

Дайджест пользовательских комитетов Группы Московская Биржа май 2021

Оглавление

1. Утверждение Методики расчета фиксингов в новой редакции ¹	1
2. Кодекс добросовестного поведения на финансовом рынке ²	1
3. Согласование новой редакции спецификации фьючерсного контракта на сахар-сырец ³	2
4. Изменения баз расчета индексов Московской биржи ⁴	2
5. Маркетинговая программа на рынке акций по возвратной премии по сделкам клиентов – физических лиц ²	3
6. Предоставление профучастникам права выступать налоговыми агентами по доходам в виде дивидендов по акциям иностранных компаний ⁵	3
7. Разработка и публикация информационных материалов о применении новых тарифов на использование биржевых данных ⁵	4
8. Утверждение параметров проведения дискретного аукциона на валютном рынке в новой редакции ¹	4
9. Закрытие разделов ФОРТС, используемых для учета ценных бумаг в качестве обеспечения ²	4
10. Итоги ежегодного нагрузочного тестирования 17 апреля 2021 года ²	4
11. О совершенствовании (Upgrade) сетевой инфраструктуры сервиса FIFO MFIX Trade ²	4
12. Утверждение Правил допуска к участию в организованных торгах Московской биржи ^{1 3 6 7 8 9}	5

1. Утверждение Методики расчета фиксингов в новой редакции

Вниманию членов комитета по валютному рынку была представлена Методика расчета фиксингов в новой редакции с уточнением:

- порядка раскрытия информации о значениях фиксингов на сайте биржи;
- функций Комитета по валютному рынку.

Комитет рекомендовал утвердить Методику расчета фиксингов в новой редакции.

2. Кодекс добросовестного поведения на финансовом рынке

Кодекс добросовестного поведения был разработан биржей совместно с участниками торгов по инициативе Совета Биржи. Кодекс имеет рекомендательный характер, никакого контроля и мер за несоблюдение принципов кодекса вводить не планируется. В ближайшее время биржа планирует опубликовать перечень ответов на часто задаваемые вопросы и разъяснения по неоднозначным трактовкам нового кодекса. Информационно-технологический комитет принял информацию к сведению.

¹ Комитет по валютному рынку от 17.05.2021

² Информационно-технологический комитет от 13.05.2021

³ Комитет по срочному рынку от 4.05.2021

⁴ Индексный комитет от 27.05.2021

⁵ Комитет по фондовому рынку от 25.05.2021

⁶ Комитет по ценным бумагам с фиксированным доходом от 17 и 18.05.2021

⁷ Комитет по репо и кредитованию ценными бумагами от 18.05.2021

⁸ Комитет по рынку депозитов от 18.05.2021

⁹ Комитет по рынку кредитов от 18.05.2021

3. Согласование новой редакции спецификации фьючерсного контракта на сахар-сырец

Комитет по срочному рынку рекомендовал утвердить спецификацию фьючерсного контракта на сахар-сырец в новой редакции.

Для определения цены исполнения контракта в качестве курса доллара США к российскому рублю, определяемому в день исполнения контракта, будет использован фиксинг Московской биржи в соответствии с методикой расчета фиксингов, утвержденной биржей и опубликованной на ее сайте по состоянию на 12:30 мск. Исполнение контракта будет перенесено в дневную клиринговую сессию.

4. Изменения баз расчета индексов Московской биржи

Участники заседания Индексного комитета приняли следующие решения:

1. Рекомендовать исключить из состава базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС, вступающей в силу с 18 июня 2021 года, депозитарные расписки КИВИ ПиЭлСи.
2. На основании рекомендации Индексного комитета Московская биржа приняла решение отнести Фикс Прайс Групп Лтд и АО О'КЕЙ ГРУПП к потребительскому сектору и включить в базу расчета соответствующего отраслевого индекса.

Сводная таблица рекомендованных комитетом изменений в списках индексов Московской биржи (новые Базы расчета индексов вступают в силу с 18 июня 2021 года):

Индекс	Включены	Исключены
Индекс МосБиржи и Индекс РТС		QIWI PLC (КИВИ ПиЭлСи), ДР иностранного эмитента на акции
Индекс широкого рынка	Fix Price Group Ltd (Фикс Прайс Групп Лтд), ДР иностранного эмитента на акции АО О'КЕЙ ГРУПП, ДР иностранного эмитента на акции ПАО ГК «Сегежа», ао	ПАО «Иркутскэнерго», ао ПАО «МОСТОТРЕСТ», ао ПАО «МРСК Урала», ао
Индекс голубых фишек	ПАО «НЛМК», ао	Mail.ru Group Limited (Мэйл.ру Групп Лимитед), ДР иностранного эмитента на акции
Индекс малой и средней капитализации	Fix Price Group Ltd (Фикс Прайс Групп Лтд), ДР иностранного эмитента на акции АО О'КЕЙ ГРУПП, ДР иностранного эмитента на акции ПАО ГК «Сегежа», ао ПАО «Белуга Групп», ао	ПАО ГК ПИК, ао
Индекс потребительского сектора	Fix Price Group Ltd (Фикс Прайс Групп Лтд), ДР иностранного эмитента на акции АО О'КЕЙ ГРУПП, ДР иностранного эмитента на акции	
Индекс электроэнергетики		ПАО «Иркутскэнерго», ао ОАО "МРСК Урала", ао

3. Рекомендовать установить следующие значения коэффициентов free-float:

Код	Наименование	Новый free-float
AMEZ	ПАО «Ашинский метзавод», ао	15%
ENRU	ПАО «Энел Россия», ао	38%
FIXP	Фикс Прайс Груп Лтд, ДР иностранного эмитента на акции	21%
HYDR	ПАО «РусГидро», ао	25%
LNZL	ПАО «Лензолото», ао	5%
MAGN	ПАО «ММК», ао	19%
MGNT	ПАО «Магнит», ао	63%
MSTT	ПАО «МОСТОТРЕСТ», ао	3%
MTSS	ПАО «МТС», ао	42%
MVID	ПАО «М.видео», ао	24%
NAUK	ПАО НПО «Наука», ао	12%
OKEY	АО О'КЕЙ ГРУПП, ДР иностранного эмитента на акции	26%
SELG	ПАО «Селигдар», ао	28%
SELGP	ПАО «Селигдар», ап	25%
SGZH	ПАО Группа Компаний «Сегежа», ао	24%
SMLT	ПАО «Группа Компаний «Самолет», ао	10%
SVET	ПАО «Светофор Групп», ао	10%
VTBR	ПАО Банк ВТБ, ао	36%

5. Маркетинговая программа на рынке акций по возвратной премии по сделкам клиентов – физических лиц

В последнее время к торгам на фондовом рынке подключается большое количество клиентов - физических лиц. С целью повышения финансовой грамотности и дополнительного стимулирования участников торгов биржа ввела маркетинговую программу в отношении инструментов рынка акций по сделкам на вторичных торгах. Биржа предлагает участнику торгов возвратную премию в размере 50% от комиссии сверх установленного порога по сделкам его клиентов - физических лиц. Маркетинговая программа действует с 01.04.2021 по 31.12.2022 в отношении всех инструментов рынка акций. К участию в программе допускаются все участники торгов автоматически при условии размещения на своих страницах в сети Интернет и/или в мобильном приложении ссылки на обучающий курс для начинающих инвесторов school.moex.com. Индивидуальный порог для расчёта премии определяется исходя из величины комиссии физического лица за первый квартал 2021 года. В период действия акции 50% комиссии от превышения порогового значения возвращается брокеру в виде рибейта. При этом из выплаты исключаются сделки НФТ-клиентов, клиентов, чей объем торгов хотя бы в одном месяце превысил 4 млрд руб., а также клиентов физических лиц – маркетмейкеров.

6. Предоставление профучастникам права выступать налоговыми агентами по доходам в виде дивидендов по акциям иностранных компаний

Комитет по фондовому рынку заслушал информацию о налогообложении доходов, получаемых от источников за пределами Российской Федерации, и рассмотрел возможность предоставления профессиональным участникам права выступать налоговыми агентами по доходам в виде дивидендов по акциям иностранных компаний, с внесением изменений в законодательство. По итогам заседания комитет рекомендовал инициировать процесс внесения соответствующих изменений в законодательство.

7. Разработка и публикация информационных материалов о применении новых тарифов на использование биржевых данных

Члены комитета по фондовому рынку заслушали и приняли к сведению информацию о создании на официальном сайте Московской биржи раздела, содержащего специальные условия и тарифы использования биржевой информации в альтернативных информационно-торговых системах.

8. Утверждение параметров проведения дискретного аукциона на валютном рынке в новой редакции

Комитет по валютному рынку рекомендовал утвердить параметры проведения дискретного аукциона на валютном рынке в новой редакции.

В Параметры проведения дискретного аукциона на валютном рынке внесены уточнения в целях устранения возможной ошибки округления при выставлении корректирующих заявок для закрытия нетто-позиции НКЦ в случае, когда в дискретном аукционе принимает участие большое количество заявок участников (десятки тысяч), уточнен порядок расчета количества лотов и цен в таких корректирующих заявках.

9. Закрытие разделов ФОРТС, используемых для учета ценных бумаг в качестве обеспечения

Сервис «Счета FORTS» был разработан более 15 лет назад и устарел, в настоящее время существуют сервисы, предоставляющие более широкие возможности для участников клиринга на срочном рынке. В настоящее время технология Единого пула обеспечения полностью покрывает возможности сервиса «Счета FORTS», устаревший сервис дублируется. По состоянию на 01.05.2021 сервис «Счета FORTS» используют только четаре участника торгов, которые уже используют технологию Единого пула по другим своим счетам. Биржа предлагает прекратить открывать разделы FORTS с 01.09.2021, текущие открытые разделы FORTS будут отвязаны по договорённости с участниками клиринга. С четырьмя участниками торгов будет проведена адресная работа по переходу на технологию Единого пула обеспечения. На протяжении всего переходного периода для участников клиринга будет доступна возможность пользоваться технологией «Счета FORTS» параллельно с технологией Единого пула.

10. Итоги ежегодного нагрузочного тестирования 17 апреля 2021 года

Членам информационно-технологического комитета представлен отчет по ежегодному нагрузочному тестированию ключевых систем биржи 17 апреля 2021 года. В тестировании приняли участие 22 участника торгов, Банк России и информационные вендоры.

В ходе этого мероприятия на промышленном контуре торговых, клиринговых и всех смежных систем проигрывался поток заявок, в несколько раз превышающий обычные нагрузки с целью выявления «узких мест», направлений для дальнейшего улучшения, а также получения уверенности в том, что весь программно-аппаратный комплекс биржи и участников торгов сможет справиться с возможными серьезными всплесками пользовательской активности, вызванной внешними событиями. Тестирование проведено в соответствии с планом и признано успешным.

11. О совершенствовании (Upgrade) сетевой инфраструктуры сервиса FIFO MFIX Trade

Запущенный в 2020 году сервис FIFO MFIX Trade стал флагманским транзакционным сервисом для фондового и валютного рынков, что подтверждается высоким спросом. Вместе с тем поведение клиентов указывает на попытки поиска на оборудовании биржи «лучшего» порта, а также поступают запросы на снижение сетевого jitter. Проведена масштабная работа по тестированию широкого спектра оборудования разных вендоров, в результате подобран оптимальный вариант. Новая сетевая инфраструктура для сервиса FIFO MFIX Trade готова к внедрению. Тестирование запланировано на 26.06.2021, запуск в промышленную эксплуатацию – 28.06.2021. Порты на новом оборудовании будут выбираться случайным образом для соблюдения принципов технологического Fair Play. Изменений в части адресации и конфигурации сетевой части не требуется. Изменений в software части сервиса FIFO MFIX Trade не будет.

12. Утверждение Правил допуска к участию в организованных торгах Московской биржи
Комитеты по валютному, срочному рынку, по ценным бумагам с фиксированным доходом, по репо и кредитованию ценными бумагами, по рынку депозитов, по рынку кредитов утвердили Правила допуска к участию в организованных торгах ПАО Московская Биржа Часть I. Общая часть в новой редакции.

По сравнению с действующей редакцией соответствующей части Правил допуска проект новой редакции содержит в числе прочих следующие основные изменения:

- установлено требование о регистрации на бирже фактических получателей дохода в случаях, когда стороной по сделке выступает иностранная или международная организация (для целей выполнения НКЦ функций налогового агента);
- уточнено требование об указании при регистрации Участниками торгов клиентов признака квалифицированного/неквалифицированного инвестора;
- установлено, что на рынке депозитов допускается заключение управляющими компаниями сделок за счет средств целевых капиталов некоммерческих организаций.

Также в Правила допуска внесены отдельные уточнения юридико-технического и редакционного характера.