Плановые изменения систем фондового и валютного рынков 30 ноября 2026 года

Оглавление

ФОНДОВЫЙ РЫНОК 3
Дополнительные рыночные индивидуальные риск-параметры 3
Новый тарифный план по РЕПО для Управляющих компаний 3
Пересмотр ограничений на отклонение цен в заявках на рынке облигаций 4
Новая версия шлюзового интерфейса Broker60 и BrokerRisk60 4
Изменения в бинарном протоколе SIMBA — новая схема сообщений 5
Изменения в отчётах по итогам торгов на фондовом рынке 5
Изменения в отчётах по итогам клиринга на фондовом рынке 5
Обновление терминала MOEX Trade SE 5
Новые сообщения и ошибки 6
ВАЛЮТНЫЙ РЫНОК 7
Дополнительные рыночные индивидуальные риск-параметры 7
Изменение времени торгов по валютным инструментам TOD и инструментам своп TODTOM 8
Возобновление возможности заключения внебиржевых сделок инструментами валютной пары USDRUB с мелкими лотами в режиме OTCM 8
Новая версия шлюзового интерфейса Broker60 и BrokerRisk60 9
Изменения в бинарном протоколе SIMBA — новая схема сообщений 9
Изменения в отчётах по итогам торгов и клиринга на валютном рынке 9
Обновление терминала MOEX Trade Currency 9
Planned changes in the Securities and FX market systems 10
SECURITIES MARKET 10
Additional market individual risk parameters 10
New REPO tariff plan for Asset Management Companies 10
Revision of price deviation limits for orders on the Bond Market 11
New versions of ASTS Bridge broker interface - Broker60 and BrokerRisk60 11
Changes in the SIMBA protocol: updated message schema 12
Changes in trading reports on the Securities market 12
Changes in clearing reports on the Securities market 12
MOEX Trade SE terminal update 12
New System Messages and Error Codes 13
FX MARKET 14

Additional market individual risk parameters 14
Change in trading hours for TOD currency instruments and TODTOM swap instruments 14
Resumption of the ability to execute over-the-counter trades in USDRUB currency pair instruments with small lots in the OTCM mode 15
New versions of ASTS Bridge broker interface - Broker60 and BrokerRisk60..... 16
Changes in the SIMBA protocol: updated message schema 16
Changes in trading and clearing reports on the FX market..... 16
MOEX Trade Currency terminal update 16

ФОНДОВЫЙ РЫНОК

Дополнительные рыночные индивидуальные риск-параметры

Вводятся дополнительные рыночные индивидуальные риск-параметры, которые применяются к ставкам рыночного риска падения и роста цены на активы:

- «Надбавка/дисконт к ставке риска падения цены»;
- «Надбавка/дисконт к ставке риска роста цены».

Новые параметры учитываются при расчёте границ диапазона оценки рыночных рисков.

Участник клиринга может самостоятельно устанавливать значения надбавки или дисконта к ставкам риска через терминал или шлюз по ТКС 2-го и 3-го уровней. Значения задаются в процентах в диапазоне от −100 до 100 % с точностью до двух знаков после запятой.

Рыночные индивидуальные риск-параметры «Надбавка/дисконт к ставке риска» учитываются при формировании клирингового отчёта об оценке обеспечения (EQM84) в показателях оценочной стоимости и стоимости обеспечения.

Изменение учёта риска связанности Участников с эмитентами ценных бумаг

С 1 января 2027 Клиринговый центр будет устанавливать рыночные индивидуальные риск-параметры «Надбавка/дисконт к ставке риска» для ценных бумаг, учитываемых на клиентских счетах и счетах доверительного управления первого уровня Участников клиринга, аффилированных с эмитентами этих ценных бумаг.

Изменение связано с вступлением в силу Положения Банка России от 01.11.2018 № 658-П.

Изменения в интерфейсе

1. В транзакцию SET_RM_TRDACC_PRICERANGE добавляются поля:
    - MARKUP_L — Надбавка к ставке риска падения цены, %;
    - MARKUP_H — Надбавка к ставке риска роста цены, %.
2. В таблицу RM_TRDACC_PRICERANGE добавляются поля:
    - MARKUP_L — Надбавка к ставке риска падения цены, %;
    - MARKUP_H — Надбавка к ставке риска роста цены, %.

Новый тарифный план по РЕПО для Управляющих компаний

Для управляющих компаний вводится новая категория участников торгов «У». Участники новой категории могут выбирать тарифный план REPO_CI в дополнение к действующим тарифным планам REPO_0, REPO_150, REPO_500, REPO_6500, REPO_16250 и REPO_32500.

В первый торговый день каждого календарного месяца участнику категории «У» направляется новый отчёт SEM27 о выполнении условия по итогам предыдущего календарного месяца. Отчёт формируется независимо от выбранного тарифного плана.

Пересмотр ограничений на отклонение цен в заявках на рынке облигаций

Изменяются допустимые отклонения цены исполнения для рыночных и лимитных заявок по облигациям.

Базовой ценой для расчёта допустимого отклонения является лучшая встречная цена на момент подачи заявки:

- для заявки на покупку — минимальная цена продажи;
- для заявки на продажу — минимальная цена покупки.

Рыночные заявки по облигациям

Для купонных облигаций Банка России (КОБР) и облигаций федерального займа (ОФЗ) допустимое отклонение для рыночных заявок не меняется — 0,4 % от базовой цены. Для остальных облигаций допустимое отклонение уменьшится с 1 до 0,8 % от базовой цены.

Рыночная заявка исполняется по встречным заявкам, если цена потенциальной сделки находится в пределах указанного отклонения. Неисполненный остаток заявки снимается.

Лимитные заявки по облигациям

Для лимитных заявок по облигациям вводится допустимое отклонение — 5 % от базовой цены. Правило применяется ко всем облигациям: КОБР, ОФЗ и остальным.

Если цена очередной потенциальной сделки выходит за пределы допустимого отклонения, то заявка снимается в размере остатка. Если заявка имеет дополнительные признаки по остатку, то ограничения применяются следующим образом:

- «Полностью или отклонить» — заявка снимается;
- «Снять остаток» — неисполненный остаток снимается;
- «Поставить в очередь» — заявка исполняется только в пределах допустимого отклонения. Неисполненный остаток:
  - ставится в очередь по цене, определяемой выбранными в заявке условиями исполнения, если цена заявки находится в пределах допустимого отклонения и доступный объём встречных заявок в пределах допустимого отклонения недостаточен для полного исполнения;
  - снимается, если цена заявки выходит за пределы допустимого отклонения.

Ограничения не применяются в аукционах открытия и закрытия.

Новая версия шлюзового интерфейса Broker60 и BrokerRisk60

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.

1. В транзакцию SET_RM_TRDACC_PRICERANGE добавляются поля:
    - MARKUP_L — Надбавка к ставке риска падения цены, %;
    - MARKUP_H — Надбавка к ставке риска роста цены, %.
2. В таблицу RM_TRDACC_PRICERANGE добавляются поля:
    - MARKUP_L — Надбавка к ставке риска падения цены, %;
    - MARKUP_H — Надбавка к ставке риска роста цены, %.

Изменения в бинарном протоколе SIMBA — новая схема сообщений

ОБРАЩАЕМ ВАШЕ ВНИМАНИЕ, что изменения в протоколе SIMBA для фондового и валютного рынков не сохраняют обратной совместимости и требуют доработок на стороне клиентского ПО.

В сообщении SecurityDefinition тип поля LotDivider будет изменён с uInt16 на uInt32.

Обновлённая схема сообщений sbe_asts_md доступна на ftp-сервере Биржи: https://ftp.moex.com/pub/SIMBA/ASTS/schemas/release28_11_2026/.

Изменения в отчётах по итогам торгов на фондовом рынке

Добавляется новый отчёт SEM27 «Выполнение условия тарифного плана REPO_CI».

Изменения в отчётах по итогам клиринга на фондовом рынке

В отчёте EQM99 (Отчёт об обеспечении) меняется логика заполнения атрибута OperationTime (Время операции / время исполнения) при отражении операций выдачи/погашения КСУ (т. е. операций с кодом 22 и 23): при выпуске КСУ и заключении сделки РЕПО с ЦК за счёт этих КСУ в тот же день значение атрибута OperationTime (Время операции / время исполнения) в отчёте EQM99 по выпуску КСУ не будет превышать значение атрибута ReportTime (Время исполнения) в отчёте EQM06 «Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг» (EQM06/EQM06P/EQM06R).

Для остальных операций логика заполнения не меняется.

Обновление терминала MOEX Trade SE

В дату релиза планируется выпустить обновление терминала MOEX Trade SE до версии 3.26.40.

Всем пользователям будет предложено установить автоматическое обновление при подключении к торгово-клиринговой системе. Дистрибутивы для ручной установки будут доступны на FTP-сервере с 27 ноября: https://ftp.moex.com/pub/Terminals/ASTS/Equities.

Новые сообщения и ошибки

В дату релиза добавляются новые сообщения от торговой системы:

Код	Текст сообщения
В дополнение к сообщению 492 (Недопустимый перевод)	
1372	Перевод ценных бумаг с участием ТКС %12.12s разрешён только с указанием собственного ТКС
1373	Перевод ценных бумаг с участием ТКС %12.12s невозможен (в составе ТКС нет депозитарного счёта)
1375	Переводы между счетами первого уровня недоступны в выходные дни
1381	Переводы внутри одного торгово-клирингового счёта не разрешены
1382	Переводы между счетами первого уровня недоступны в ходе вечерней сессии
1383	Переводы между счетами с денежными позициями в разных расчётных организациях не разрешены в ходе вечерней сессии
1384	Переводы между двумя счетами имущественных пулов не разрешены
1385	Перевод ценных бумаг невозможен (владельцы депозитарных счетов ТКС списания и ТКС зачисления не совпадают)
1386	Перевод с участием ТКС, не являющегося ТКС Т+, не разрешён в ходе вечерней сессии
В дополнение к сообщению 703	
1388	Дата активации превышает дату аукциона по ценной бумаге
1389	Дата предактивации превышает дату аукциона по ценной бумаге
1390	Дата предактивации превышает дату активации по ценной бумаге
В дополнение к сообщению 617 (Невозможно принять заявку)	
1392	Невозможно принять заявку. Неверно указана ставка
1393	Невозможно принять заявку. Неверно указан дисконт
1394	Невозможно принять заявку. Неверно указан нижний предел дисконта
1395	Невозможно принять заявку. Неверно указан верхний предел дисконта
В дополнение к сообщению 533 (Неверно указан код клиента)	
1396	Указанный код клиента неактивен
1397	Код клиента в заявке на изъятие должен совпадать с кодом клиента в депозите
1398	Указанный код клиента не разрешен для данного SMA пользователя

ВАЛЮТНЫЙ РЫНОК

Дополнительные рыночные индивидуальные риск-параметры

Вводятся дополнительные рыночные индивидуальные риск-параметры, которые применяются к ставкам рыночного риска падения и роста цены на активы:

- «Надбавка/дисконт к ставке риска падения цены»;
- «Надбавка/дисконт к ставке риска роста цены».

Новые параметры учитываются при расчёте границ диапазона оценки рыночных рисков.

Участник клиринга может самостоятельно устанавливать значения надбавки или дисконта к ставкам риска через терминал или шлюз по ТКС 2-го и 3-го уровней. Значения задаются в процентах в диапазоне от −100 до 100 % с точностью до двух знаков после запятой.

Рыночные индивидуальные риск-параметры «Надбавка/дисконт к ставке риска» учитываются при формировании клирингового отчёта об оценке обеспечения (EQM84) в показателях оценочной стоимости и стоимости обеспечения.

Изменение учёта риска связанности Участников с эмитентами ценных бумаг

С 1 января 2027 Клиринговый центр будет устанавливать рыночные индивидуальные риск-параметры «Надбавка/дисконт к ставке риска» для ценных бумаг, учитываемых на клиентских счетах и счетах доверительного управления первого уровня Участников клиринга, аффилированных с эмитентами этих ценных бумаг.

Изменение связано с вступлением в силу Положения Банка России от 01.11.2018 № 658-П.

Изменения в интерфейсе

1. В транзакцию SET_RM_TRDACC_PRICERANGE добавляются поля:
    - MARKUP_L — Надбавка к ставке риска падения цены, %;
    - MARKUP_H — Надбавка к ставке риска роста цены, %.
2. В таблицу RM_TRDACC_PRICERANGE добавляются поля:
    - MARKUP_L — Надбавка к ставке риска падения цены, %;
    - MARKUP_H — Надбавка к ставке риска роста цены, %.

Изменение времени торгов по валютным инструментам TOD и инструментам своп TODTOM

В системном режиме торгов (борд CETS) увеличивается время торгов:

- по валютным инструментам TOD — до 18:45;
- по инструментам своп TODTOM рынка драгоценных металлов и валютного рынка — до 19:00.

Сделки, заключённые в 18:00–19:00, включаются в «Выписку из реестра сделок» (CUX23).

Для валютных инструментов TOD в системном режиме торгов период возможного начала аукциона обновления цен расширяется до 18:34:30.

Возобновление возможности заключения внебиржевых сделок инструментами валютной пары USDRUB с мелкими лотами в режиме ОТСМ

Возобновляется заключение внебиржевых сделок в режиме ОТСМ по беспоставочным СПОТ инструментам USDRUB_TMS и USDRUB_STS с мелкими лотами со следующими параметрами:

Параметр	USDRUB_TMS	USDRUB_STS
Валюта лота	USD	USD
Сопряжённая валюта	RUB	RUB
Дата валютирования	T+1	T+2
Лот заявки, ед. валюты лота	0,01	0,01
Минимальный размер заявки, ед. валюты лота	1	1
Максимальный размер заявки, ед. валюты лота	999,99	999,99
Котировка за кол-во валюты лота	1 доллар США	1 доллар США
Шаг цены заявки	0,0001	0,0001
Точность цены	до 4-го знака после запятой	до 4-го знака после запятой

Время заключения сделок — 09:00–19:00.

К заключению сделок по USDRUB в режиме ОТСМ допускаются участники клиринга категорий О, Б и Б2, допущенные к сделкам с частичным обеспечением, которые предоставили заявление (согласие) на допуск к беспоставочным инструментам с особым режимом поставки с переносом и согласие на заключение сделок своп для автоматического переноса позиций. Доступ к инструментам не предоставляется участникам, установившим ограничения по инструментам и режиму на торговых идентификаторах.

Сделки в режиме ОТСМ не включаются в бюллетень.

Изменения в отчёте CUX83

Информация о внебиржевых сделках в режиме ОТСМ отражается в клиринговых отчётах в стандартном порядке.

В отчёт о полномочиях идентификаторов участника торгов на валютном рынке (CUX83) добавляется новый атрибут:

- OtsMUserType — Тип идентификатора для внебиржевых сделок в режиме «OTC: внебиржевой стакан»:
  - 1 — в качестве наблюдателей;
  - 2 — в качестве наблюдателей и на заключение внебиржевых сделок;
  - 3 — закрыть режим.

Новая версия шлюзового интерфейса Broker60 и BrokerRisk60

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.

1. В транзакцию SET_RM_TRDACC_PRICERANGE добавляются поля:
   - MARKUP_L — Надбавка к ставке риска падения цены, %;
   - MARKUP_H — Надбавка к ставке риска роста цены, %.
2. В таблицу RM_TRDACC_PRICERANGE добавляются поля:
   - MARKUP_L — Надбавка к ставке риска падения цены, %;
   - MARKUP_H — Надбавка к ставке риска роста цены, %.

Изменения в бинарном протоколе SIMBA — новая схема сообщений

ОБРАЩАЕМ ВАШЕ ВНИМАНИЕ, что изменения в протоколе SIMBA для фондового и валютного рынков не сохраняют обратной совместимости и требуют доработок на стороне клиентского ПО.

В сообщении SecurityDefinition тип поля LotDivider будет изменён с uInt16 на uInt32.

Обновлённая схема сообщений sbe_asts_md доступна на ftp-сервере Биржи: https://ftp.moex.com/pub/SIMBA/ASTS/schemas/release28_11_2026/.

Изменения в отчётах по итогам торгов и клиринга на валютном рынке

В отчёт CUX83 «Отчёт о полномочиях идентификаторов участника торгов на валютном рынке» добавляется новый атрибут:

- OtsMUserType — Тип идентификатора для внебиржевых сделок в режиме «OTC: внебиржевой стакан»:
  - 1 — в качестве наблюдателей;
  - 2 — в качестве наблюдателей и на заключение внебиржевых сделок;
  - 3 — закрыть режим.

Обновление терминала MOEX Trade Currency

В дату релиза планируется выпустить обновление терминала MOEX Trade SE до версии 3.26.40.

Всем пользователям будет предложено установить автоматическое обновление при подключении к торгово-клиринговой системе. Дистрибутивы для ручной установки будут доступны на FTP-сервере с 27 ноября: https://ftp.moex.com/pub/Terminals/ASTS/Currency.

Planned changes in the Securities and FX market systems

SECURITIES MARKET

Additional market individual risk parameters

Additional market individual risk parameters are introduced, which apply to the market risk rates for price decline and price increase on assets:

- "Markup/Discount to the price decline risk rate";
- "Markup/Discount to the price increase risk rate".

The new parameters are taken into account when calculating the boundaries of the market risk assessment range.

A Clearing Member may independently set the markup or discount values for the risk rates through the terminal or the bridge of the 2nd and 3rd level trade accounts. Values are set in percentages in the range from −100% to 100%, with a precision of two decimal places.

The market individual risk parameters "Markup/Discount to the risk rate" are taken into account when generating the clearing report on collateral valuation (EQM84), in the indicators of valuation and collateral value.

Change in the accounting of relatedness risk Between Clearing Members and Securities Issuers

From January 1, 2027, the Clearing House will set market individual risk parameters "Markup/Discount to the risk rate" for securities held on client accounts and 1st-level trust management accounts of Clearing Members affiliated with the issuers of such securities.

The change is related to the entry into force of the Regulation of the Central Bank of the Russian Federation No. 658-П dated November 1, 2018.

Interface changes

1. In the SET_RM_TRDACC_PRICERANGE transaction, new fields are added:
    - MARKUP_L – Risk rate for price decrease markup, %;
    - MARKUP_H – Risk rate for price increase markup, %.
2. In the RM_TRDACC_PRICERANGE table, new fields are added:
    - MARKUP_L – Risk rate for price decrease markup, %;
    - MARKUP_H – Risk rate for price increase markup, %.

New REPO tariff plan for Asset Management Companies

For asset management companies, a new trading member category "У" is introduced. Participants of the new category can select the REPO_CI tariff in addition to the existing tariff plans REPO_0, REPO_150, REPO_500, REPO_6500, REPO_16250, and REPO_32500.

On the first trading day of each calendar month, a participant of category "У" is sent a new report SEM27 on the fulfillment of the condition based on the results of the previous calendar month. The report is generated regardless of the selected tariff plan.

Revision of price deviation limits for orders on the Bond Market

Permissible execution price deviations for market and limit orders in bonds are being revised.

The base price for calculating the permissible deviation is the best matching price at the time of order submission:

- for a Bid (buy order) – the minimum Ask (sell) price;
- for an Ask (sell order) – the minimum Bid (buy) price.

Market orders for bonds

For coupon bonds of the Central Bank of Russia and Federal loan bonds, the permissible deviation for market orders remains unchanged at 0.4% of the Base price. For all other bonds, the permissible deviation is reduced from 1% to 0.8% of the Base price.

A market order is executed against counter orders if the price of a potential trade falls within the specified deviation. The unfilled remainder of the order is cancelled.

Limit orders for bonds

A permissible deviation of 5% of the Base price is introduced for limit orders in bonds. The rule applies to all bonds: coupon bonds of the Central Bank, Federal loan bonds, and others.

If the price of a subsequent potential trade exceeds the permissible deviation, the order is cancelled for the remaining volume. If the order carries additional remainder attributes, the limits apply as follows:

- "Fill or kill" – the order is cancelled;
- "Cancel remainder" – the unfilled remainder is cancelled;
- "Append to the order book" – the order is executed only within the permissible deviation. The unfilled remainder:
  - is booked to the order book at the price determined by the execution conditions selected in the order, if the order price is within the permissible deviation and the available volume of counter orders within the permissible deviation is insufficient for full execution;
  - is cancelled if the order price exceeds the permissible deviation.

The limits do not apply during opening auctions and closing auctions.

New versions of ASTS Bridge broker interface - Broker60 and BrokerRisk60

On the release date, a new version of ASTS Bridge broker interface for connecting to the trading system on the Securities market will be released. Description of the new version, as well as comparison with the previous version is published on the MOEX FTP server: https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/ASTS/Bridge_Interfaces/Equities/test.

1. In the SET_RM_TRDACC_PRICERANGE transaction, new fields are added:
   - MARKUP_L – Risk rate for price decrease markup, %;
   - MARKUP_H – Risk rate for price increase markup, %.
2. In the RM_TRDACC_PRICERANGE table, new fields are added:
   - MARKUP_L – Risk rate for price decrease markup, %;
   - MARKUP_H – Risk rate for price increase markup, %.

Changes in the SIMBA protocol: updated message schema

PLEASE NOTE that changes to the SIMBA protocol for the Securities and FX markets are not backward compatible and require modifications to client-side software.

In the SecurityDefinition message, the field type for LotDivider will be changed from uInt16 to uInt32.

The updated message schema sbe_asts_md is available on the MOEX FTP server: https://ftp.moex.com/pub/SIMBA/ASTS/schemas/release28_11_2026/.

Changes in trading reports on the Securities market

New report SEM27 (Compliance with the REPO_CI Tariff Plan Condition) is introduced.

Changes in clearing reports on the Securities market

In the report EQM99 (Report on collateral), when reflecting GCC issuance/redemption operations (i.e., operations with codes 22 and 23), the logic for populating the OperationTime (Time of the operation / execution) attribute is changed: upon issuance of GCC and execution of a REPO with CCP trade using these GCC on the same day, the value of the OperationTime (Time of the operation / execution) attribute in report EQM99 for the GCC issuance will not exceed the value of the ReportTime (Execution time) attribute from report EQM06 (Trades included into clearing (EQM06/EQM06P/EQM06R)).

The population logic for other operations remains unchanged.

MOEX Trade SE terminal update

On the release date, the MOEX Trade SE terminal is planned to be updated to version 3.26.40.

Users will be prompted to autoupdate while connecting to the trading and clearing system. Packages for manual installation will be available on the FTP server starting from November 27: https://ftp.moex.com/pub/Terminals/ASTS/Equities.

New System Messages and Error Codes

The following Trading System messages have been added in this release.

Code	Message
In addition to message 492 (Transfer is not allowed)	
1372	Security transfer with trdacc %12.12s is allowed only with own trdaccs
1373	Security transfer with trdacc %12.12s is not allowed (this trdacc doesn't contain a depository account)
1375	Transfers between first level accounts are not allowed during weekend session
1381	Transfers within one account are not allowed
1382	Transfers between first level accounts are not allowed during evening session
1383	Transfers between accounts belonging to different clearing houses are not allowed during evening session
1384	Transfers between two general collateral pool accounts are not allowed
1385	Security transfer is not allowed (depository account owners differ for deposit and withdrawal trading accounts)
1386	Transfers with non-CCP accounts are not allowed during evening session
In addition to message 703 (Invalid date specified)	
1388	Activation date exceeds security's auction date
1389	Prepayment date exceeds security's auction date
1390	Prepayment date exceeds security's activation date
In addition to message 617 (Unable to accept deal)	
1392	Unable to accept deal. Invalid reporate specified
1393	Unable to accept deal. Invalid discount specified
1394	Unable to accept deal. Invalid lower discount specified
1395	Unable to accept deal. Invalid upper discount specified
In addition to message 533 (Invalid client code)	
1396	Client code is not active
1397	Client code in the refund request must be equal to the client code in the deposit
1398	Specified client code is not allowed for this SMA user

FX MARKET

Additional market individual risk parameters

Additional market individual risk parameters are introduced, which apply to the market risk rates for price decline and price increase on assets:

- "Markup/Discount to the price decline risk rate";
- "Markup/Discount to the price increase risk rate".

The new parameters are taken into account when calculating the boundaries of the market risk assessment range.

A Clearing Member may independently set the markup or discount values for the risk rates through the terminal or the bridge of the 2nd and 3rd level trade accounts. Values are set in percentages in the range from −100% to 100%, with a precision of two decimal places.

The market individual risk parameters "Markup/Discount to the risk rate" are taken into account when generating the clearing report on collateral valuation (EQM84), in the indicators of valuation and collateral value.

Change in the accounting of relatedness risk Between Clearing Members and Securities Issuers

From January 1, 2027, the Clearing House will set market individual risk parameters "Markup/Discount to the risk rate" for securities held on client accounts and 1st-level trust management accounts of Clearing Members affiliated with the issuers of such securities.

The change is related to the entry into force of the Regulation of the Central Bank of the Russian Federation No. 658-П dated November 1, 2018.

Interface changes

1. In the SET_RM_TRDACC_PRICERANGE transaction, new fields are added:
   - MARKUP_L – Risk rate for price decrease markup, %;
   - MARKUP_H – Risk rate for price increase markup, %.
2. In the RM_TRDACC_PRICERANGE table, new fields are added:
   - MARKUP_L – Risk rate for price decrease markup, %;
   - MARKUP_H – Risk rate for price increase markup, %.

Change in trading hours for TOD currency instruments and TODTOM swap instruments

In the system trading mode (board CETS), trading hours are extended:

- for TOD currency instruments – until 18:45;
- for TODTOM swap instruments on the precious metals market and the FX market – until 19:00.

Trades executed between 18:00 and 19:00 are included in the CUX23 report (Trades report).

For TOD currency instruments in the system trading mode, the possible start period for the price update auction is extended until 18:34:30.

Resumption of the ability to execute over-the-counter trades in USDRUB currency pair instruments with small lots in the OTCM mode

Execution of over-the-counter trades in the OTCM mode for non-deliverable spot instruments USDRUB_TMS and USDRUB_STS with small lots will resume. Instrument parameters are listed in the table below:

Parameter	USDRUB_TMS	USDRUB_STS
Lot currency	USD	USD
Counter currency	RUB	RUB
Settlement date	T+1	T+2
Order lot, in units of lot currency	0.01	0.01
Minimum order size, in units of lot currency	1	1
Maximum order size, in units of lot currency	999.99	999.99
Quote per lot currency amount	1 USD	1 USD
Order tick size	0.0001	0.0001
Price precision	up to 4 decimal spaces	up to 4 decimal spaces

Trading hours: 09:00–19:00.

Clearing Members of categories О/Б/Б2 who are admitted to Partially Secured trades and have submitted an application (consent) for admission to non-deliverable instruments with a special delivery mode with rollover and consent to execute swap trades for automatic position rollover are admitted to execute trades in USDRUB in the OTCM mode. Access to the instruments is not provided to participants who have set restrictions on instruments and modes on their trading identifiers.

Trades in the OTCM mode are not included in the bulletin.

Changes to CUX83 report

Information on over-the-counter trades in the OTCM mode is reflected in Clearing reports in the standard manner.

In the CUX83 report (Report on permissions of the FX market trading member's identifiers), a new attribute is added:

- OtsMUserType – User type by access to Over-the-counter transactions with foreign currency in the "OTCM" mode:
  - 1 – access to view;
  - 2 – access to view and over-the-counter trade;
  - 3 – close the mode.

New versions of ASTS Bridge broker interface - Broker60 and BrokerRisk60

On the release date, a new version of ASTS Bridge broker interface for connecting to the trading system on the FX market will be released. Description of the new version, as well as comparison with the previous version is published on the MOEX FTP server: https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/ASTS/Bridge_Interfaces/Currency/test.

1. In the SET_RM_TRDACC_PRICERANGE transaction, new fields are added:
    - MARKUP_L – Risk rate for price decrease markup, %;
    - MARKUP_H – Risk rate for price increase markup, %.
2. In the RM_TRDACC_PRICERANGE table, new fields are added:
    - MARKUP_L – Risk rate for price decrease markup, %;
    - MARKUP_H – Risk rate for price increase markup, %.

Changes in the SIMBA protocol: updated message schema

PLEASE NOTE that changes to the SIMBA protocol for the Securities and FX markets are not backward compatible and require modifications to client-side software.

In the SecurityDefinition message, the field type for LotDivider will be changed from uInt16 to uInt32.

The updated message schema sbe_asts_md is available on the MOEX FTP server: https://ftp.moex.com/pub/SIMBA/ASTS/schemas/release28_11_2026/.

Changes in trading and clearing reports on the FX market

In the CUX83 report (Report on permissions of the FX market trading member's identifiers), a new attribute is added:

- OtsMUserType – User type by access to Over-the-counter transactions with foreign currency in the "OTCM" mode:
    - 1 – access to view;
    - 2 – access to view and over-the-counter trade;
    - 3 – close the mode.

MOEX Trade Currency terminal update

On the release date, the MOEX Trade Currency terminal is planned to be updated to version 3.26.40.

Users will be prompted to autoupdate while connecting to the trading and clearing system. Packages for manual installation will be available on the FTP server starting from November 27: https://ftp.moex.com/pub/Terminals/ASTS/Currency.