

Список изменений в версии 9.9

1.Исключение ГО и NOV из расчета money_free премиальных опционов

В системе реализована возможность упрощенного расчета свободных средств (money_free) премиальных опционов, исключив из него гарантийное обеспечение и NetOptionValue, с целью упрощения учета премиальных опционов в торговых системах Участников, сделав их более понятными для своих клиентов. Опция реализована путем включения на уровне клиента (на БФ и РК все остается, как и прежде) специального режима учета позиций по премиальным опционам. У 7сс в таком режиме для премиальных опционов перестает считаться ГО по позициям и заявкам и NOV, и запрещается открывать отрицательные позиции по премиальным опционам. Вместо ГО используется специальным образом вычисленная величина - "резерв под премию" (part:premium_blocked), которая будет содержать в себе накопленный финансовый результат дневного оборота премиальных опционов, резерв под заявки и валютный риск по заявкам/сделкам. Данный резерв учитывается в расчете свободных средств - при положительных значениях уменьшает свободный лимит и увеличивает его при отрицательных значениях.

Специальный режим учета позиций по премиальным опционам может устанавливаться для конкретного 7сс (признак включенного режима публикуется в шлюзе в поле investor:not_use_nov) или по всем 7сс БФ (публикуется в шлюзе в поле dealer:not_use_nov_client_default). Установка специального режима (применение) производится в клиринговую сессию. Специальный режим учета позиций по премиальным опционам может быть установлен у 7сс только при отсутствии у него отрицательных позиций по премиальным опционам и количество контрактов в заявках на продажу не превышает объем позиции. Управление (вкл/выкл) спецрежимом осуществляется с помощью новых шлюзовых команд ChangeClientNotUseNovMode и ChangeBFClientDefaultNotUseNovMode, а также в терминале Срочного рынка (Администрирование>Управление параметрами клиентов (БФ)>Спецрежим расчета свободных денег без ГО и NOV).

2. Добавление полей с компонентами вармаржи вечных фьючерсов в клиринговую реплику Plaza2

В поток FORTS_CLR_REPL в таблицы fut_pos и fut_pos_sa добавлено 3 новых поля, соответствующих компонентам вариационной маржи (vm) по вечным фьючерсам: vm_settle_price, vm_swap_rate, vm_index_div (по аналогии с клиринговым отчетом fpos).

3. Id удаляемой заявки при move – в таблицу orders_log

В потоке FORTS_TRADE_REPL в таблицу orders_log и в потоке FORTS_USERORDERBOOK_REPL в таблицу orders добавлено поле prevorder_id - Номер заявки, измененной в результате операции MoveOrder (то есть номер удаленной заявки).

4. Вечные фьючерсы на индексы с котировкой в валюте

Доработан механизм расчетов (расчетные цены и фандинг) по вечным фьючерсам с котировкой в валюте. В потоках и отчетах, в которых публикуется фандинг по вечным фьючерсам, добавлено новое поле `swap_rate_curr` – фандинг в валюте котировки (в пунктах).

5. Flood-control "по расписанию" в P2Proxy

Модифицирован механизм флуд-контроля с целью повышения порога срабатывания флуд-контроля в ночное время по неторговым операциям. Теперь ночью в период технического обслуживания ТС Спектра ограничения на количество разрешенных неторговых операций будет увеличиваться.

6. Добавление в шлюзовые данные даты клиринга и даты расчетов для требований/обязательств по позициям

В таблицы `fut_pos`, `fut_pos_sa`, `opt_pos`, `opt_pos_sa` добавляются поля:

- `date_money_clearing` тип `datetime (t)` – дата клиринга
- `settl_datetime` тип `datetime (t)` – дата расчетов

7. Сдвиг начала основной торговой сессии на 9:00 на Срочном рынке

На срочном рынке Московской биржи определено новое расписание торговых сессий:

- Для торговых дней:
 - 06:50–07:00 – Проводится аукцион открытия для всех контрактов, допущенных в Утреннюю сессию.
 - 07:00–09:00 – Утренняя торговая сессия.
 - 09:00 - 19:00 - Торги в рамках Основной торговой сессии.
 - 19:00 - 23:50 - Вечерняя дополнительная торговая сессия.
- Для торговых выходных дней:
 - 08:50 - 09:00 - Аукцион открытия перед Дополнительной сессией выходного дня.
 - 09:00 - 19:00 - Дополнительная сессия выходного дня.

8. Изменения в интерфейсах и API

8.1. CGATE

- В потоке `FORTS_TRADE_REPL` в таблицу `orders_log` добавлено новое поле:
 - `prevorder_id (i8)` - Номер заявки, измененной в результате операции `MoveOrder` (то есть номер удаленной заявки).

- В потоке FORTS_USERORDERBOOK_REPL в таблицу orders добавлено новое поле:
 - prevorder_id (i8) - Номер заявки, измененной в результате операции MoveOrder (то есть номер удаленной заявки).
- В потоке FORTS_COMMON_REPL в таблицу common добавлено новое поле:
 - swap_rate_curr (d16.5) - Текущий индикативный фандинг по инструменту (для ВФ). В пунктах.
- В потоке FORTS_PART_REPL в таблицу part добавлено новое поле:
 - premium_blocked (d26.2) - Резерв под премию. Содержит в себе накопленный финансовый результат дневного оборота премиальных опционов, резерв под заявки и валютный риск по заявкам/сделкам.
- В потоке FORTS_PART_REPL из таблиц part и part_sa удалены устаревшие поля vm_intercl и premium_intercl.
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблицу dealer добавлено новое поле:
 - not_use_nov_client_default (i4) - Дефолтное состояние использования специального режима учета премиальных опционов для клиентов БФ.
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL в таблицу investor добавлено новое поле:
 - not_use_nov (i4) - Состояние использования специального режима учета премиальных опционов (без учета ГО и NOV, с запретом на отрицательные позиции по премиальным опционам).
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL из таблицы session удалены устаревшие поля inter_cl_begin, inter_cl_end, inter_cl_state.
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL из таблицы sess_option_series удалено устаревшее поле step_price_interclr.
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL из таблицы fut_sess_conten удалено устаревшее поле step_price_interclr.
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL из таблицы fut_instruments удалено устаревшее поле step_price_interclr.
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL из таблицы fut_exec_orders удалено устаревшее поле xamount_apply.
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL из таблицы opt_exec_orders удалено устаревшее поле xamount_apply.
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL удалена устаревшая таблица fut_intercl_info.
- В потоке FORTS_REFDATA_REPL удалена устаревшая таблица opt_intercl_info.
- В потоке FORTS_CLR_REPL в таблицы fut_pos и fut_pos_sa добавлены новые поля:
 - vm_settl_price (d16.2) - Часть суммарной вариационной маржи, связанная с изменением расчетной цены, по итогам Клиринговой сессии для клиента/фирмы и инструмента.
 - vm_swap_rate (d16.2) - Часть суммарной вариационной маржи, связанная с фандингом (для вечных фьючерсов), по итогам Клиринговой сессии для клиента/фирмы и инструмента.
 - vm_index_div (d16.2) - Часть суммарной вариационной маржи, связанная с дивидендной поправкой (для вечных фьючерсов на индекс или акцию), по итогам Клиринговой сессии для клиента/фирмы и инструмента.

- В потоке FORTS_CLR_REPL в таблицы ut_pos, fut_pos_sa, opt_pos, opt_pos_sa добавлены новые поля:
- В потоке FORTS_CLR_REPL в таблицы fut_sess_settl добавлено поле:
 - swap_rate_curr (d16.5) – Фандинг при отклонении цены контракта от цены БА больше заданного на контракте уровня (для ВФ). В валюте котирования
 - date_money_clearing (t) – Дата клиринга.
 - settl_datetime (t) – Дата расчетов.
- В потоке FORTS_CLR_REPL из таблиц money_clearing и money_clearing_sa удалены устаревшие поля asset_type и pay.
- В потоке FORTS_CLR_REPL из таблиц fut_pos, fut_pos_sa, opt_pos и opt_pos_sa удалено устаревшее поле pos_exes.
- В потоке FORTS_VM_REPL в таблицы fut_vm и fut_vm_sa добавлено новое поле:
 - swap_rate_curr (d16.5) - Индикативный фандинг по текущей клиентской позиции (для вечных фьючерсов). В пунктах.
- В потоке FORTS_INFO_REPL в таблицу dealer добавлено новое поле:
 - not_use_nov_client_default (i4) - Дефолтное состояние использования специального режима учета премиальных опционов для клиентов БФ.
- В потоке FORTS_INFO_REPL в таблицу investor добавлено новое поле:
 - not_use_nov (i4) - Состояние использования специального режима учета премиальных опционов (без учета ГО и NOV, с запретом на отрицательные позиции по премиальным опционам).
- Изменения в репозитории схем подачи команд:
 - Добавлена новая команда ChangeClientNotUseNOVMode (msgid=479) - Изменение специального режима маржирования премиальных опционов для клиента.
 - Добавлена новая команда ChangeBFClientDefaultNotUseNOVMode (msgid=480) - Изменение специального режима маржирования премиальных опционов для клиентов БФ.

8.2. FAST

- В сообщениях Market Data - Snapshot / Full Refresh (W) и Market Data - Incremental Refresh (X) изменения для поля MDEntryType:
 - добавлено новое значение 'q' - Текущий индикативный фандинг по инструменту (для однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией). В пунктах.
 - добавлено новое значение 'r' - Фандинг при отклонении цены контракта от цены БА больше заданного на контракте уровня (для однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией). В пунктах.

9. Изменения в Терминале Срочного рынка

- В окно **Лимитирование** добавлены новые параметры:
 - **Резерв под премию** - Накопленный финансовый результат дневного оборота премиальных опционов, резерв под заявки и валютный риск по заявкам/сделкам.

- **Ставка фонд. в пунктах** - Текущая ставка за перенос позиции по ВФ в следующую торговую сессию в пунктах
- В окна **Позиции/поручения**, **Позиции по РК** и **Средства по расчетным кодам** добавлен новый параметр::
 - **Ставка фонд. в пунктах** - Текущая ставка за перенос позиции по ВФ в следующую торговую сессию в пунктах
- В окно **Финансовые инструменты** добавлены новые параметры:
 - **Ставка фонд. в пунктах** - Индикативная ставка фондирования (для ВФ) в пунктах.
 - **Ставка фонд. пред. в пунктах** - Ставка фондирования в ВК предыдущей сессии (для ВФ) в пунктах.
- В окно **Деньги** добавлен новый параметр:
 - **Резерв под премию** - Накопленный финансовый результат дневного оборота премиальных опционов, резерв под заявки и валютный риск по заявкам/сделкам.
- Изменения в окне **Управление параметрами БФ**:
 - на панель инструментов добавлена новая кнопка: - Изменить спецрежим расчета свободных денег без ГО и NOV для клиентов БФ
 - одноименная команда добавлена в контекстное меню
 - добавлен новый параметр: **Спецрежим** - Спецрежим расчета свободных денег без ГО и NOV, с запретом на отрицательные позиции по премиальным опционам для клиентов по умолчанию.
- Изменения в окне **Управление параметрами клингов**:
 - на панель инструментов добавлена новая кнопка: - Изменить спецрежим расчета свободных денег без ГО и NOV для клиентов БФ
 - одноименная команда добавлена в контекстное меню
 - добавлен новый параметр: **Спецрежим** - Спецрежим расчета свободных денег без ГО и NOV, с запретом на отрицательные позиции по премиальным опционам.

10. Изменения в отчетах

- Изменения в clientsXXYY.csv/clientsXX00.csv:
 - Добавлено поле not_use_nov (smallint) - Состояние использования специального режима учета премиальных опционов (без учета ГО и NOV, с запретом на отрицательные позиции по премиальным опционам) -1 - "как у БФ" (наследуется от dealer.not_use_nov_client_default), 0 - стандартный способ учета опционов, 1 - спецрежим.
- Изменения в f4_XXYY.csv/ f04clXXYYZZZ.csv::
 - Добавлено поле var_marg_b_swap_rate_curr (numeric(16,2)) - Составляющая часть обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи, связанная со ставкой обеспечения при отклонении цены по однодневному фьючерсному контракту с автопролонгацией от цены базового актива больше заданного на уровне однодневного фьючерсного контракта с автопролонгацией (в пунктах).

- Добавлено поле var_marg_s_swap_rate_curr (numeric(16,2)) - Составляющая часть обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи, связанная со ставкой обеспечения при отклонении цены по однодневному фьючерсному контракту с автопролонгацией от цены базового актива больше заданного на уровне однодневного фьючерсного контракта с автопролонгацией (в пунктах).
- Изменения в f4_trade_XXYY.csv/ f04cl_trade_XXYYZZZ.csv:
 - Добавлено поле var_marg_b_swap_rate_curr (numeric(16,2)) - Составляющая часть обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи, связанная со ставкой обеспечения при отклонении цены по однодневному фьючерсному контракту с автопролонгацией от цены базового актива больше заданного на уровне однодневного фьючерсного контракта с автопролонгацией (в пунктах).
 - Добавлено поле var_marg_s_swap_rate_curr (numeric(16,2)) - Составляющая часть обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи, связанная со ставкой обеспечения при отклонении цены по однодневному фьючерсному контракту с автопролонгацией от цены базового актива больше заданного на уровне однодневного фьючерсного контракта с автопролонгацией (в пунктах).
- Изменения в f07.csv:
 - Добавлено swap_rate_curr (numeric(16,2)) - Ставка обеспечения при отклонении цены фьючерсного контракта от цены базового актива больше заданного на уровне фьючерсного контракта (в пунктах). Определяется в соответствии со спецификации контракта.
- Изменения в fposXXYY.csv/ fposcl_XXYYZZZ.csv:
 - Добавлено поле var_marg_p_swap_rate_curr (numeric(16,2)) - Составляющая часть, связанная со ставкой обеспечения при отклонении цены по однодневному фьючерсному контракту с автопролонгацией от цены базового актива больше заданного на уровне однодневного фьючерсного контракта с автопролонгацией, ариационной маржи по Сделкам, обязательства по которым не прекращены на начало отчетно го дня (в пунктах).
 - Добавлено поле var_marg_d_swap_rate_curr (numeric(16,2)) - Составляющая часть, связанная с изменением Расчетной цены по фьючерсному контракту, Вариационной маржи по Сделкам, заключенным в течение отчетного дня (в пунктах).

11. Изменения в интерфейсах, планируемые в будущих релизах

Напоминаем, что в интерфейсе CGATE в версии 9.12 планируются следующие изменения:

- Планируется удаление следующих устаревших полей:
 - FORTS_COMMON_REPL:common:settlement_price_open
 - FORTS_REFDATA_REPL:fut_sess_contents:settlement_price_open
 - FORTS_REFDATA_REPL:fut_instruments:settlement_price_open
 - FORTS_REFDATA_REPL:opt_sess_contents:settlement_price_open

- FORTS_REFDATA_REPL:fut_sess_contents:ticker

Release Notes – Version 9.9

1. Excluding Initial Margin and NOV from the Free Cash Calculation for Premium Options

The system now supports a simplified calculation of Free Cash (money_free) for Premium Options, excluding Initial Margin and NetOptionValue (NOV). This enhancement is intended to simplify the accounting of Premium Options in Trading Members' trading systems and make it more transparent for their clients. The feature is implemented by enabling a special Premium Option position accounting mode at the client level (the accounting method for the Brokerage Firm and Settlement Account remains unchanged). When this mode is enabled, Initial Margin for Premium Option positions and orders, as well as NOV, are no longer calculated, and opening negative Premium Option positions is prohibited. Instead of Initial Margin, a specially calculated value called the Premium Reserve (part:premium_blocked) is used. It includes the accumulated financial result of the current day's Premium Option trading, the reserve for orders, and the foreign exchange risk associated with orders and trades. This reserve is taken into account when calculating Free Cash: positive values reduce the available limit, while negative values increase it.

The special Premium Option position accounting mode may be enabled either for an individual Settlement Account (the enabled status is published in the Gateway in the investor:not_use_nov field) or for all Settlement Accounts of a Brokerage Firm (the default status is published in the Gateway in the dealer:not_use_nov_client_default field). The special mode is applied during the Clearing Session. It may be enabled for a Settlement Account only if there are no negative Premium Option positions and the number of contracts in sell orders does not exceed the current position size. The special mode is enabled or disabled using the new Gateway commands ChangeClientNotUseNovMode and ChangeBFClientDefaultNotUseNovMode, or through the Derivatives Market Terminal (Administration → Client (Brokerage Firm) Parameter Management → Special Free Cash Calculation Mode without Initial Margin and NOV).

2. Adding Variation Margin Components for Perpetual Futures to the Plaza II Clearing Replication

Three new fields corresponding to the Variation Margin (VM) components for Perpetual Futures have been added to the fut_pos and fut_pos_sa tables in the FORTS_CLR_REPL stream: vm_settle_price, vm_swap_rate, and vm_index_div (consistent with the fpos clearing report).

3. ID of the Deleted Order Added to the orders_log Table

The prevorder_id field has been added to the orders_log table in the FORTS_TRADE_REPL stream and to the orders table in the FORTS_USERORDERBOOK_REPL stream. The field contains the ID of the order modified by the MoveOrder operation (that is, the ID of the deleted order).

4. Perpetual Futures on Indices Quoted in a Foreign Currency

The settlement mechanism (Settlement Prices and Funding) for Perpetual Futures quoted in a foreign currency has been enhanced. A new field, `swap_rate_curr`, has been added to the streams and reports that publish Funding information for Perpetual Futures. The field contains the Funding value in the quotation currency (in points).

5. Scheduled Flood Control in P2Proxy

The flood control mechanism has been modified to increase the flood control threshold for non-trading operations during nighttime hours. During the overnight maintenance period of the SPECTRA Trading System, the limit on the number of permitted non-trading operations will now be increased.

6. Adding the Clearing Date and Settlement Date to Gateway Data for Position Receivables and Payables

The following fields are added to the `fut_pos`, `fut_pos_sa`, `opt_pos`, and `opt_pos_sa` tables:

- `date_money_clearing` of type `datetime (t)` – Clearing Date
- `settl_datetime` of type `datetime (t)` – Settlement Date

7. Main Trading Session Start Time Changed to 09:00 on the Derivatives Market

A new trading session schedule has been introduced for the Moscow Exchange Derivatives Market:

- For trading days:
 - 06:50–07:00 — Opening Auction for all contracts admitted to the Morning Trading Session.
 - 07:00–09:00 — Morning Trading Session.
 - 09:00–19:00 — Trading during the Main Trading Session.
 - 19:00–23:50 — Additional Evening Trading Session.
- For weekend trading days:
 - 08:50–09:00 — Opening Auction before the Weekend Additional Trading Session.
 - 09:00–19:00 — Weekend Additional Trading Session.

8. Changes to Interfaces and APIs

8.1. CGATE

- The following field has been added to the `orders_log` table in the `FORTS_TRADE_REPL` stream:
 - `prevorder_id (i8)` — ID of the order modified by the `MoveOrder` operation (that is, the ID of the deleted order).

- The following field has been added to the orders table in the FORTS_USERORDERBOOK_REPL stream:
 - prevorder_id (i8) — ID of the order modified by the MoveOrder operation (that is, the ID of the deleted order).
- The following field has been added to the common table in the FORTS_COMMON_REPL stream:
 - swap_rate_curr (d16.5) — Current indicative Funding for the instrument (for Perpetual Futures), in points.
- The following field has been added to the part table in the FORTS_PART_REPL stream:
 - premium_blocked (d26.2) — Premium Reserve. Contains the accumulated financial result of the current day's Premium Option trading, the reserve for orders, and the foreign exchange risk associated with orders and trades.
- The following field has been added to the dealer table in the FORTS_REFDATA_REPL stream:
 - not_use_nov_client_default (i4) — Default status of the special Premium Option accounting mode for Brokerage Firm clients.
- The following field has been added to the investor table in the FORTS_REFDATA_REPL stream:
 - not_use_nov (i4) — Status of the special Premium Option accounting mode (without Initial Margin and NOV, with negative Premium Option positions prohibited).
- The deprecated fields inter_cl_begin, inter_cl_end, and inter_cl_state have been removed from the session table in the FORTS_REFDATA_REPL stream.
- The deprecated field step_price_interclr has been removed from the sess_option_series table in the FORTS_REFDATA_REPL stream.
- The deprecated field step_price_interclr has been removed from the fut_sess_contents table in the FORTS_REFDATA_REPL stream.
- The deprecated field step_price_interclr has been removed from the fut_instruments table in the FORTS_REFDATA_REPL stream.
- The deprecated field xamount_apply has been removed from the fut_exec_orders table in the FORTS_REFDATA_REPL stream.
- The deprecated field xamount_apply has been removed from the opt_exec_orders table in the FORTS_REFDATA_REPL stream.
- The deprecated fut_intercl_info table has been removed from the FORTS_REFDATA_REPL stream.
- The deprecated opt_intercl_info table has been removed from the FORTS_REFDATA_REPL stream.
- The following new fields have been added to the fut_pos and fut_pos_sa tables in the FORTS_CLR_REPL stream:
 - vm_settl_price (d16.2) — Portion of the total Variation Margin associated with the change in the Settlement Price, calculated for the client/firm and instrument based on the results of the Clearing Session.
 - vm_swap_rate (d16.2) — Portion of the total Variation Margin associated with Funding (for Perpetual Futures), calculated for the client/firm and instrument based on the results of the Clearing Session.

- `vm_index_div` (d16.2) — Portion of the total Variation Margin associated with dividend adjustments (for Perpetual Futures on an index or equity), calculated for the client/firm and instrument based on the results of the Clearing Session.
- The following new field has been added to the `fut_sess_settl` table in the `FORTS_CLR_REPL` stream:
 - `swap_rate_curr` (d16.5) — Current indicative Funding for the instrument (for one-day futures contracts with automatic rollover), in the quotation currency (in points).
- The following new fields have been added to the `fut_pos`, `fut_pos_sa`, `opt_pos`, and `opt_pos_sa` tables in the `FORTS_CLR_REPL` stream:
 - `date_money_clearing` (t) — Clearing Date.
 - `settl_datetime` (t) — Settlement Date.
- The deprecated fields `asset_type` and `pay` have been removed from the `money_clearing` and `money_clearing_sa` tables in the `FORTS_CLR_REPL` stream.
- The deprecated field `pos_exec` has been removed from the `fut_pos`, `fut_pos_sa`, `opt_pos`, and `opt_pos_sa` tables in the `FORTS_CLR_REPL` stream.
- The following field has been added to the `fut_vm` and `fut_vm_sa` tables in the `FORTS_VM_REPL` stream:
 - `swap_rate_curr` (d16.5) — Indicative Funding for the current client position (for Perpetual Futures), in points.
 - The following field has been added to the dealer table in the `FORTS_INFO_REPL` stream:
 - `not_use_nov_client_default` (i4) — Default status of the special Premium Option accounting mode for Brokerage Firm clients.
- The following field has been added to the `investor` table in the `FORTS_INFO_REPL` stream:
 - `not_use_nov` (i4) — Status of the special Premium Option accounting mode (without Initial Margin and NOV, with negative Premium Option positions prohibited).
- Changes to the command schema repository:
 - Added the new `ChangeClientNotUseNOVMode` command (msgid=479) — Changes the special margining mode for Premium Options for a client.
 - Added the new `ChangeBFClientDefaultNotUseNOVMode` command (msgid=480) — Changes the default special margining mode for Premium Options for Brokerage Firm clients.

8.2. FAST

- In the Market Data - Snapshot / Full Refresh (W) and Market Data - Incremental Refresh (X) messages, the following changes have been made to the `MDEntryType` field:
 - A new value, 'q', has been added — Current indicative Funding for the instrument (for one-day futures contracts with automatic rollover), in points.
 - A new value, 'r', has been added — Funding applied when the price of the contract deviates from the price of the Underlying Asset by more than the threshold specified for the contract (for one-day futures contracts with automatic rollover), in points.

9. Changes to the Derivatives Market Terminal

- The following new parameters have been added to the **Limits** window:
 - **Premium Reserve** — Accumulated financial result of the current day's Premium Option trading, the reserve for orders, and the foreign exchange risk associated with orders and trades.
 - **Indicative funding rate in points** — Current Funding rate for carrying a Perpetual Futures position to the next trading session, in points.
- The following new parameter has been added to the **Positions/Requests**, **Positions by Settlement Accounts**, and **Settlement account assets** windows:
 - **Indicative funding rate in points** — Current Funding rate for carrying a Perpetual Futures position to the next trading session, in points.
- The following new parameters have been added to the **Financial Instruments** window:
 - **Indicative funding rate in points** — Indicative Funding rate (for Perpetual Futures), in points.
 - **Funding rate prev. in points** — Funding rate during the previous Clearing Session (for Perpetual Futures), in points.
- The following new parameter has been added to the **Money** window:
 - **Premium Reserve** — Accumulated financial result of the current day's Premium Option trading, the reserve for orders, and the foreign exchange risk associated with orders and trades.
- Changes to the **Manage BF parameters** window:
 - A new toolbar button has been added — Modify special mode for calculating free cash without Initial margin and NOV for clients of the Brokerage Firm.
 - The corresponding command has been added to the context menu.
 - A new parameter has been added: **Special Mode** — Special mode for calculating free cash without Initial margin and NOV, with a prohibition of naked position in premium option.
- Changes to the **Manage client parameters** window:
 - A new toolbar button has been added — Modify special mode for calculating free cash without Initial margin and NOV for clients of the Brokerage Firm.
 - The corresponding command has been added to the context menu.
 - A new parameter has been added: **Special Mode** — Special mode for calculating free cash without Initial margin and NOV, with a prohibition of naked position in premium option.

10. Changes to Reports

- Changes to clientsXXYY.csv / clientsXX00.csv:
 - The not_use_nov (smallint) field has been added — Status of the special Premium Option accounting mode (without Initial Margin and NOV, with negative Premium Option positions prohibited):
 - -1 — Same as the Brokerage Firm setting (inherits the value of dealer.not_use_nov_client_default);
 - 0 — Standard Premium Option accounting mode;
 - 1 — Special mode.

- Changes to f4_XXYY.csv / f04clXXYYZZZ.csv:
 - The var_marg_b_swap_rate_curr (numeric(16,2)) field has been added — Buyer's Variation Margin component associated with the Funding rate applied when the price of a one-day futures contract with automatic rollover deviates from the price of the Underlying Asset by more than the threshold specified for the contract (in points).
 - The var_marg_s_swap_rate_curr (numeric(16,2)) field has been added — Seller's Variation Margin component associated with the Funding rate applied when the price of a one-day futures contract with automatic rollover deviates from the price of the Underlying Asset by more than the threshold specified for the contract (in points).
- Changes to f4_trade_XXYY.csv / f04cl_trade_XXYYZZZ.csv:
 - The var_marg_b_swap_rate_curr (numeric(16,2)) field has been added — Buyer's Variation Margin component associated with the Funding rate applied when the price of a one-day futures contract with automatic rollover deviates from the price of the Underlying Asset by more than the threshold specified for the contract (in points).
 - The var_marg_s_swap_rate_curr (numeric(16,2)) field has been added — Seller's Variation Margin component associated with the Funding rate applied when the price of a one-day futures contract with automatic rollover deviates from the price of the Underlying Asset by more than the threshold specified for the contract (in points).
- Changes to f07.csv:
 - The swap_rate_curr (numeric(16,2)) field has been added — Funding rate applied when the price of a futures contract deviates from the price of the Underlying Asset by more than the threshold specified for the futures contract (in points). The value is determined in accordance with the contract specification.
- Changes to fposXXYY.csv / fposclXXYYZZZ.csv:
 - The var_marg_p_swap_rate_curr (numeric(16,2)) field has been added — Variation Margin component associated with the Funding rate applied when the price of a one-day futures contract with automatic rollover deviates from the price of the Underlying Asset by more than the threshold specified for the one-day futures contract with automatic rollover. This component relates to the Variation Margin for trades whose obligations had not been terminated as of the beginning of the reporting day (in points).
- The var_marg_d_swap_rate_curr (numeric(16,2)) field has been added — Variation Margin component associated with changes in the Settlement Price for futures contracts, relating to the Variation Margin for trades executed during the reporting day (in points).

11. Interface Changes Planned for Future Releases

Please note that the following changes are planned for the CGATE interface in version 9.12:

- The following deprecated fields are planned to be removed:
 - FORTS_COMMON_REPL:common:settlement_price_open
 - FORTS_REFDATA_REPL:fut_sess_contents:settlement_price_open
 - FORTS_REFDATA_REPL:fut_instruments:settlement_price_open
 - FORTS_REFDATA_REPL:opt_sess_contents:settlement_price_open
 - FORTS_REFDATA_REPL:fut_sess_contents:ticker