



МОСКОВСКАЯ  
БИРЖА

ФЕВРАЛЬ  
2017

ДАЙДЖЕСТ  
ПОЛЬЗОВАТЕЛЬСКИХ  
КОМИТЕТОВ ГРУППЫ  
«МОСКОВСКАЯ  
БИРЖА»

# ДАЙДЖЕСТ ПОЛЬЗОВАТЕЛЬСКИХ КОМИТЕТОВ ГРУППЫ «МОСКОВСКАЯ БИРЖА» ФЕВРАЛЬ 2017 ГОДА

## ОГЛАВЛЕНИЕ

1. Итоги формирования и итоги первого заседания Экспертного совета по листингу ПАО Московская Биржа <sup>(5)</sup> .....	4
2. Начало торгов акциями и особенности проведения расчетов по IPO с участием иностранных инвесторов <sup>(5)</sup> .....	4
3. Внесение изменений в Тарифы оплаты депозитарных услуг НКО АО НРД и Тарифы на услуги НКО АО НРД, связанные с совершением операций по ценным бумагам, в отношении которых НКО АО НРД открыт лицевой счет номинального держателя центрального депозитария или в отношении которых НКО АО НРД является лицом, осуществляющим обязательное централизованное хранение ценных бумаг (далее – Тарифы ЦД) <sup>(2)</sup> .....	4
3.1. Внесение изменений в Тарифы оплаты депозитарных услуг НКО АО НРД и Тарифы ЦД, связанных с запуском новых сервисов по приоритизации инструкций и Linked transactions <sup>(2)</sup> .....	4
4. Основные решения, принятые на заседаниях Индексного комитета ПАО Московская Биржа 22 и 27 февраля 2017 года <sup>(8)</sup> .....	5
5. Приоритетные задачи на Срочном рынке ПАО Московская Биржа <sup>(1)</sup> .....	6
6. Согласование Спецификаций ряда фьючерсов и опционов и Списков параметров к ним в новой редакции на Срочном рынке ПАО Московская Биржа <sup>(1)</sup> .....	6
7. Трансляция точных комиссий по логинам уровня Брокерской фирмы на Срочном рынке ПАО Московская Биржа <sup>(1)</sup> .....	6
8. Расчет комиссии по фьючерсам и опционам с учетом скальперской скидки после переходного периода на Срочном рынке ПАО Московская Биржа <sup>(1, 7)</sup> .....	6
9. Предварительные итоги запуска недельных опционов на Срочном рынке ПАО Московская Биржа <sup>(1)</sup> .....	7
10. Допуск к торгам инструментов «Календарный спред» в центральных страйках опционов на фьючерсы на Индекс РТС и курс USD/RUB на Срочном рынке ПАО Московская Биржа <sup>(1)</sup> .....	7
11. Изменения в Правила оказания репозитарных услуг НКО АО НРД <sup>(6)</sup> .....	7
12. Раскрытие аналитической информации на основе данных Репозитария НКО АО НРД <sup>(6)</sup> .....	7
13. Предстоящий Релиз SPECTRA 5.3 на Срочном Рынке ПАО Московская Биржа <sup>(1)</sup> .....	7
14. Разделение ТК ASTS на торговую ASTS+ и клиринговую FORM+ составляющие <sup>(7)</sup> .....	8
15. Реорганизация полигона внешнего тестирования Spectra <sup>(7)</sup> .....	8
16. Игровая система срочного рынка ПАО Московская Биржа <sup>(7)</sup> .....	8

17. Изменения в подключении к тестовым контурам для клиентов с доступом по выделенным каналам и из зоны колокации <sup>(7)</sup> .....	9
18. Новая схема подключения через шлюз на стороне ПАО Московская Биржа <sup>(7)</sup> .....	9
19. Ход реализации плана по переносу функционала ПО «ЛУЧ» в части корпоративных действий в ПО «Файловый шлюз» <sup>(3, 4)</sup> .....	9
20. Отчет о работе Репозитария НКО АО НРД в 2016 году <sup>(6)</sup> .....	10
21. Планы НКО АО НРД по доработке программного обеспечения Репозитария в 2017 году <sup>(6)</sup> .....	10
22. Итоги деятельности рабочей группы по дистанционным сервисам при Комитете по проведению расчетов и оформлению операций <sup>(9)</sup> .....	10
23. Итоги деятельности рабочей группы по унификации стоимости технологических подключений при Информационно-технологическом комитете <sup>(7)</sup> .....	11

<sup>1</sup> Комитет по Срочному рынку ПАО Московская Биржа от 01.02.2017 и 17.02.2017

<sup>2</sup> Комитет пользователей услуг НКО АО НРД от 09.02.2017

<sup>3</sup> Комитет по взаимодействию с регистраторами и депозитариями от 14.02.2017

<sup>4</sup> Комитет по развитию центра корпоративных действий и корпоративной информации от 14.02.2017

<sup>5</sup> Комитет по первичному рынку акций ПАО Московская Биржа от 15.02.2017

<sup>6</sup> Комитет пользователей репозитарных услуг при Правлении НКО АО НРД от 15.02.2017

<sup>7</sup> Информационно-технологический комитет от 16.02.2017

<sup>8</sup> Индексный комитет ПАО Московская Биржа от 22.02.2017 и 27.02.2017

<sup>9</sup> Рабочая группа по дистанционным сервисам при Комитете по проведению расчетов и оформлению операций от 01.02.2017

## **1 | Итоги формирования и итоги первого заседания Экспертного совета по листингу ПАО Московская Биржа**

Участникам заседания Комитета по первичному рынку акций ПАО Московская Биржа представили итоги формирования Экспертного совета по листингу, а также итоги первого заседания, в числе которых была освещена предложенная практика рассмотрения Экспертным советом по листингу сделок по размещению акций. Более подробную информацию можно найти по ссылке: <http://moex.com/a3817>.

Члены Комитета по первичному рынку акций ПАО Московская Биржа приняли к сведению представленную информацию.

## **2 | Начало торгов акциями и особенности проведения расчетов по IPO с участием иностранных инвесторов**

Участникам заседания Комитета по первичному рынку акций ПАО Московская Биржа было предложено рассмотреть возможность введения торгов с расчетами на T+3 или T+N после проведения первичного публичного размещения акций с участием иностранных инвесторов в структуре сделки, а также возможность проведения торгов с условными обязательствами расчетов и возможностью их отмены.

Ознакомившись с представленными материалами, члены Комитета по первичному рынку акций ПАО Московская Биржа приняли следующие решения:

1. Рекомендовать ПАО Московская Биржа изучить опыт Лондонской фондовой биржи в части применения штрафных санкций при отмене сделок.
2. Рекомендовать ПАО Московская Биржа проработать и предложить членам Комитета по первичному рынку акций концепцию торгов с расчетами T+3 или T+N по завершению сделки первичного публичного предложения с участием иностранных инвесторов, а также разработать механизм переноса обязательств без применения повышенных штрафных санкций.

## **3 | Внесение изменений в Тарифы оплаты депозитарных услуг НКО АО НРД и Тарифы на услуги НКО АО НРД, связанные с совершением операций по ценным бумагам, в отношении которых НКО АО НРД открыт лицевой счет номинального держателя центрального депозитария или в отношении которых НКО АО НРД является лицом, осуществляющим обязательное централизованное хранение ценных бумаг (далее — Тарифы ЦД)**

### **3.1. Внесение изменений в Тарифы оплаты депозитарных услуг НКО АО НРД и Тарифы ЦД, связанных с запуском новых сервисов по приоритизации инструкций и Linked transactions.**

Ознакомившись с представленными материалами, члены Комитета пользователей услуг НКО АО НРД (Комитета пользователей услуг центрального депозитария), приняли следующие решения:

1. Одобрить внесение изменений в Тарифы оплаты депозитарных услуг НКО АО НРД (далее — Тарифы) и Тарифы, связанные с совершением операций по ценным бумагам, в отношении которых НКО АО НРД открыт лицевой счет номинального держателя центрального депозитария или в отношении которых НКО АО НРД является лицом, осуществляющим обязательное централизованное хранение ценных бумаг (далее — Тарифы ЦД), связанных с запуском новых сервисов по приоритизации инструкций и Linked transaction, согласно Приложению 1 к материалам заседания;
2. Рекомендовать Наблюдательному совету НКО АО НРД утвердить изменения в Тарифы и Тарифы ЦД, указанные в пункте 1 настоящего решения.

## 4 | Основные решения, принятые на заседаниях Индексного комитета ПАО Московская Биржа 22 и 27 февраля 2017 года

1. Индексный комитет ПАО Московская Биржа (далее — комитет) рекомендовал уполномоченному органу ПАО Московская Биржа установить коэффициент free-float обыкновенных акций ПАО «Русс-нефть» равным 20%.
2. Комитет рекомендовал включить с 17 марта 2017 года в состав Индекса ММВБ и Индекса РТС обыкновенные акции ПАО «ТМК» и привилегированные акции ПАО «Мечел» и исключить из состава Индекса ММВБ и Индекса РТС обыкновенные акции ПАО АНК «Башнефть» и ПАО «Корпорация ВСМПО-АВИСМА».

Сводная таблица изменений в списках индексов Московской биржи, рекомендованных Индексным комитетом:

Индекс	Включены	Исключены
Индекс ММВБ, Индекс РТС	ПАО «ТМК», ао ПАО «Мечел», ап	ПАО АНК «Башнефть», ао ПАО «Корпорация ВСМПО-АВИСМА», ао
Индекс акций широкого рынка	ОАО «СН-МНГ», ап ПАО «Промсвязьбанк», ао ПАО «РКК «Энергия», ао	ПАО АНК «Башнефть», ао ПАО «ЧЦЗ», ао ПАО ГК «ТНС энерго», ао
Индекс акций второго эшелона	ПАО «Промсвязьбанк», ао ОАО «СН-МНГ», ап ПАО «РКК «Энергия», ао ПАО «Корпорация ВСМПО-АВИСМА», ао	ПАО ГК «ТНС энерго», ао ПАО «ЧЦЗ», ао ПАО «ТМК», ао ПАО «Мечел», ап
Индекс нефти и газа	ОАО «СН-МНГ», ап	ПАО АНК «Башнефть», ао
Индекс металлов и добычи		ПАО «ЧЦЗ», ао
Индекс машиностроения	ПАО «РКК «Энергия», ао	
Индекс электроэнергетики		ПАО ГК «ТНС энерго», ао
Индекс финансов	ПАО «Промсвязьбанк», ао	

3. Комитет рекомендовал утвердить следующие значения коэффициентов free-float:

Код	Наименование	Free-float
AVAZ	ПАО «АВТОВАЗ», ао	7%
BANE	ПАО АНК «Башнефть», ао	3%
СВОМ	ПАО «МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК», ао	25%
CHZN	ПАО «ЧЦЗ», ао	4%
DASB	ПАО «Дагестанская энергосбытовая компания», ао	10%
ENRU	ПАО «Энел Россия», ао	25%
GAZA	ПАО «ГАЗ», ао	12%
MSNG	ПАО «Мосэнерго», ао	15%
NKHP	ПАО «НКХП», ао	27%
NLMK	ПАО «НЛМК», ао	16%
PHOR	ПАО «ФосАгро», ао	25%
RUAL	Юнайтед Компани РУСАЛ Плс, акции иностранного эмитента	13%
TRMK	ПАО «ТМК», ао	30%

## 5 | Приоритетные задачи на Срочном рынке ПАО Московская Биржа

Членам Комитета по Срочному рынку ПАО Московская Биржа на рассмотрение представили материалы по приоритетным задачам и проектам Срочного рынка, среди которых можно выделить такие, как покрытые продажи, прямой перевод средств между рынками, изменение риск-параметров во время торгов, полное нетто по Расчетному коду и другие.

Ознакомившись с изложенной информацией, члены Комитета по Срочному рынку ПАО Московская Биржа приняли следующие решения:

1. Принять к сведению информацию о статусе проектов и задач Срочного рынка ПАО Московская Биржа.
2. Рекомендовать ПАО Московская Биржа дополнить Список проектов и задач Срочного рынка ПАО Московская Биржа (далее — Список) следующей информацией:
  - категория сложности проекта/задачи;
  - комментарий ПАО Московская Биржа о статусе проекта/задачи (реализована/в процессе реализации/планируется к реализации/нецелесообразно реализовывать);
  - срок реализации проекта/задачи (в случае, если он определен).
3. Рекомендовать ПАО Московская Биржа информировать членов Комитета на регулярной основе о статусе проектов и задач, включенных в Список, а также о добавлении новых проектов и задач в Список.
4. Рекомендовать ПАО Московская Биржа проинформировать Комитет о механизме реализации модели «Полное нетто по Расчетным кодам».

## 6 | Согласование Спецификаций ряда фьючерсов и опционов и Списков параметров к ним в новой редакции на Срочном рынке ПАО Московская Биржа

Члены Комитета по Срочному рынку ПАО Московская Биржа ознакомились с подготовленными новыми редакциями Спецификаций ряда фьючерсов и опционов и Списков параметров к ним и приняли решение рекомендовать Правлению ПАО Московская Биржа утвердить новые редакции:

- Спецификации фьючерсных контрактов на курс доллара США к иностранной валюте и Списка параметров расчетных фьючерсных контрактов на курс доллара США к иностранной валюте;
- Спецификации маржируемых опционов на фьючерсные контракты на курс доллара США к ино-

странной валюте и Списка параметров маржируемых опционов на фьючерсные контракты на курс доллара США к иностранной валюте;

- Спецификации фьючерсных контрактов на курс иностранной валюты к доллару США;
- Списка параметров маржируемых опционов на фьючерсные контракты на курс иностранной валюты к доллару США.

## 7 | Трансляция точных комиссий по логинам уровня Брокерской фирмы на Срочном рынке ПАО Московская Биржа

Ознакомившись с представленными материалами по трансляции точных комиссий по логинам уровня Брокерской фирмы, участники Комитета по Срочному рынку ПАО Московская Биржа приняли решение рекомендовать ПАО Московская Биржа реализовать данный функционал без опциональности.

## 8 | Расчет комиссии по фьючерсам и опционам с учетом скальперской скидки после переходного периода на Срочном рынке ПАО Московская Биржа

Члены Комитета по Срочному рынку ПАО Московская Биржа, ознакомившись с представленными материалами по расчету комиссии по фьючерсам и опционам с учетом скальперской скидки после переходного периода, приняли следующие решения:

1. Принять к сведению информацию о расчете биржевого сбора по фьючерсам и опционам с учетом скальперской скидки после переходного периода.
2. Рекомендовать ПАО Московская Биржа оставить без изменения для целей расчета величины биржевого сбора по опционам текущий принцип определения премии по опционам: в качестве значения премии по опциону (Premium) использовать значение теоретической цены опциона, которое определено по итогам последнего вечернего Расчетного периода, предшествующего Торговому дню, за который осуществляется расчет биржевого сбора.
3. Рекомендовать ПАО Московская Биржа рассмотреть возможность использовать для целей расчета величины биржевого сбора по фьючерсам и опционам значение Расчетной цены фьючерса (FutPrice), определенное по итогам вечернего Расчетного периода Торгового дня, предшествующего Торговому дню, в отношении которого осуществляется расчет.

## 9 | Предварительные итоги запуска недельных опционов на Срочном рынке ПАО Московская Биржа

С января 2017 года участникам торгов на Срочном рынке Московской биржи стали доступны для заключения сделок недельные опционы. Главное отличие нового инструмента заключается в коротком сроке обращения: новый контракт экспирируется через 2 недели после заведения в торговую систему.

Члены Комитета по Срочному рынку ПАО Московская Биржа приняли к сведению информацию о предварительных итогах запуска недельных опционов и вынесли на рассмотрение Комитета вопрос об итогах запуска указанного инструмента после экспирации квартальных опционов в июне 2017 года.

## 10 | Допуск к торгам инструментов «Календарный спред» в центральных страйках опционов на фьючерсы на Индекс РТС и курс USD/RUB на Срочном рынке ПАО Московская Биржа

Члены Комитета по Срочному рынку ознакомились с материалами АО «Открытие Брокер» о допуске к торгам инструментов «Календарный спред» в центральных страйках опционов на фьючерсы на Индекс РТС и курс USD/RUB и приняли решение предложить АО «Открытие Брокер»:

1. Проработать вопрос о возможных параметрах инструментов «Календарный спред» для центральных страйков опционов на фьючерсы на Индекс РТС и курс USD/RUB, а именно:
  - цены сделок, заключенных в результате сведения такой заявки,
  - диапазон страйков,
  - алгоритм определения страйков в каждой связанной паре инструментов,
  - время допуска к торгам таких инструментов.
2. Результаты проработки вынести на рассмотрение Комитета по срочному рынку ПАО Московская Биржа.

## 11 | Изменения в Правила оказания репозитарных услуг НКО АО НРД

Члены Комитета пользователей репозитарных услуг при Правлении НКО АО НРД ознакомились с планами по внесению изменений в Правила оказания репозитарных услуг НКО АО НРД (далее — Правила). В ходе заседания участники обсудили внесение в Правила оговорок, по-

зволяющей Репозитарию расторгать в одностороннем порядке соглашения с клиентами, не оплачивающими услуги Репозитария на протяжении более чем двух месяцев подряд, введение авансовой схемы для упрощения оплаты счетов клиентам-нерезидентам, а также разработку технической возможности блокировки клиентов в случае неоплаты услуг Репозитария.

Члены Комитета выработали следующие рекомендации:

1. Поручить НРД рассмотреть возможность введения авансовой схемы оплаты для клиентов-нерезидентов.
2. Поручить НРД рассмотреть возможность выставления счетов за репозитарные услуги клиентам-нерезидентам в иностранной валюте.

В результате голосования было принято следующее решение:

1. Принять к сведению представленные материалы с учетом рекомендаций членов Комитета.
2. Вынести вопрос о согласовании изменений в Правила оказания репозитарных услуг НКО АО НРД на заочное голосование по мере подготовки проектов изменений.

## 12 | Раскрытие аналитической информации на основе данных Репозитария

Члены Комитета пользователей репозитарных услуг при Правлении НКО АО НРД ознакомились с планами по раскрытию аналитической информации на основе данных Репозитария. В ходе заседания участники обсудили этапы реализации раскрытия агрегированной статистики, а также возможностей предоставления аналитической информации в рамках развития платных сервисов.

Члены Комитета пользователей репозитарных услуг при Правлении НКО АО НРД приняли к сведению представленную информацию.

## 13 | Предстоящий Релиз SPECTRA 5.3 на Срочном Рынке ПАО Московская Биржа

Плановое обновление ТК С SPECTRA до версии 5.3 должно состояться в первом квартале 2017 года. В связи с обновлением вечерняя дополнительная торговая сессия на Срочном рынке Московской Биржи в пятницу, предшествующую дате релиза, должна быть отменена.

Список изменений в версии 5.3:

1. **Изменение формулы расчета кривой волатильности.** В версии 5.3 будет изменена формула расчета кривой волатильности. [Подробнее об изменениях.](#)

[Описание полной методики расчета кривой волатильности.](#)

**2. Заявки типа «календарный спред» со сроком действия.** Начиная с версии 5.3 ТКС SPECTRA начнет принимать заявки по календарным спредам со сроком действия (`date_exp >` текущего дня). Заявка подается с помощью команды `FutAddMultiLegOrder`, дата истечения заявки задается параметром `date_exp` (тип `c8`).

[Инструменты типа «календарный спред».](#)

### 3. Изменения в терминале Срочного рынка.

- В окно «Администрирование» добавлен новый иерархический уровень РК — Расчетный Код.
- В окно «Средства по Расчетным Кодам» добавлены новые параметры — вариационная маржа для данного РК, рассчитанная по текущей и рыночной котировкам.
- Правила исполнения опционов вынесены в отдельное окно — пункт основного меню «Администрирование» — «Правила исполнения опционов».
- В панель быстрого поиска записей в таблице добавлена кнопка, позволяющая отфильтровать записи в окне по строке; в окне будут отображаться только записи, в которых найдена заданная последовательность символов.

[Дистрибутив и документация по терминалу Срочного рынка.](#)

### 4. Технологические изменения.

- Разделение торговой и клиринговой компонент. Модернизация ядра и риск-модуля ТКС, направленная на стабилизацию работы системы.
- Изменение реализации ограничителя потока транзакций на ядре ТКС SPECTRA. В версии 5.3 шлюзовые ограничители потока транзакций от клиентов были заменены на единую точку. В предыдущих версиях использовался ограничитель на каждый шлюз.
- Фиксация времени регистрации транзакций с наносекундной точностью. Для таблиц потоков, транслирующих сделки и заявки, добавлено новое поле `moment_ns`.

[Новые дистрибутивы.](#)

Члены комитета по Срочному рынку ПАО Московская Биржа приняли к сведению информацию о предстоящем Релизе SPECTRA до версии 5.3.

## 14 | Разделение ТКС ASTS на торговую ASTS+ и клиринговую FORM+ составляющие

В архитектурно новой версии ТКС ASTS+ планируется осуществить переход от единого торгово-клирингового ядра к независимым, как программно, так и аппаратно, торговой и клиринговой компонентам.

Конечной целью данного проекта является переход к использованию единого клирингового ядра для нескольких рынков, а также разделение торгового ядра

по режимам торгов. Также переход на принцип слабой связанности компонентов позволит оптимизировать процессы разработки как для биржи, так и для клиентов через локализацию изменений и релизов и повысить надёжность всего комплекса за счёт ухода от единой точки отказа.

Разделение на модули, в свою очередь, реализует и актуальное для современной высокоскоростной торговли разделение интерфейсов доступа на «быстрые» (собственно, торги) и «медленные» (клиринговые операции, не предъявляющие повышенных требований ко времени отклика). Более подробную информацию, а также информацию о тестировании данной версии системы можно найти по ссылке <http://moex.com/n15221/?nt=107>.

Члены Информационно-технологического комитета ПАО Московская Биржа приняли к сведению представленную информацию.

## 15 | Реорганизация полигона внешнего тестирования Spectra

Будущий T+1 — полигон будет создан из текущего T — полигона, содержащего текущую версию ТКС Spectra. Он сохранит за собой его адреса и порты. На T+1 — полигоне, который будет содержать будущую версию ТКС Spectra, будут представлены все виды клиентских интерфейсов доступные в боевой системе: клиентский терминал, CGate, Fix, Fast, TWIME.

T — полигон будет создан заново на новых адресах/портах. На T — полигоне будут представлены все виды клиентских интерфейсов, доступные в боевой системе: клиентский терминал, CGate, Fix, Fast, TWIME.

T и T+1 полигон предназначены только для функционального тестирования и собраны на технике, уступающей по производительности и некоторым другим параметрам конфигурации боевого контура. Временные параметры выполнения транзакций и доставки репликационных данных существенно отличаются от боевой системы и не могут быть использованы для построения алгоритмов.

Члены Информационно-технологического комитета ПАО Московская Биржа приняли к сведению представленную информацию.

## 16 | Игровая система срочного рынка ПАО Московская Биржа

Членам Информационно-технологического комитета ПАО Московская Биржа была представлена информация по игровым полигонам срочного рынка. Основной целью модернизации процесса обновления игровых полигонов является обеспечение непрерывности их функционирования, для чего предлагается осуществлять миграцию данных между полигонами в удобное для участника время.



Члены Информационно-технологического комитета рекомендовали ПАО Московская Биржа доработать предложенный алгоритм работы игровых полигонов.

## 17 | Изменения в подключении к тестовым контурам для клиентов с доступом по выделенным каналам и из зоны колокации

Московская биржа завершила процесс сегментации сетей в собственных центрах обработки данных и произвела физическое разделение на уровне сети серверов, обслуживающих боевой, тестовый и игровой сегменты.

Окончание процесса сегментации изменяет порядок доступа к тестовым контурам Московской биржи. Подробную сводную таблицу по изменениям можно найти по ссылке — <http://fs.moex.com/files/11250>.

Члены Информационно-технологического комитета ПАО Московская Биржа приняли к сведению представленную информацию.

## 18 | Новая схема подключения через шлюз на стороне ПАО Московская Биржа

Членам Информационно-технологического комитета ПАО Московская Биржа представили информацию об услуге подключения ВПТС и терминалов к торгам на рынках ASTS через ПО ASTS Bridge, расположенное на стороне Биржи и администрируемое её сотрудниками. Данное решение позволяет подключиться к системе без необходимости размещения дополнительных серверов в сетевом сегменте DMZ. Подробная информация размещена на сайте ПАО Московская Биржи по ссылке <http://moex.com/a2980>.

Члены Информационно-технологического комитета ПАО Московская Биржа приняли к сведению представленную информацию.

## 19 | Ход реализации плана по переносу функционала ПО «ЛУЧ» в части корпоративных действий в ПО «Файловый шлюз»

В ходе совместного заседания двух пользовательских Комитетов НКО АО НРД в соответствии с рекомендациями заседания Комитетов 14.12.2016 докладчики проинформировали о ходе проводимых НКО АО НРД работ по переносу функционала ПО «ЛУЧ» в ПО «Файловый

шлюз». Во время заседания участники обратили внимание НКО АО НРД на следующее:

- ПО «ЛУЧ» используется депонентами НРД в том числе для визуального контроля за принятыми/направленными сообщениями. Запрет на техническом уровне использования ПО «ЛУЧ» для пересылки сообщений на основе стандарта ISO20022 в марте 2017 года при отсутствии равноценной альтернативы представляется крайне несвоевременным решением, комфортный срок для подобных изменений — не ранее июля 2017 года. В настоящее время ПО НРДирект (WEB-кабинет корпоративных действий) и ПО «Файловый шлюз» не обеспечивают полноценную визуализацию полученных и переданных сообщений и их статусов.
- Внедряемое НРД альтернативное ПО «ЛУЧ» программное обеспечение не позволяет работать с журналами полученных/переданных сообщений, в результате чего возрастают риски ненадлежащей обработки сообщения.
- В случае одновременного отключения ПО «ЛУЧ» и установки обновлений ПО «Файловый шлюз» и НРДирект, реализуемых в настоящее время, существует вероятность возникновения невыявленных ошибок и, следовательно, остановка информационного взаимодействия.
- НРДирект не позволяет депозитариям и регистраторам направлять друг другу сообщения и контролировать их состояние. При этом регистраторы и многие депозитарии заинтересованы в использовании при документообороте сообщений формата XML.
- При переходе с ПО «ЛУЧ» на ПО «Файловый шлюз» возможно повторное скачивание сообщений, предназначенных получателю, а также отсутствует возможность разового экспорта в новое программное обеспечение всех контрагентов — участников транзита электронных документов.
- В настоящее время депоненты НРД плохо знакомы с технической документацией в отношении ПО «Файловый шлюз» и в большинстве технически не готовы к его использованию в марте 2017 года. С учётом отсутствия на текущий момент интеграции НРДирект и ПО «Файловый шлюз» существенно увеличиваются риски потери информации о новых корпоративных действиях в случае запрета использования для данного взаимодействия ПО «ЛУЧ».

Члены Комитета по развитию центра корпоративных действий и корпоративной информации и Комитета по взаимодействию с регистраторами и депозитариями НКО АО НРД приняли к сведению информацию о ходе реализации плана по переносу функционала ПО «ЛУЧ» в части корпоративных действий в ПО «Файловый шлюз».

## 20 | Отчет по работе Репозитария НКО АО НРД в 2016 году.

Члены Комитета пользователей репозитарных услуг при Правлении НКО АО НРД ознакомились с основными достижениями за 2016 год, а также результатами реализации проекта «Репозитарий 2.0». Участники комитета обсудили перевод участников репозитарных операций на WEB-кабинет Репозитария и Файловый шлюз ЭДО, информацию по объемам направляемой отчетности в Репозитарий, создание единого документа с инструкциями по заполнению анкет сообщений в Репозитарии. Члены Комитета пользователей репозитарных услуг при Правлении НКО АО НРД приняли к сведению представленную информацию и выработали следующие рекомендации:

1. Рассмотреть в рамках заседания Рабочей группы по технологическим вопросам целесообразность доработки bulk-формата для возможности принимать информацию со статусом SO.
2. Рассмотреть в рамках заседания Рабочей группы по технологическим вопросам целесообразность доработки по одновременной регистрации информации о двух разных статусах одной сделки в реестре договоров. Данный вопрос включен в пул вопросов, направленных Регулятору, и будет рассмотрен в рамках заседания Рабочей группы после получения ответа Банка России.
3. Поручить членам Комитета проинформировать НРД о сложностях, которые возникают в рамках предоставления информации в Репозитарий у корпоративных клиентов и нерезидентов.
4. Провести заседание Рабочей группы по технологическим вопросам в апреле 2017 года.

## 21 | Планы НКО АО НРД по доработке программного обеспечения Репозитария в 2017 году

Члены Комитета пользователей репозитарных услуг при Правлении НКО АО НРД ознакомились с планами НКО АО НРД по доработке программного обеспечения Репозитария в 2017 году. В ходе заседания участники обсудили влияние запланированных на 2017 год доработок на деятельность клиентов, работу тестовых контуров в 2017 году, а также основные направления развития бизнеса в 2017 году.

Члены Комитета пользователей репозитарных услуг при Правлении НКО АО НРД приняли к сведению представленную информацию с учетом следующих рекомендаций:

1. Направить участникам Комитета документ с перечнем доработок, включая их описание, запланирован-

ных Репозитарием к реализации в 2017 году.

2. Поручить членам Комитета принять участие в запланированном НРД опросе в рамках «mark to market valuation» и донести информацию о проводимом опросе до других подразделений их организаций (риск-менеджмент, фронт- и мидл-офис и другие заинтересованные подразделения).

## 22 | Итоги деятельности рабочей группы по дистанционным сервисам при Комитете по проведению расчетов и оформлению операций

В ходе встречи Рабочей группы по дистанционным сервисам при Комитете по проведению расчетов и оформлению операций обсуждались вопросы, касающиеся:

- Политики информационной безопасности Группы «Московская Биржа».

Повышение уровня безопасности при использовании WEB-сервисов: в составе Личного кабинета участника и клирингового терминала запланировано реализовать двухфакторную аутентификацию пользователей.

- Нового функционала раздела «Услуги удостоверяющего центра» Личного кабинета участника, позволяющего осуществлять все процессы взаимодействия клиента с удостоверяющим центром Биржи через ЛКУ.

В данный момент проводится внутреннее тестирование нового функционала, после его завершения с выбранной фокус-группой клиентов будет проведена опытно-промышленная эксплуатация.

Планируется реализовать плавную схему перевода клиентов на новый интерфейс взаимодействия с УЦ. Будет обеспечен переходный период, в течение которого клиент сможет воспользоваться как существующим, так и новым способом взаимодействия с УЦ в процессе получения услуг УЦ. Длительность переходного периода — от 3 до 6 месяцев. Необходимая информация о переходе будет своевременно доведена до клиентов.

В ходе встречи клиентами были озвучены пожелания о разъяснении планируемых изменений в процессе взаимодействия с удостоверяющим центром, о необходимости внедрения роли администратора безопасности, о реализации возможности работы с WEB-сервисами только из контролируемых сегментов сети, также были высказаны предложения по настройкам параметров парольной политики и др.

## **23 | Итоги деятельности рабочей группы по унификации стоимости технологических подключений при Информационно-технологическом комитете**

Участникам рабочей группы предложена для изучения и анализа новая модель тарификации — пологинная, суть которой состоит в унификации тарификации технического доступа на всех рынках Биржи. Формируется общая картина изменений в области технологических и информационных сервисов, основные подходы к построению модели тарификации с учетом специфики работы участников торгов и других клиентов Биржи, после чего

будет инициировано обсуждение предложений по тарифам. Члены рабочей группы и информационно-технологического комитета готовят комментарии по предложенной модели тарификации в части операционных рисков и каким-либо другим проблемам на стороне участников, а также оценочные данные по возможному увеличению расходов в связи с введением новой тарифной модели и свои предложения по тарифным опциям.