

Список изменений в версии 9.6

1. Порядок расчета лимитов цен опционов в ДСВД

Внедряется в режиме технической готовности. О запуске торговли опционами в безадресном режиме в ДСВД будет объявлено дополнительно.

В версии 9.6 в ТС Спектра добавляется проверка цен опционов в заявках клиентов на соответствие лимитам цен опционов, установленных в ТС, в период дополнительной сессии выходного дня (ДСВД). Логика проверки стандартная: заявки на покупку с ценой, выше верхнего лимита цены, и заявки на продажу с ценой, ниже нижнего лимита цены, считаются некорректными и отклоняются системой.

Расчет лимитов цен в ДСВД осуществляется для каждого опциона с учетом факторов, оказывающих влияние на цену опционов (цена базисного актива, сценарии волатильности, процентные ставки), в соответствии с существующей методикой <https://www.moex.com/a1898> с учетом следующих особенностей:

- максимальный и минимальный сценарий волатильности доходности базисного актива принимают значение расчетная волатильность доходности базисного актива на момент 23:50 последнего торгового дня перед ДСВД;
- в качестве максимальной/минимальной цены базисного актива используется верхняя/нижняя граница фьючерса (коллатерала) данного опциона.

Рассчитанные значения публикуются в шлюзе в таблице volat потока FORTS_VOLAT_REPL в полях up_prem_weekend и down_prem_weekend (вне ДСВД значения этих полей равны -1), и показываются в терминале Срочного рынка в окне Финансовые инструменты в полях "Верхний лимит ДСВД" (weekend_price_lmt_high) и "Нижний лимит ДСВД" (weekend_price_lmt_low).

Проверка опционных заявок на соответствие лимитам цен в ДСВД является обязательной для безадресного режима торгов. Кроме этого, у клиентов остается возможность инициировать проверку заявки по текущему опциональному алгоритму при подаче заявки (is_check_limit), где проверяется соответствие цены границам volat.up_prem и volat.down_prem.

2. Доработки торговли и поставки на Срочном рынке для клиентов недружественных нерезидентов в рамках Указа №436

В связи с Указом №436 и Решением Совета директоров БР "Об установлении режима счетов типа "Ин" в ТС Спектра реализована поддержка доступа недружественных нерезидентов, имеющих счета типа "Ин", к торгам и поставке по фьючерсам на акции российских эмитентов.

Для реализации счетов типа "Ин" на уровень Расчетного кода добавляется новый признак "SPF". В шлюзе признак транслируется в таблице fut_margin_type потока FORTS_REFDATA_REPL в поле spf - Признак того, что расчетный код открыт для нерезидентов недружественных стран: 0 – обычный расчетный код, 2 – расчетный код типа "Ин". Клиентам (7кк с признаком "нерезидент"), зарегистрированным под РК с признаком "SPF", разрешается торговля фьючерсами на акции российских эмитентов, но только в безадресном режиме. Подача адресных заявок для счетов типа "Ин" запрещена (возвращается ошибка 3003 - Адресные заявки по РК ИН запрещены).

3. Добавить в сервис rmt расчет premium

Произведена доработка сервиса regulation of margin trading (RMT-сервис), который позволяет осуществлять расчет Нормативов покрытия риска (НПП1 и НПП2) в рамках рыночного метода на стороне Участника клиринга. Теперь при расчете нормативов необходимо учитывать премию по премиальным опционам на спот:

$$\text{НПП1} = \text{начальная стоимость портфеля} + \text{BM} + \text{NOV} + \text{premium} - \text{ГО б/з}$$

$$\text{НПП2} = \text{начальная стоимость портфеля} + \text{BM} + \text{NOV} + \text{premium} - (\text{ГО б/з})/2,$$

где premium - накопленная по сделкам премия по премиальным опционам, подлежащая к уплате в ближайший Клиринг, в пересчете на рубли.

Значение премии рассчитывается и транслируется Участникам по аналогии с другими компонентами, используемыми для расчета НПП1 и НПП2 в рамках рыночного метода, в шлюзе в потоке FORTS_RMT_REPL в таблице rmt_im в поле rmt_premium.

4. Доработки для заведения контракта за 2 клиринга до старта торгов

Меняется логика заведения новых инструментов в системе. У торгового инструмента добавлен новый атрибут: **Дата начала торгов(d_sess_assign)** - календарная дата, с которой возможно постановка заявок. Торговый инструмент при появлении в системе доступен в торгах с даты начала торгов, инструмент доступен в торгах с первого доступного торгового периода указанной календарной даты.

5. Изменение времени трансляции данных в потоках FORTS_VM_REPL, FORTS_VOLAT_REPL

В версиях до Spectra-9.3 включительно, после проведения вечерней M-t-M сессии, данные по завершенной и рассчитанной сессии транслировались в потоках FORTS_VM_REPL, FORTS_VOLAT_REPL вплоть до периода обслуживания системы, вместе с данными новой назначенной сессии. Далее, при обслуживании, данные старой сессии удалялись.

С версии Spectra-9.6, данные по старой сессии в потоках FORTS_VM_REPL, FORTS_VOLAT_REPL будут удаляться в процессе назначения новой торговой сессии и формирования начальных данных для нее. Таким образом, в каждый момент времени, в

потоках FORTS_VM_REPL, FORTS_VOLAT_REPL будут транслироваться данные только одной торговой сессии.

6. Изменения в интерфейсах и API

ОБРАЩАЕМ ВАШЕ ВНИМАНИЕ, что изменения в протоколах FAST SPECTRA и SIMBA SPECTRA срочного рынка не сохраняют обратной совместимости и требуют доработок на стороне клиентского ПО

6.1. CGATE

- В потоке FORTS_TRADE_REPL в таблицу orders_log добавлено новое поле:
 - prevorder_id (i8) - Номер заявки, измененной в результате операции MoveOrder. Заполняется только в новых заявках, сгенерированных при успешном выполнении операции MoveOrder.
- В потоке FORTS_USERORDERBOOK_REPL в таблицу orders добавлено новое поле:
 - prevorder_id (i8) - Номер заявки, измененной в результате операции MoveOrder. Заполняется только в новых заявках, сгенерированных при успешном выполнении операции MoveOrder.
- В потоке FORTS_PART_REPL в таблицы part и part_sa добавлено новое поле:
 - moment (t) - Время обновления записи
- В потоке FORTS_VOLAT_REPL в таблицу volat_sa добавлены новые поля:
 - up_prem_weekend (d16.5) - Верхний лимит премии по опциону в дополнительной сессии выходного дня
 - down_prem_weekend (d16.5) – Нижний лимит премии по опциону в дополнительной сессии выходного дня
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблице fut_sess_contents добавлено поле:
 - d_sess_assign (t) - Дата начала торгов (календарная дата, с которой возможна постанова заявок по инструменту)
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблице sess_option_series:
 - изменена семантика поля d_sess_assign, теперь это - Дата начала торгов (календарная дата, с которой возможна постанова заявок по инструменту)
 - добавлено поле fixed_spot_discount_clr (f) - Сумма дисконтированных значений объявленных денежных потоков. CF, посчитанный на начало торгового дня T.
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблице fut_margin_type добавлено поле:
 - spf (i1) - Признак того, что расчетный код открыт для нерезидентов недружественных стран: 0 – обычный расчетный код, 2 – расчетный код типа "Ин".
- В потоке FORTS_MM_REPL в таблице mm_agreement_filter добавлено поле:
 - program_code (c50) - Код программы
- В потоке FORTS_INFO_REPL в таблице option_series_params добавлено поле:
 - fixed_spot_discount_clr (f) - Сумма дисконтированных значений объявленных денежных потоков. CF, посчитанный на начало торгового дня T

- В потоке FORTS_RMT_REPL в таблице rmt_im добавлено поле:
 - rmt_premium (d26.2) - Накопленная по сделкам премия по премиальным опционам, подлежащая к уплате в ближайший Клиринг, в пересчете на рубли.

6.2. FAST

- В сообщении Security Definition (d):
 - Изменен ID шаблона сообщения с '40' на '47'
 - Удалены поля MaturityDate и MaturityTime
 - Добавлены поля:
 - HighLimitPxWeekend - Верхний лимит премии по опциону в дополнительной сессии выходного дня
 - LowLimitPxWeekend - Нижний лимит премии по опциону в дополнительной сессии выходного дня
 - ClearingSettlPrice - Расчетная цена предстоящей клиринговой сессии
- В сообщении Security Status (f):
 - Изменен ID шаблона сообщения с '5' на '48'
 - Добавлены поля:
 - HighLimitPxWeekend - Верхний лимит премии по опциону в дополнительной сессии выходного дня
 - LowLimitPxWeekend - Нижний лимит премии по опциону в дополнительной сессии выходного дня

6.3. SIMBA

- Версия схемы сообщений изменена с 8 на 9.
- В сообщении SecurityDefinition:
 - Идентификатор сообщения msg id изменен с 21 на 27
 - Удалены поля MaturityDate и MaturityTime
 - Добавлены поля:
 - HighLimitPxWeekend - Верхний лимит премии по опциону в дополнительной сессии выходного дня
 - LowLimitPxWeekend - Нижний лимит премии по опциону в дополнительной сессии выходного дня
 - ClearingSettlPrice - Расчетная цена предстоящей клиринговой сессии
- В сообщении SecurityStatus:
 - Идентификатор сообщения msg id изменен с 9 на 28
 - Добавлены поля:
 - HighLimitPxWeekend - Верхний лимит премии по опциону в дополнительной сессии выходного дня
 - LowLimitPxWeekend - Нижний лимит премии по опциону в дополнительной сессии выходного дня

7. Изменения в Терминале Срочного рынка

- В окна **Обязательства маркет-мейкера по опционам** и **Обязательства маркет-мейкера по фьючерсам** добавлен новый параметр:
 - **Программа** - Код программы
- В настройках фильтрации **Обязательства Маркет-мейкера по опционам** и **Обязательства Маркет-мейкера по фьючерсам** добавлен фильтр по коду программы
- В окно **Лимитирование** добавлен новый параметр:
 - **Премия - 6681-У** - Накопленная по сделкам премия по премиальным опционам, подлежащая к уплате в ближайший Клиринг, в пересчете на рубли. Не включает в себя финансовый результат исполнения позиции
- В окно **Средства по расчетным кодам** добавлен новый параметр:
 - **Признак Спец. РК** - Признак того, что расчетный код открыт для нерезидентов недружественных стран
- В окно **Лимитирование** добавлено новое значение поля Статус:
 - **Ин** - Признак того, что расчетный код открыт для нерезидентов недружественных стран
- В окна **Финансовые инструменты** и **Информация** добавлены новые параметры:
 - **Дата начала торгов** - Дата начала торгов инструментом
 - **Верхний лимит ДСВД** - Верхний лимит цены в ДСВД
 - **Нижний лимит ДСВД** - Нижний лимит цены в ДСВД

8. Изменения в отчетах

- Изменения в clientsXXYY.csv/clientsXX00.csv:
 - Добавлено поле spf (numeric(1)) - Признак специального расчетного кода для участников клиринга-нерезидентов и клиентом-нерезидентов участников клиринга недружественных стран: 0 - обычный РК, 2 - РК ИН

9. Изменения в интерфейсах, планируемые в будущих релизах

Напоминаем, что в интерфейсе CGATE в версии 9.9 планируются следующие изменения:

- Планируется удаление следующих устаревших полей:
 - FORTS_REFDATA_REPL:session:inter_cl_begin
 - FORTS_REFDATA_REPL:session:inter_cl_end
 - FORTS_REFDATA_REPL:session:inter_cl_state
 - FORTS_REFDATA_REPL:sess_option_series:step_price_interclr
 - FORTS_REFDATA_REPL:fut_sess_contents:step_price_interclr
 - FORTS_REFDATA_REPL:fut_instruments:step_price_interclr
 - FORTS_REFDATA_REPL:fut_exec_orders:xamount_apply
 - FORTS_REFDATA_REPL:opt_exp_orders:xamount_apply
 - FORTS_CLR_REPL:money_clearing:asset_type
 - FORTS_CLR_REPL:money_clearing_sa:asset_type
 - FORTS_CLR_REPL:money_clearing:pay
 - FORTS_CLR_REPL:money_clearing_sa:pay
 - FORTS_CLR_REPL:fut_pos:pos_exec

- FORTS_CLR_REPL:fut_pos_sa:pos_exec
 - FORTS_CLR_REPL:opt_pos:pos_exec
 - FORTS_CLR_REPL:opt_pos_sa:pos_exec
- Планируется удаление устаревшей таблицы
FORTS_REFDATA_REPL:fut_intercl_info
- Планируется удаление устаревшей таблицы
FORTS_REFDATA_REPL:opt_intercl_info