

**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) для голосования по вопросам повестки дня и принятия решений по вопросам, поставленным на голосование.

**Дата проведения заседания:** 19 февраля 2019 года.

**Место проведения заседания:** Москва, ул. Воздвиженка, дом 4/7, строение 1, зал 7.18.

№	Вопрос повестки дня	Принятое решение
1.	<p><b>Вопрос 1 повестки дня: Об итогах заседания Рабочей группы по рискам при Комитете по Срочному рынку ПАО Московская Биржа (от 12.02.2019)</b></p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Рекомендовать ПАО Московская Биржа повышать гарантийное обеспечение перед датами, когда торги на мировых рынках не производятся.</li> <li>2. Рекомендовать НКЦ в даты, когда торги на мировых рынках не проводятся, установить параметр <i>FutMonTime</i>(БА) (время нахождения активной заявки внутри коридора мониторинга) равным от 30 минут до 1 часа.</li> <li>3. Установить значение параметра <i>AutoShiftNumMR</i>(БА) (максимальное количество изменений границ Ценового коридора в течение Расчетного периода) равным 2.</li> <li>4.1. Не рекомендовать ПАО Московская Биржа при текущей ликвидности в стаканах календарных спредов предоставлять возможность устанавливать правило «Нетто» на уровне регистра учета позиций (7кк).</li> <li>4.2. Рекомендовать ПАО Московская Биржа рассмотреть техническую возможность рассчитывать риск портфелей для первого и второго фьючерсов (по дате исполнения) на основе правила «Нетто», для остальных фьючерсов на основе правила «Полунетто».</li> <li>5. Принять к сведению предложение Рабочей группы по рискам при Комитете по срочному рынку ПАО Московская Биржа по изменению регламента исполнения срочных контрактов и рекомендовать Рабочей группе до 30 апреля 2019 года провести дальнейшую проработку вопроса изменения регламента исполнения срочных контрактов с учетом требований о неразрывном исполнении опционов и фьючерсов на индексы и унификации времени по сбору рыночных данных для расчета индикативного курса по валютной паре доллар США – российский рубль, используемого для расчета стоимости шага цены.</li> <li>6. Принять к сведению информацию о переносе времени сбора рыночных данных на 18:43 для инструментов на все базовые активы, кроме российских акций.</li> </ol>

2.	<p><b>Вопрос 2 повестки дня: Об итогах заседания Рабочей группы по ликвидности при Комитете по Срочному рынку ПАО Московская Биржа (от 07.02.2019)</b></p>	<p>1. Одобрить решение Рабочей группы по ликвидности при Комитете по срочному рынку ПАО Московская Биржа рекомендовать ПАО Московская Биржа:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• при определении видимой части и минимального объема сопоставлять этот параметр с обязательствами для маркет-мейкеров на инструментах, где маркет-мейкеры на регулярной основе выполняют обязательства.</li> <li>• для фьючерсного контракта на курс доллар США/российский рубль рассмотреть варианты минимального объема скрытой части 500К, 1 млн., по фьючерсному контракту на нефть BRENT рассмотреть увеличение минимальной скрытой части.</li> <li>• при отображении «Айсберг» заявки в шлюзе добавить поле «full_amount_rest» - оставшийся объем в заявке (для всего айсберга, включая видимую часть).</li> <li>• в транзакциях cancel и move указывать id_ord1 (номер первой заявки).</li> </ul> <p>2. Рекомендовать ПАО Московская Биржа провести дополнительный анализ влияния запуска недельных опционов RTS и Si на объемы торгов месячных и квартальных опционов и представить информацию на очередное заседание Комитета по Срочному рынку ПАО Московская Биржа.</p> <p>3. Рекомендовать ПАО Московская Биржа проработать вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• одновременного исполнения опционных и расчетных фьючерсных контрактов;</li> <li>• определения курса валюты фьючерсных контрактов в день исполнения.</li> </ul> <p>4. Рекомендовать ПАО Московская Биржа утвердить Списки параметров поставочных фьючерсных контрактов на акции российских эмитентов и маржируемых опционов на фьючерсные контракты на акции российских эмитентов в новых редакциях, предложенные по итогам обсуждения Рабочей группы по ликвидности при Комитете по срочному рынку ПАО Московская Биржа.</p>
3.	<p><b>Вопрос 3 повестки дня: О дате релиза срочного рынка 6.2 и ключевых нововведениях</b></p>	<p>Принять к сведению предоставленную информацию о дате релиза срочного рынка 6.2 и ключевых технологических нововведениях.</p>
4.	<p><b>Вопрос 4 повестки дня: Об особенностях технической реализации проекта «Онлайн регистрация на срочном рынке»</b></p>	<p>Принять к сведению предоставленную информацию об особенностях технической реализации проекта «Онлайн регистрация на срочном рынке».</p>

5.	<b>Вопрос 5 повестки дня: Отказ от поддержки сервиса по переносу («проброске») рисков между валютным и срочным рынками</b>	Одобрить отказ от поддержки сервиса по переносу («проброске») рисков между валютным и срочным рынками Московской Биржи, с учетом того, что сервис продолжит действовать 2 года с момента отказа от поддержки.
6.	<b>Вопрос 6 повестки дня: Кросс-рыночный маркет-мейкинг</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Одобрить концепцию кросс-рыночного маркет-мейкинга на Московской Бирже.</li> <li>2. Рекомендовать ПАО Московская Биржа вынести проект кросс-рыночной маркет-мейкерской программы «Акции и фьючерсы на акции» на обсуждение Рабочей группы по ликвидности при комитете по срочному рынку ПАО Московская Биржа.</li> </ol>
7.	<b>Вопрос 7.1 повестки дня: О снятии заявок после окончания вечерней сессии</b>	Не вносить изменения во время снятия заявок после окончания вечерней сессии.
8.	<b>Вопрос 7.2 повестки дня: О составлении протоколов по итогам заседаний Комитета срочного рынка</b>	Одобрить предложенный ПАО Московская Биржа вариант ведения протокола на ближайшие очные заседания.
9.	<b>Вопрос 7.3 повестки дня: О проекте нормативного акта 4928-У</b>	Рекомендовать ПАО Московская Биржа направить письмо от имени Комитета по Срочному рынку ПАО Московская Биржа в адрес Банка России, содержащее аргументированную позицию Комитета по дате введения в действие нормативного акта 4928-У.