD: Yield at call option date at the weighted-average price.
 - Field CALLOPTIONDURATION: Duration to call option date.
 - Field CALLOPTIONDATE: Call option date. If there is no call option date, the field is not filled, and yield and duration to call option date are not calculated.
2. To the EXT_ORDERBOOK table:
 - Field CALLOPTIONYIELD: "Yield at call option date" for each buy and sell price.
3. To the SEM21 report "General market data":
 - YieldAtWAPCal: Yield at call option date at the weighted-average price.
 - DateCal: Call option date.
 - DurationCal: Duration to call option date.

Updated specifications for report formats are available on the MOEX website: <https://fs.moex.com/files/13896>.

Updated files containing schemas and styles for printed report forms are available on the MOEX FTP server: <https://ftp.moex.com/pub/Reports/Equities>.

Enhancement to the Accrued Interest Calculation Procedure for bonds with floating coupons and extension of REPO terms with CCP for such bonds

It is planned that for bonds with coupons linked to various benchmarks (floaters), the REPO terms with central counterparty (CCP) are extended to 1 year. The settlement codes are extended to 1 calendar year (366 days) for negotiated REPO with CCP (PSRP

and PSRY boards) and up to 3 months for anonymous REPO with CCP (EQTP and EQTY boards; Y0/Y3M settlement code).

It is planned that for all REPO modes, the trading system will calculate and transmit forecasted accrued Interest values for all future dates (from the date of actually known accrued interest values up to 1 year). In the absence of data on actual accrued interest, the trading system will transmit the forecasted accrued interest amount.

Suspension of bond placements between record date and coupon date

For all bonds in the "Placement: negotiated orders" mode (PSAU and PACY boards), a restriction on allowable settlement codes is introduced, prohibiting transactions whose settlement date falls between the record date and the end of the corresponding coupon period.

Automatic filling of the "Partner" field for Placement and Buyback modes

A new field, ISDEFAULT, determining the default underwriter, will be added to the UNDERWRITERS table of the bridge broker interface for connection to the trading system.

Expanded collateral list

It is planned that clearing members will have the opportunity to submit an application to accept securities included in the Expanded collateral list as collateral for trades without 100% prefunding (i.e., their inclusion in the Single limit). Such securities will be accepted as collateral based on the trade account specified in the clearing member application, on a paid basis. New possible values will be introduced for the 'FeeType' field in the EQM15 report "Clearing participant's liabilities on commission fee":

- "370" "Securities market. Fee for collateral accounting included in the Expanded collateral list".
- "371" "Securities market. Fee for collateral accounting included in the Expanded collateral list (acceleration of maturity)".

FX market

ASTS Bridge broker interface update

On the release date, the new versions of ASTS Bridge broker interface, IFCBroker52 and IFCBrokerRisk52, are planned to be introduced. The new version specifications and changes from the current version of ASTS Bridge broker interface are available on the MOEX FTP

server: https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/ASTS/Bridge_Interfaces/Currency/test.

- A new field, CATEGORY, determining the client category, will be added to the CLIENTCODES table.

Reduction of lot size for instruments in the CPCL mode

New instruments with a lot size of 0.01 units of lot currency will be added to the CPCL mode. For some existing instruments, the lot size will change from 1 to 0.01. For instruments with a lot size of 0.01, the order size will be set at 1 unit of lot currency.

New instruments with a lot size of 0.01:

- CNYRUB_TDS, CNYRUB_TMS, CNYRUBTDSTMS;
- BYNRUB_TDS, BYNRUB_TMS, BYNRUBTDSTMS;
- TRYRUB_TDS, TRYRUB_TMS, TRYRUBTDSTMS;
- RUBKZT_TDS, RUBKZT_TMS, RUBKZTTDSTMS;
- RUBBYN_TDS, RUBBYN_TMS, RUBBYNTDSTMS;
- RUBKGS_TDS, RUBKGS_TMS, RUBKGSTDSTMS;
- RUBUZS_TDS, RUBUZS_TMS, RUBUZSTDSTMS.

Existing instruments with changing lot size:

- KZTRUB_1TD, KZTRUB_1TM, KZT_1TD1TM;
- AMDRUB_1TD, AMDRUB_1TM, AMD_1TD1TM;
- KGSRUB_1TD, KGSRUB_1TM, KGS_1TD1TM;
- TJSRUB_1TD, TJSRUB_1TM, TJS_1TD1TM.