

Список изменений в версии 9.0

1. Единая торговая сессия на Срочном рынке (ЕТС)

В ТКС Спектра, версия 9.0 реализуется функционал Единой торговой сессии на Срочном рынке (ЕТС).

1.1. ЕТС. Общая концепция

Ключевые изменения, которые принесет ЕТС:

- Отмена Промежуточного клиринга:
 - Нет остановки Торгов в высоколиквидный период времени
 - Нет рисков, связанных с запуском торговой системы после ПК
- Торговая сессия проводится в рамках одних календарных суток:
 - Перенос основного клиринга на момент закрытия рынка
 - Торговый период вечерней сессии относится к текущей торговой сессии
 - Изменения в параметрах определения расчетных цен: РЦ определяется в 19:00, период загрузки рыночных данных 5 минут, количество срезов от 30 до 60, срез (тройка) – лучшие bid/ask/last
- Переход на расчетный цикл T+1 на Срочном рынке:
 - Изменение модели учета средств Участников (плановые и фактические остатки)
 - Расчетная сессия в 20:00 T+1 без остановки торгов + соотв. отчеты
 - Увеличение сроков закрытия Маржинальных требований
 - Реализация аналога сервиса "Вывод в размере Расчетной"
- Исполнение контрактов online (в ходе торгов без приостановок)

Расписание Единой торговой сессии:

- Аукцион открытия (8:50 - 9:00)
- Утренняя дополнительная торговая сессия (9:00 - 10:00)
- Основная торговая сессия (10:00 - 19:30)
- Вечерняя дополнительная торговая сессия (19:30 - 23:50)
- Расчетная сессия (20:00, без приостановки торгов)
- Клиринговая сессия m-t-m (23:50 - 00:30)

1.2. Отмена ПК

Меняется порядок проведения клиринговых сессий на Срочном рынке. Вместо Промежуточного клиринга (ПК) и Вечернего клиринга (ВК) вводятся Клиринговая сессия (mtm) и Расчетная сессия. Клиринговая сессия (mtm) проводится по окончании Торговой сессии (23:50 - 00:30). Расчетная сессия проводится во время Торговой сессии T+1 в 20:00 без приостановки торгов. Таким образом Единая торговая сессия на Срочном рынке будет проходить без приостановки торгов. ПК отменяется.

Изменения в процессах, связанные с отменой ПК:

- Перестают выдаваться синхрособытия, связанные с ПК (intraday_clearing_started, intraday_clearing_finished и т.п.)
- Нет промежуточной переоценки, и учета накопленного фин. реза в промежуточных регистрах
- Экспирация контрактов в ПК заменяется на экспирацию в торгах
- Параметры num_clr_2delivery, num_clr_2delivery_client_default, exp_clearings_cc, exp_clearings_bf, exp_clearings_sa будут изменены в рамках перехода на ЕТС – Делятся на 2 и округляются в большую сторону
- Удаляется пакет отчетов, относящиеся к ПК (FOYYYYMMDD.zip)

Изменения в потоках:

Поток FORTS_REFDATA_REPL:

- В таблице session поле inter_cl_begin, заполняется несуществующей датой (1900), поле объявляется устаревшим и подлежит удалению через два релиза
- В таблице session поле inter_cl_end, заполняется несуществующей датой (1900), поле объявляется устаревшим и подлежит удалению через два релиза
- В таблице session поле inter_cl_state, значение поля обнуляется, поле объявляется устаревшим и подлежит удалению через два релиза
- В таблице sess_option_series поле step_price_interclr, значение поля обнуляется, поле объявляется устаревшим и подлежит удалению через два релиза
- В таблице fut_sess_contents поле step_price_interclr, значение поля обнуляется, поле объявляется устаревшим и подлежит удалению через два релиза
- В таблице fut_instruments поле step_price_interclr, значение поля обнуляется, поле объявляется устаревшим и подлежит удалению через два релиза
- Таблица fut_intercl_info, в таблице транслируются пустые значения, таблица объявляется устаревшей и подлежит удалению через два релиза
- Таблица opt_intercl_info, в таблице транслируются пустые значения, таблица объявляется устаревшей и подлежит удалению через два релиза
- В таблице investor поле num_clr_2delivery: значение поля поделено на 2 и округлено в большую сторону
- В таблице dealer поля num_clr_2delivery и num_clr_2delivery_client_default: значение поля поделено на 2 и округлено в большую сторону

Поток FORTS_INFO_REPL:

- В таблице investor поле num_clr_2delivery: значение поля поделено на 2 и округлено в большую сторону
- В таблице dealer поля num_clr_2delivery и num_clr_2delivery_client_default: значение поля поделено на 2 и округлено в большую сторону
- Поток FORTS_PART_REPL
- В таблице part поле vm_intercl, значение поля обнуляется, поле объявляется устаревшим и подлежит удалению через два релиза
- В таблице part поле premium_intercl, значение поля обнуляется, поле объявляется устаревшим и подлежит удалению через два релиза
- В таблице part_sa поле vm_intercl, значение поля обнуляется, поле объявляется устаревшим и подлежит удалению через два релиза
- В таблице part_sa поле premium_intercl, значение поля обнуляется, поле объявляется устаревшим и подлежит удалению через два релиза

1.3. Функционал расчетной сессии

Расчетная сессия - сервис исполнения требований и обязательств, рассчитанных в Клиринговую сессию Т по разделам 7кр-БФ, РК. Запускается в 20:00 Т+1, проводится без приостановки торгов.

Операции в Расчетную сессию:

- Исполнение обязательств/требований по вариационной марже и премии, определенных в предыдущую Клиринговую сессию mark-to-market по разделам 7кр-БФ, РК
- Исполнение обязательств по комиссионному вознаграждению по сделкам, заключенным в предыдущий торговый день
- Фиксация фактов наличия задолженности Участников клиринга перед НКЦ
- Формируются отчеты по результату исполнения (monsettl)

1.4. Клиринговая сессия (mtm)

Операции в Клиринговую сессию (mtm):

- Расчет компонент вариационной маржи для ВФ
 - фандинг (включая индикативный)
 - фиксация дивидендного индекса и индексов на акции в MICS

- Расчет PnL по результату Торговой сессии - величина прибыли или убытка по итогам Клиринговой сессии (вариационная маржа, сборы, премии, штрафы), учитывается в отдельных плановых mtm-регистрах до Расчетной сессии дня T+1. Учитывается в Клиринговую сессию в лимитах для РК. Учитывается в Расчетную сессию в остатках для РК.
- Пересчет ценовых границ
- Пересчет ГО
- Изменение даты в системе и назначение новой торговой сессии
- Формирование отчетов

1.5. Средства Участников (лимиты и остатки)

Меняется модель учета средств Участников, в связи с переходом на расчеты T+1. В период Клиринговой сессии будет определяться вариационная маржа, премия, производится расчет комиссий, штрафов (плановые начисления/удержания). Эти суммы будут формировать новый регистр плановых расчетов - MTM регистры, которые будут хранить информацию о дате клиринговой сессии, дате расчета, типе начисления/удержания, сумме расчета. Остаток средств участника, определенный по итогу клиринговой сессии (день T), не будет включать данные плановые расчеты.

По результатам Клиринговой сессии, исходя из сумм остатков на счетах и плановых начислений/удержаний, определяется торговый лимит участника для обеспечения торгов. В случае недостаточности средств под обеспечение участника, на следующий день, за днем торговой сессии, выставляется маржинальное требование, которое должно быть исполнено до 17:30 указанного дня.

На следующий день (T+1), в расчетную сессию в 20:00, производится фактическое исполнение обязательств по плановым начислениям/удержаниям. Данные MTM регистров при полном закрытии обязательства очищаются. Остаток средств участника на момент проведения расчетной сессии дня T+1 определяется как остаток на начало дня + сумма вводов/выводов за T+1 на момент проведения РС + сумма исполненных обязательств MTM регистров. Таким образом, в рамках проекта ETC вводится новый механизм расчетов - T+1.

Общая концепция по изменению состояния лимитов и остатков представлена ниже.

Клиринговая сессия 23:50 День T

- **Лимиты (part)**
 - Обновляем торговые **лимиты** part.money_amount на величину **PnL (MTM регистр)** по **7кр** и **БФ** (где part.is_auto_update_limit = 1)
 - Устанавливаем **лимиты** part.money_amount по **БФ** (где dealer.limit_tied_money = 1), по **РК** part_sa.money_amount: равным **остаткам + PnL**
 - **PnL=charges+vm+premium**
- **Остатки (money_clearing)**
 - **Остатки** по РФ-БФ-7кр и РК на величину **PnL не меняются**, **PnL** храним в MTM регистре в разрезе по требованиям/обязательствам
 - **Остатки** по РФ-БФ-7кр и РК **меняются на сумму вводов/выводов** в течение торговой сессии, а также на сумму рублевой переоценки валюты (РК СР) и профилей активов (РК ЕП) - сальдо вводов-выводов (**in_out_netto**)
 - **PnL=charges+vm+premium**
- **Отчеты**
 - Транслируем расчет остатков в клиринговую реплику и клиринговые отчеты (**mon, mon_cb**)
- **Расчетная сессия 20:00 День T+1**
- **Лимиты (part)**
 - Не меняются
- **Остатки (money_clearing)**
 - Обновляем **остатки** РФ-БФ-7кр money_clearing.money_end на величину **PnL** и на сальдо вводов-выводов (**in_out_netto**) за текущий день на момент проведения Расчетной сессии
 - Обновляем **остатки** РК money_clearing_sa.money_end на величину **PnL**, и на сальдо вводов-выводов (**in_out_netto**) за текущий день
- **Отчеты**
 - Транслируем расчет остатков в клиринговую реплику и клиринговые отчеты

Торговые лимиты

Торговые **лимиты**, как средства Участников, учитываются на регистрах в Ядре по разделам 7кр-БФ и РК. Транслируются во внешние потоки **part.money_amount**, по РК - **part_sa.money_amount**. Торговый лимит не тождественен остатку на счете и может не отражать реальную величину денег у Участника и его клиентов.

По результатам Клиринговой сессии, начальное значение **money_amount** (Общее количество рублей и дисконтированных в рубли залогов), включает плановые данные по MTM регистрам (плановые суммы вар. маржи, премии, комиссий и штрафов, которые будут рассчитаны в РС). В течение торговой сессии сумма **money_amount** меняется с учетом вводов/выводов средств данного дня.

Добавляется новый атрибут - значение "фактическое количество рублей" - это сумма "чистых" рублей - **actual_amount_of_base_currency**, которая включается в сумму **money_amount**. Рассчитывается как $\text{actual_amount_of_base_currency} = \text{money_amount} - \text{money_pledge_amount} - \text{сумма MTM регистров (charges_mtm + vm_mtm + premium_mtm)}$. Данная сумма может меняться в течении дня на размер вводов/выводов и во время Расчетной сессии на размер MTM регистров.

Остатки на счетах

Остатки на счетах, как средства Участников, учитываются на регистрах Бэк-офисов ТКС и СЦК. Транслируются во внешние потоки по 7кк-БФ-РФ - **money_clearing**, по РК - **money_clearing_sa** поле **amount_end** (в рублях, детализация по валютам в **pledge_details.xamount**). Остаток на счете - это сальдо по деньгам. Включает фактические и плановые регистры.

Изменение фактических и плановых остатков производится дважды в день, по результатам Расчетной и Клиринговой сессии. Данные в таблицах **money_clearing/money_clearing_sa** будут отображать результат проведения последней Расчетной или Клиринговой сессии, будут включать **плановые (требования и обязательства)** и фактические остатки и обязательства по результатам Расчетной и Клиринговой сессии. Для учета обязательств дня T+1 вводятся изменения в структуру таблицы.

В таблицы **money_clearing/money_clearing_sa** добавляется дата Расчетной или Клиринговой сессии, плановый остаток средств с учетом MTM регистров, сальдо вводов/выводов, сводный регистр учета комиссий/штрафов, MTM регистры.

Атрибуты, отражающие фактические данные:

- **date_money_clearing** - дата и время прошедшей Расчетной или Клиринговой сессии.
- **amount_beg** - остаток средств на начало текущего торгового дня.
- **amount_end** - остаток средств по результатам Расчетной или Клиринговой сессии.
- **in_out_netto** - сальдо вводов/выводов. Включает в себя сумму с начала текущего торгового дня до времени проведения Расчетной или Клиринговой сессии.
- **charges** - содержит в себе информацию о всех фактически исполненных обязательствах по уплате комиссий, штрафов по результатам Расчетной сессии. Включает в себя суммы **fee_fut** (Фактически рассчитанная сумма фьючерсного биржевого и клирингового сбора за анонимные сделки) и **fee_opt** (Фактически рассчитанная сумма опционного биржевого и клирингового сбора за анонимные сделки). Сохраняем для совместимости данные поля, как отдельную детализацию информации.
- **vm** - содержит в себе информацию об итоговой сумме фактически уплаченной/удержанной вар. марже.
- **premium** - содержит в себе информацию об итоговой сумме фактически уплаченной/удержанной премии по опционам.

Атрибуты, отражающие плановые данные:

- **settl_datetime** - плановая дата расчетов по обязательствам.
- **amount_end_mtm** - плановый остаток средств с учетом исполнения плановых начислений/списаний (MTM регистров).
- **MTM регистры** отображают плановые начисления/удержания по результатам Клиринговой сессии. Включают в себя три регистра:
 - **charges_mtm** - регистр учета плановых удержаний всех комиссий (брокерской, клиринговой, за исполнение и иных), штрафов. Включает в себя суммы **fee_fut_mtm** (Плановое обязательство по сумме фьючерсного биржевого и клирингового сбора за анонимные сделки)

и **fee_opt_mtm** (Плановое обязательство по сумме опционного биржевого и клирингового сбора за анонимные сделки) ;

- **vm_mtm** - регистр учета плановых начислений/списаний вариационной маржи;
- **premium_mtm** - регистр учета плановых начислений/списаний премии.

Меняется расчет **free (Свободно средств)**=amount_end (Денег на конец дня)
+charges_mtm+vm_mtm+premium_mtm+NOV-go

1.6. Экспирация контрактов в торгах

В ETC добавляется экспирация в ходе торгов (экспирация по расписанию). Способ экспирации контракта задается на уровне фьючерсного инструмента и ОС (признак взаимоисключающий). Транслируется в шлюзе в потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблицах fut_sess_contents в поле signs: 0x80000 - Исполнение по расписанию или исполнение в Клиринговую сессию, 0 - Исполнение в КС; 1 - Исполнение по расписанию, и sess_option_series в поле signs: 0x1 - Исполнение по расписанию или исполнение в Клиринговую сессию, 0 - Исполнение в КС; 1 - Исполнение по расписанию. Для исполнения в торгах добавляется новый параметр expiration_time - время экспирации. Транслируется в шлюзе в потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблицах fut_vcb и sess_option_series. Экспирация в торгах проводится в 14:00 и в 19:00.

Могут быть исполнены в торгах:

- Расчетные фьючерсные контракты
- Маржируемые опционы, которые экспирируются в один день с их фьючерсом
- Премияльные опционы
- Маржируемые опционы, дата экспирации которых не совпадает с их базовым фьючерсом (в 19 00, в момент фиксации РС)

Исполнение в рамках Клиринговой сессии (mtm):

- Поставочные фьючерсные контракты
- Досрочное исполнение по опционным контрактам американского типа (маржируемые опционы)
- Выход из "вечных" фьючерсов будет производиться в 23:50

Особенности проведения экспирации контрактов:

- Экспирация контракта проводится в ходе торгов и в ходе Клиринговой сессии (mtm) после определения цены исполнения контракта
- Финансовый результат исполнения контрактов расчетного типа фиксируется в ходе торгов и включается в состав требований/обязательств, рассчитываемых в ходе ближайшей следующей Клиринговой сессии (mtm) или в ходе текущей, для контрактов, исполняемых в клиринг

1.7. Вывод денежных средств (рублей)

До Расчетной сессии

После Клиринговой сессии и до проведения Расчетной сессии максимальная сумма в рублях, доступная для вывода, определяется, как минимальное из значений: свободный лимит и максимальное из значений: остаток денежных средств в Российских рублях и остаток денежных средств в Российских рублях на mtm регистрах.

Максимальная суммы для вывода = MIN (money_free; MAX (остаток российских рублей; остаток российских рублей + mtm регистры))

"Остаток российских рублей" - это фактический остаток в российских рублях без учета оценки залогов и mtm регистров.

После проведения Расчетной сессии

После проведения Расчетной сессии фактический остаток валюты "российские рубли" становится равным остаток российских рублей до Расчетной сессии + mtm регистры

Максимальная суммы для вывода = MIN (money_free; остаток российских рублей)

1.8. Изменения в отчетах

- Удален пакет отчетов FOYYYYMMDD_1.zip ПК - отчеты по итогам пром.клиринга (1.zip)
- Добавлен новый пакет отчетов SETTLEYYYYMMDD.zip - Отчеты по результатам Расчетной Сессии в 20:00:
 - monsettlXXXX.csv - Отчет по деньгам БФ/РФ по итогам Расчетной сессии
 - monsettlclXXXXZZZ.csv - Отчет по деньгам клиента по итогам Расчетной сессии
- Изменено название пакета FOYYYYMMDD_2.zip БК - отчеты по итогам клиринга (2.zip). Теперь это: FOYYYYMMDD_2.zip - Отчеты по итогам Клиринговой сессии
- В пакет отчетов FOYYYYMMDD_2.zip - Отчеты по итогам Клиринговой сессии добавлены отчеты:
 - chargesXXXX.csv - Отчет о начисленных комиссиях, штрафах и иных обязательствах по РФ/БФ
 - chargesclXXXXZZZ.csv - Отчет о начисленных комиссиях, штрафах и иных обязательствах по клиентам
- Изменение в monXXXX.csv, monclXXXXZZZ.csv:
 - Добавлены новые поля:
 - settle_date (char(10)) - Дата расчетов T+1, т.е. дата дня, когда будет Расчетная сессия
 - var_marg_mtm (numeric(16, 2)) - Вариационная маржа (руб.) начисленная в Клиринговую сессию
 - prem_mtm (numeric(16, 2)) - Опционная премия (руб.) начисленная в Клиринговую сессию
 - in_out_netto (numeric(16, 2)) - Изменение суммы денежных средств в рублях РФ и/ или оценочной стоимости иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу в течение дня (в рублях РФ) по операциям ввода / вывода
 - charges (numeric(16, 2)) - Фактическое исполнение обязательства по уплате комиссий, штрафов и обязательства по выплате / получению единовременного платежа по выходу из вечного фьючерса
 - charges_mtm (numeric(16, 2)) - Начисленные обязательства по уплате комиссий, штрафов и обязательства по выплате / получению единовременного платежа по выходу из вечного фьючерса
 - fut_sbor_mtm (numeric(16, 2)) - Начисленная в Клиринговую сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с фьючерсами (руб.)
 - opt_sbor_mtm (numeric(16, 2)) - Начисленная в Клиринговую сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с опционами (руб.)
 - amount_end_mtm (numeric(16, 2)) - Плановая, рассчитанная с учетом начисленных mtm значений, сумма денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на конец отчетного дня (в рублях РФ)
 - sbor_ex_mtm (numeric(16,2)) - Начисленные обязательства по уплате биржевого сбора за адресные и безадресные сделки (руб.)
 - sbor_cc_mtm (numeric(16,2)) - Начисленное обязательство по уплате Комиссионного вознаграждения Клирингового центра за адресные и безадресные сделки (руб.)
 - Удалены поля pay, gowide, freewide, margincall, vat_ex, vat_cc, ext_rez.
- Изменение в multilegf04_XXXX.csv, multilegf04clXXXXZZZ.csv:
 - Удалены поля vat_ex_b, vat_cc_b, vat_ex_s, vat_cc_s, price_rur2.
- Изменение в f04_XXXX.csv, f04clXXXXZZZ.csv:
 - Удалены поля profit_usd, vat_ex_b, vat_cc_b, vat_ex_s, vat_cc_s.
- Изменение в o04_XXXX.csv, o04clXXXXZZZ.csv:
 - Удалены поля profit_usd, vat_ex_b, vat_cc_b, vat_ex_s, vat_cc_s.
- Изменение в f07.csv:
 - Удалены поля limit, pr_settl, pr_settl_r, spot, base.
- Изменение в o07.csv:
 - Удалены поля pr_volat, pr_theorpr.

- Изменение в payXXYY.csv, payclXXYYZZZ.csv:
 - Удалены поля payer, inn, bik.
- Изменение в fposXXYY.csv, fposclXXYYZZZ.csv:
 - Удалены поля go_netto, accum_go, fee_trans, vat_ex, vat_cc, pos_failed, var_marg_prom.
- Изменение в oposXXYY.csv, oposclXXYYZZZ.csv:
 - Удалены поля vat_ex, vat_cc, var_marg_prom, prem_prom, prem_prom_currency.
- Изменение в riskposXXYY.csv:
 - Удалено поле fee_risk.
- Изменение в clientsXX00.csv/clientsXXYY.csv:
 - Удалены поля isrepo, account_forts.
- Изменение в tranfeeXXYY.csv:
 - Удалены поля futopt, mm, addtr, fee, vat_sbortr.
- Изменение в f04_trade_XXYY.csv, f04cl_trade_XXYYZZZ.csv:
 - Удалены поля profit_usd, vat_ex_b, vat_cc_b, vat_ex_s, vat_cc_s.
- Изменение в o04_trade_XXYY.csv, o04cl_trade_XXYYZZZ.csv:
 - Удалены поля profit_usd, vat_ex_b, vat_cc_b, vat_ex_s, vat_cc_s.
- Изменение в multilegf04_trade_XXYY.csv, multilegf04cl_trade_XXYYZZZ.csv:
 - Удалены поля vat_ex_b, vat_cc_b, vat_ex_s, vat_cc_s, price_rur2.
- Изменение в multilegordlog_trade_XXYY.csv:
 - Удалены поля rate, date_clr.

1.9. Комиссии

С реализацией ETC на Срочном рынке вносятся изменения по ежемесячным\ежеквартальным списаниям. Списание комиссий в ETC производится в два этапа:

- Сначала ежемесячная/ежеквартальная комиссия начисляется и включается в charges_mtm регистр в Клиринговую сессию дня расчета комиссии (первый/последний день месяца/квартала)
- Списание комиссии происходит на следующий день в Расчетную сессию

2. Двойное ГО при поставке по фьючерсам на акции

Процесс поставки фьючерса на акцию подразумевает блокирование гарантийного обеспечения по позиции по поставленному фьючерсу до момента заключения сделок T+ по поставке на Фондовом рынке при неотрицательном Едином лимите. Такой подход требует от Участника в момент поставки двойного гарантийного обеспечения (одновременно на Срочном и Фондовом рынках).

Теперь, если поставка фьючерса на акции со Срочного рынка на Фондовый рынок происходит внутри одного Расчетного кода Единого пула, то после заключения сделок T+ по поставке на Фондовом рынке и сообщения из ASTS Фондового рынка о том, что обязательства по фьючерсу исполнены, в SPECTRA безусловно (без проверки Единый лимит>0) закрывается позиция по поставленному фьючерсу и гарантийное обеспечение высвобождается. Дальнейший контроль освобожденного ГО не предполагается и Участник может распорядиться средствами как для открытия позиции на CP так и перевести на ФР.

Для Участников под РК не ЕП процесс поставки не меняется.

3. Уведомление в ТКС Спектра о влиянии КГО на МКС

При установке коэффициента ГО в разрезе БФ+БА, если БА входит в МКС, то значение коэффициента применяется ко всем базовым активам, которые входят в МКС, причем для данной БФ выбирается наибольшее значение КГО среди БА, входящих в МКС. При задании КГО в разрезе БФ+БА в ТКС Спектра добавлено уведомление, что будет применяться наибольший КГО из всех ФБК, входящих в этот МКС: *"Внимание: БА входит в МКС. Будет применяться наибольшее значение КГО по БА, входящих в МКС, по данной БФ."*

Уведомление в шлюзе приходит в ответе на успешное выполнение команды ChangeBFClientBaseContractParametersNextSession - Изменение параметров клиентов БФ по БА. И показывается в Терминале Срочного рынка в окне редактирования параметров клиентов БФ по БА (Администрирование→ Управление параметрами клиентов БФ по БА→ Добавить/Изменить параметры клиентов БФ по БА). Также в окне Управление параметрами клиентов БФ по БА (Администрирование→

Управление параметрами клиентов БФ по БА) добавлены поля: "МКС" - код межконтрактного спреда; "Активный коэф. ГО (МКС)" - используемый КГО (*наибольшее значение КГО из всех БА, входящих в МКС по данной БФ*).

4. Доработка динамического экспорта терминала SPECTRA

В Терминале Срочного рынка добавлена опция резервное копирование выгружаемых файлов. В настройках в диалог Настройки → Основные → Общие в секцию Экспорт данных добавлен чекбокс "Сохранять резервные копии" (по умолчанию выключена) с дополнительной опцией "Ширина поля для номера резервной копии" (от 1 до 6), значение по умолчанию 3, что соответствует файлам резервной копии вида Pos.001.csv.

Если опция резервного копирования включена, то любой экспорт будет приводить к предварительному переносу предыдущего содержимого файла в файл с резервной копией и номером, максимальным среди существующих + 1 (например, Pos.001.csv). Файл создается в той же директории, что и основной. При достижении максимально возможного для заданной ширины номера имени файла, в каждый последующий экспорт резервные копии будут перезаписываться в последний, например, в Pos.999.csv (для ширины 3).

5. Изменения в интерфейсах и API

5.1. CGATE

- В потоке FORTS_USERORDERBOOK_REPL в таблице info удалены устаревшие поля logRev и lifeNum (объявлялось в версии 8.3). Вместо этих полей надо использовать поля trades_rev и trades_lifenum, соответственно.
- В потоке FORTS_ORDBOOK_REPL в таблице info удалены устаревшие поля logRev и lifeNum (объявлялось в версии 8.3). Вместо этих полей надо использовать поля trades_rev и trades_lifenum, соответственно.
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблице session поля inter_cl_begin (t), inter_cl_end (t), inter_cl_state (i4) объявляются устаревшими и будут удалены в версии 9.6
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблице session добавлены новые поля:
 - settl_sess_begin (t) - Дата и время начала расчетной сессии (settlement session)
 - clr_sess_begin (t) - Дата и время начала клиринговой сессии (clearing session)
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблице sess_option_series поле step_price_interclr (d16.5) объявляется устаревшим и будет удалено в версии 9.6
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблице fut_sess_contents поле step_price_interclr (d16.5) объявляется устаревшим и будет удалено в версии 9.6
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблице fut_instruments поле step_price_interclr (d16.5) объявляется устаревшим и будет удалено в версии 9.6
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL таблица fut_intercl_info объявляется устаревшей и будет удалена в версии 9.6
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL таблица opt_intercl_info объявляется устаревшей и будет удалена в версии 9.6
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблице investor поле num_clr_2delivery (i4): значение поля поделено на 2 и округлено в большую сторону
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблице dealer поля num_clr_2delivery (i4) и num_clr_2delivery_client_default (i4): значение поля поделено на 2 и округлено в большую сторону
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблице fut_vcb в поле signs переопределено назначение флага '0x1'. Теперь это: Исполнение по расписанию или исполнение в клиринговую сессию:
 - '0' - в Клиринговую сессию
 - '1' - по расписанию
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблице fut_sess_contents в поле signs переопределено назначение флага '0x80000'. Теперь это: Исполнение по расписанию или исполнение в клиринговую сессию:
 - '0' - в Клиринговую сессию
 - '1' - по расписанию
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблице sess_option_series в поле signs переопределено назначение флага '0x1'. Теперь это: Исполнение по расписанию или исполнение в клиринговую сессию:
 - '0' - в Клиринговую сессию

- '1' - по расписанию
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблицы fut_vcb и sess_option_series добавлено новое поле:
 - expiration_time (t) - Время экспирации
- В потоке FORTS_INFO_REPL в таблице investor поле num_clr_2delivery (i4): значение поля поделено на 2 и округлено в большую сторону
- В потоке FORTS_INFO_REPL в таблице dealer поля num_clr_2delivery (i4) и num_clr_2delivery_client_default (i4): значение поля поделено на 2 и округлено в большую сторону
- В потоке FORTS_INFO_REPL в таблице base_contracts_params в поле signs переопределено назначение флага '0x1'. Теперь это: Исполнение по расписанию или исполнение в клиринговую сессию:
 - '0' - в Клиринговую сессию
 - '1' - по расписанию
- В потоке FORTS_PART_REPL в таблицы part и part_sa добавлено новое поле:
 - actual_amount_of_base_currency (d26.2) - Фактическое количество рублей
- В потоке FORTS_PART_REPL в таблицах part и part_sa поля vm_intercl и premium_intercl объявляются устаревшими и будут удалены в версии 9.6
- В потоке FORTS_CLR_REPL в таблицы money_clearing и money_clearing_sa добавлены новые поля:
 - date_money_clearing (t) - Дата и время формирования остатков в Клиринговую или Расчетную сессию
 - settl_datetime (t) - Плановая дата расчетов по обязательствам
 - in_out_netto (d16.2) - Текущее сальдо вводов/выводов
 - vm_mtm (d16.2) - Плановое обязательство (определенное в КС) по вариационной марже, включая вариационную маржу по маржируемым опционам
 - premium_mtm (d16.2) - Плановое обязательство (определенное в КС) по премии по опционам, включает в себя финансовый результат исполнения
 - charges (d16.2) - Фактически рассчитанные (в РС) обязательства по уплате комиссий и штрафов
 - charges_mtm (d16.2) - Плановые обязательства (определенное в КС) по уплате комиссий и штрафов
 - fee_fut_mtm (d16.2) - Плановое обязательство (определенное в КС) по сумме фьючерсного биржевого и клирингового сбора за анонимные сделки
 - fee_opt_mtm (d16.2) - Плановое обязательство (определенное в КС) по сумме опционного биржевого и клирингового сбора за анонимные сделки
- В потоке FORTS_CLR_REPL в таблицах money_clearing и money_clearing_sa поле ray объявляется устаревшим и будет удалено в версии 9.6

5.2 TWIME

- Прекращена раздача сообщения SystemEvent с типами событий:
 - "102" IntradayClearingFinished - Все расчетные процедуры в промклиринге закончены.
 - "104" IntradayClearingStarted - Начало промклиринга.
- В схеме сообщений в TradSesEventEnum удалены значения:
 - 102 - IntradayClearingFinished;
 - 104 - IntradayClearingStarted.

5.3. FAST

- В сообщении TradingSessionStatus:
 - Идентификатор сообщения id изменен с 41 на 46.
 - Удалены поля TradSesIntermClearingStartTime и TradSesIntermClearingEndTime
 - Добавлены поля:
 - SettlSessBegin - Дата и время начала расчетной сессии в формате: YYYYMMDDHHMMSSsss
 - ClrSessBegin - Дата и время начала клиринговой сессии в формате: YYYYMMDDHHMMSSsss
- В сообщении SecurityDefinition в поле Flags переопределено назначение флага '0x80000'. Теперь это: Исполнение по расписанию или исполнение в клиринговую сессию:
 - '0' - в Клиринговую сессию

- '1' - по расписанию
- В сообщении SecurityDefinition:
 - Изменено описание группы полей EventType=7, EventDate, EventTime.
 - Изменено описание группы полей EventType=101, EventDate, EventTime.
 - Изменено описание пары полей MaturityDate, MaturityTime.

5.4. SIMBA

- Версия схемы сообщений изменена с 6 на 8.
- В сообщении TradingSessionStatus:
 - Идентификатор сообщения msg id изменен с 23 на 26.
 - Удалены поля TradSesIntermClearingStartTime и TradSesIntermClearingEndTime.
 - Добавлены поля:
 - SettlSessBegin - Дата и время начала расчетной сессии в формате: YYYYMMDDHHMMSSsss
 - ClrSessBegin - Дата и время начала клиринговой сессии в формате: YYYYMMDDHHMMSSsss
- В сообщении SecurityDefinition в поле Flags переопределено назначение флага '0x80000'. Теперь это: Исполнение по расписанию или исполнение в клиринговую сессию:
 - '0' - в Клиринговую сессию
 - '1' - по расписанию
- В сообщении SecurityDefinition:
 - Изменено описание группы полей EventType=7, EventDate, EventTime.
 - Изменено описание группы полей EventType=101, EventDate, EventTime.
 - Изменено описание пары полей MaturityDate, MaturityTime.

6. Изменения в Терминале Срочного рынка

- В окне **Сессия** добавлены новые параметры:
 - **Расч. начало** - Время начала расчетной сессии
 - **Клир. начало** - Время начала клиринговой сессии
- В окне **Управление параметрами клиентов БФ по БА** добавлены новые параметры:
 - **МКС** - Код межконтрактного спреда
 - **Активный коэф. ГО (МКС)** - Используемый КГО - наибольшее значение КГО из всех БА, входящих в МКС по данной БФ
- В окне **Установка параметров БФ по БА** добавлено предупреждение: "Внимание: Если БА входит в МКС, то будет применяться наибольшее значение КГО по БА, входящих в МКС, по данной БФ"
- В окне **Запреты на операции** добавлены фильтры по полям: **Секция, Приоритет, Состояние.**
- Добавлена опция резервного копирования при экспорте данных в файл