

**Повестка дня и решения, принятые на заседании  
Комитета по Срочному рынку ПАО Московская Биржа**

**Форма проведения:** совместное присутствие членов Комитета по Срочному рынку ПАО Московская Биржа (далее – Комитет) по вопросам повестки дня.

**Дата подведения итогов голосования:** 20 сентября 2016 года

**Место подведения итогов голосования:** Москва, ул. Воздвиженка, д. 4/7, стр. 1

№ п/п	Вопрос повестки дня	Принятое решение
1	<b>Вопрос 1 повестки дня: Об итогах деятельности Рабочей группы по рискам при Комитете по Срочному рынку ПАО Московская Биржа</b>	<p>1. Рекомендовать уполномоченному органу управления ПАО Московская Биржа (далее – Биржа):</p> <p>1.1. утвердить новую редакцию Спецификации маржируемого опциона на фьючерсный контракт на Индекс РТС со следующей формулировкой относительно определения последнего дня заключения опциона:</p> <p>Дата последнего Торгового дня, в ходе которого может быть заключен Контракт (далее – последний день заключения Контракта), указываемая в коде Контракта, определяется в соответствии со Списком дат, являющихся последними днями заключения опционов, как один из четвергов месяца и года истечения срока действия Контракта.</p> <p>Если соответствующий четверг месяца и года истечения срока действия Контракта не является Торговым днем, дата последнего дня заключения Контракта, указываемая в коде Контракта, определяется в соответствии со Списком дат, являющихся последними днями заключения опционов, как дата последнего Торгового дня, предшествующего соответствующему четвергу месяца и года истечения срока действия Контракта.</p> <p>Список дат, являющихся последними днями заключения опционов, утверждается решением Биржи по согласованию с Клиринговым центром и публикуется на сайте Биржи в сети Интернет по состоянию на текущий календарный год.</p> <p>1.2. допустить к торгам недельные опционы на фьючерсы на Индекс РТС (далее – недельные опционы);</p>

		<p>1.3. допускать к торгам недельные опционы со страйками в диапазоне <math>\pm 15\%</math> от центрального страйка;</p> <p>1.4. установить шаг страйка недельных опционов аналогичным шагом страйка для месячных и квартальных опционов;</p> <p>1.5. допускать к торгам недельные опционы за две недели до истечения их срока действия;</p> <p>1.6. через год после допуска к торгам недельных опционов вынести на рассмотрение Комитета вопрос об итогах торгов недельными опционами за прошедший год.</p> <p>2. Рекомендовать Банку НКЦ (АО) изменить количество сессий с пониженной волатильностью для уменьшения лимитов, установив значение параметра <math>D_{num}</math>, равное 4 (четырем).</p> <p>3. Рекомендовать Банку НКЦ (АО) при расширении лимитов цен фьючерсов до начала основной торговой сессии оповещать участников о предстоящем расширении на сайте Банка НКЦ (АО) и через шлюз торговой системы SPECTRA не позднее, чем в 09:45 по московскому времени.</p>
2	<p><b>Вопрос 2 повестки дня: Об итогах деятельности Рабочей группы по ликвидности при Комитете при Комитете по Срочному рынку ПАО Московская Биржа</b></p>	<p>1. Принять к сведению изменение регулирования центрального страйка в маркет-мейкерских обязательствах на опционах.</p> <p>2. Принять к сведению изменение формулы для расчета спреда при определении маркет-мейкерских обязательств на опционах с учетом комментариев членов Рабочей группы по ликвидности. Рекомендовать пересчитывать спред в ходе вечернего клиринга, а при экстремальной волатильности рынка – в ходе торгов.</p> <p>3. Рекомендовать уполномоченному органу управления ПАО Московская Биржа не изменять время определения цены исполнения фьючерсов на российские индексы.</p> <p>4. Принять к сведению планируемое изменение формулы расчета рейтинга в Программе ранжирования маркет-мейкеров по фьючерсам.</p>
3	<p><b>Вопрос 3 повестки дня: О возможном варианте реализации аукциона открытия</b></p>	<p>1. Поручить членам Комитета по срочному рынку в течение месяца предоставить ПАО Московская Биржа свои комментарии к предложенному механизму реализации аукциона открытия.</p> <p>2. Рекомендовать ПАО Московская Биржа оценить ресурсы, необходимые для реализации аукциона открытия с учетом комментариев членов Комитета.</p> <p>3. Рекомендовать ПАО Московская Биржа представить на очередное очное заседание</p>

		Комитета Список проектов и задач Срочного рынка для их приоритезации, включив в него проект «Аукцион открытия».
4	<b>Вопрос 4 повестки дня: О допуске к торгам новых серий фьючерсов на Индекс ММВБ (код – MIX) и опционов на них</b>	Рекомендовать уполномоченному органу управления ПАО Московская Биржа допускать к торгам новые серии фьючерсов на Индекс ММВБ (код – MIX) и опционов на них.
5	<b>Вопрос 5 повестки дня: О планах по изменению тарифов на услуги по предоставлению биржевой информации для использования в Non-display системах (NDS)</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Принять к сведению информацию о планах ПАО Московская Биржа по изменению тарифов по предоставлению биржевой информации для использования в Non-display системах (NDS).</li> <li>2. Не рекомендовать ПАО Московская Биржа проводить модификацию тарифов биржевой информации и технологического доступа в целях её использования в NDS. Сохранить в тарифах на предоставление биржевой информации для использования в NDS тариф “Multi”, охватывающий все рынки Биржи и неограниченное количество NDS.</li> <li>3. Рекомендовать ПАО Московская Биржа довести до сведения членов всех пользовательских комитетов ПАО Московская Биржа и ЗАО «ФБ ММВБ» решение Комитета, указанное в пункте 2.</li> </ol>
6	<b>Вопрос 6 повестки дня: О состоянии средств гарантийного обеспечения участников Срочного рынка ПАО Московская Биржа</b>	Принять к сведению информацию о состоянии средств гарантийного обеспечения участников Срочного рынка ПАО Московская Биржа.
7	<b>Вопрос 7.1 повестки дня: Разное: О статусе реализации клиентских запросов</b>	Принять к сведению информацию о статусе реализации клиентских запросов.
8	<b>Вопрос 7.2 повестки дня: Разное: О начале расчета сбора за ошибки flood control</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Рекомендовать Банку НКЦ (АО) начать расчет сбора за ошибочные транзакции flood control (далее – ошибки flood control) с 03 октября 2016 года.</li> <li>2. Рекомендовать Банку НКЦ (АО) начать взимание сбора за ошибки flood control в пользу ООО «МБ Технологии» после реализации следующих доработок: <ol style="list-style-type: none"> <li>2.1. Отчет tranfcfeeXXYY.csv направляется Участникам клиринга в составе отчетов по итогам дневной клиринговой сессии Торгового дня, следующего за Торговым днем, за который рассчитан сбор за ошибки flood control;</li> <li>2.2. Списание сбора за ошибки flood control осуществляется в ходе вечернего клиринга Торгового дня, следующего с Торговым днем, по итогам которого рассчитан сбор.</li> </ol> </li> </ol>

		<p>3. Включить задачу онлайн-трансляции в шлюзе торговой системы SPECTRA информации о величине сбора за ошибки flood control в течение Торгового дня в список клиентских запросов. Рекомендовать ПАО Московская Биржа представить на очередное очное заседание Комитета Список проектов и задач Срочного рынка для их приоритизации, включив в него данную задачу.</p>
9	<p><b>Вопрос 7.3 повестки дня: Разное: Об изменении правила формирования длинного кода опциона</b></p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Одобрить новый подход к порядку формирования полного кода опционов, предусматривающий исключение пробела, учитывая отсутствие возражений со стороны Информационно-технологического комитета ПАО Московская биржа (Протокол № 10 от 09 сентября 2016 года).</li> <li>2. Рекомендовать уполномоченному органу управления ПАО Московская Биржа: <ol style="list-style-type: none"> <li>2.1 утвердить новые редакции Спецификаций маржируемых опционов на фьючерсные контракты ПАО Московская биржа с учетом нового подхода к порядку формирования полного кода опционов, указанного в пункте 1 настоящего решения.</li> <li>2.2 распространить новый подход к формированию полного кода опционов только на опционы, которые будут допущены к торгам после даты вступления в силу новых редакций Спецификаций маржируемых опционов.</li> <li>2.3 в отношении опционов, допущенных к торгам до даты вступления в силу новых редакций Спецификаций маржируемых опционов, применять подход к порядку формирования полного кода опционов, не предусматривающий исключение пробела, до даты истечения срока действия таких опционов.</li> <li>2.4 раскрыть информацию о точной дате и порядке внедрения нового подхода к порядку формирования полного кода опционов не позднее чем за 1 (один) месяц до даты вступления в силу новых редакций Спецификаций маржируемых опционов, предусматривающих применение данного подхода.</li> </ol> </li> </ol>
10	<p><b>Вопрос 7.4 повестки дня: Разное: О реализации предоставления сервиса онлайн-регистрации клиентов на Срочном рынке</b></p>	<p>Рекомендовать ПАО Московская Биржа включить в Список проектов и задач Срочного рынка задачу «Предоставление сервиса онлайн-регистрации клиентов на Срочном рынке».</p>