

Дайджест пользовательских комитетов Группы Московская Биржа август 2021

Оглавление

1. О текущем статусе проекта Торговый линк на рынке иностранных акций ¹	1
2. О порядке проведения корпоративных действий по акциям иностранных компаний ¹	1
3. О проведении торгов на рынках Московской биржи в дни государственных праздников ¹	2
4. Об изменениях в Правилах листинга Московской биржи ¹	2
5. Программы поддержки ликвидности иностранных акций с расчетами в иностранной валюте ¹ ...2	
6. О маркировке инвестиционных инструментов, требующих тестирования после 1 октября 2021 года ¹	3
7. Изменения состава баз расчета индексов Московской биржи ²	3
8. О рекомендациях по установлению коэффициентов free-float ²	3
9. О планах по передаче информации для идентификации владельцев ценных бумаг в рамках директивы SRD II ³	4
10. О планируемом введении тарифов за услуги, связанные с корпоративными действиями по иностранным ценным бумагам ³	4
11. Об изменении тарифов на депозитарные услуги ³	4

1. О текущем статусе проекта Торговый линк на рынке иностранных акций

Участники заседания комитета по фондовому рынку приняли к сведению информацию о торговом линке на рынке иностранных акций.

Комитет одобрил создание долларového стакана по бумагам, входящим в индекс DJIA, имеющих кредитный рейтинг не ниже инвестиционного одного из топ-3 рейтинг агентств (S&P, Fitch, Moody's) и приемлемый внутренний рейтинг НКЦ.

Также было одобрено использование схемы pre-matched: при пересечении заявки с признаком «Дополнительная ликвидность» и котировки провайдера ликвидности появляется запись в TRADES со статусом Pre-matched («сделка ожидает подтверждения исполнения», предполагает блокировку обеспечения по котировке «Дополнительной ликвидности»)

Преимущества схемы заключаются в расширении торговых возможностей для участников, а именно:

- расширение коротких продаж перед Record Date;
- перенос обязательств и передача дохода через record date;
- возможность предоставления коротких позиций клиентам перед record Date (снятие запрета коротких продаж с инструментами, подпадающими под НК США).

2. О порядке проведения корпоративных действий по акциям иностранных компаний

Комитет по фондовому рынку одобрил предложенный порядок проведения корпоративных событий по иностранным акциям сектора MOEX Global:

- 1) Заблаговременное оповещение о корпоративных событиях Московской биржей.
- 2) Обеспечение торгов без приостановок при проведении существенных корпоративных событий по иностранным акциям.
- 3) Обеспечение проведения корпоративных событий в строгом соответствии с получаемой от вышестоящих депозитариев информацией, проведение многократного информирования о

¹ Комитет по фондовому рынку от 24.08.2021

² Индексный комитет от 26.08.2021

³ Комитет по расчетно-депозитарной деятельности и тарифам НРД от 26.08.2021

планируемом и проводимом корпоративном событии, проведение торгов после корпоративного события в самое раннее допустимое время.

3. О проведении торгов на рынках Московской биржи в дни государственных праздников

В 2022 году предусматриваются следующие нерабочие дни: с 1 по 9 января; 23 февраля; с 6 по 8 марта; с 1 по 3 мая и с 7 по 10 мая; 11 по 13 июня; 4 по 6 ноября; 31 декабря.

Для повышения эффективности торговых стратегий участников рынка и уменьшения рисков, связанных с отклонением цены на один и тот же актив на разных рынках, Комитет по фондовому рынку учитывает важность обеспечения максимального пересечения периода торгов с другими биржами. В 2022 году в дни государственных праздников планируется торговать инструментами, обладающими наибольшим потенциалом арбитража с международными площадками.

4. Об изменениях в Правилах листинга Московской биржи

Комитет по фондовому рынку одобрил изменения в Правила листинга и рекомендовал их утвердить.

Основные изменения в Правилах листинга (ПЛ) Московской биржи:

1. Внесение изменений в Приложения 5, 7-10 к ПЛ, устанавливающие требования по раскрытию информации эмитентами/УК. Изменения вносятся для приведения в соответствие Положением № 714-П и Указанием № 5609-У.
2. Для эмитентов-концессионеров облигаций, включенных в КС1 и КС2, исключается требование о раскрытии информации в отношении концессионных соглашений и деятельности эмитента по реализации концессионного соглашения (проектов в рамках соглашения) в порядке и объеме, установленном правилами (требованиями), утвержденными биржей (п. 2.6.1 Приложения 2 к ПЛ). Указанное раскрытие эмитентами-концессионерами будет осуществляться по Положению №714-П.
3. Урегулирование ситуации, когда дивидендная политика эмитентов, инкорпорированных в иных юрисдикциях, определена не документом, утвержденным Советом директоров, а самим решением Совета директоров.
4. Предусматривается возможность согласования эмиссионной документации (шаблона) сразу на несколько одинаковых/стандартных выпусков биржевых облигаций в рамках программы (сейчас предварительное рассмотрение распространяется на конкретный выпуск биржевых облигаций).
5. Для акций, ранее включенных в Список (торгуемые или неторгуемые), будет установлен срок переходного периода в течение 6 месяцев с для вступления в силу изменений в ПЛ.

5. Программы поддержки ликвидности иностранных акций с расчетами в иностранной валюте

Реализация на Московской бирже программ MOEX GLOBAL USD и MOEX LINK USD для ценных бумаг иностранных эмитентов предусматривает следующий график:

27.09.2021 - запуск программы MOEX GLOBAL USD

Декабрь 2021 - запуск программы MOEX LINK USD

Обязательства маркетмейкеров и провайдеров ликвидности: предельный спрэд двусторонних заявок/котировок; минимально допустимый объем подаваемых заявок/котировок; период времени поддержания двусторонних заявок/котировок; достаточный объем сделок участника программы. Преимущества участников: единые прозрачные условия участия; поддержание заявок/котировок как за свой счет, так и за счет своих клиентов: для провайдеров ликвидности выставление котировок без гарантийного обеспечения; ежедневное информирование о результатах работы; повышение статуса участника торгов, принявшего маркетмейкерские обязательства и/или получившего статус провайдера ликвидности.

Комитет по фондовому рынку принял к сведению данную информацию.

6. О маркировке инвестиционных инструментов, требующих тестирования после 1 октября 2021 года

Маркировка сложных финансовых инструментов осуществляется на фондовом рынке Московской биржи в информационных целях для контроля брокером доступа собственных клиентов к сложным финансовым инструментам.

На тестовом контуре T1 фондового рынка (INET_GATEWAY) обновлены значения маркировки сложных финансовых продуктов. Добавлены специальные инструменты, для которых заполняется поле COMPLEXPRODUCT (Сложный финансовый продукт) таблицы SECURITIES (Финансовые инструменты).

В последующих версиях шлюзового интерфейса будет добавлена справочная таблица с перечнем значений для маркировки, перечислимый тип TComplexProduct будет удален. Публикация подробной информации последует вместе с объявлением состава следующего релиза торговых систем.

Добавляется описание интерфейса брокера на фондовом рынке IFCBroker38, включающее обновленный перечень значений типа TComplexProduct, а также изменения относительно версии IFCBroker37 обновлены на FTP-сервере.

В составе сентябрьского релиза маркировки A, B, C, D будут заменены на 10, 11, 800, -1, соответственно.

7. Изменения состава баз расчета индексов Московской биржи

Индексный комитет рекомендовал сформировать базы расчета индексов акций, которые будут действовать с 17 сентября 2021 года.

Обыкновенные акции ПАО "Россети" исключаются из базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС. Обыкновенные акции МК ПАО "ЭН+ ГРУП", а также депозитарные расписки Юнайтед Медикал Груп КИ ПиЭлСи вошли в состав листа ожидания на включение, а обыкновенные акции компании ПАО "Группа ЛСР" представлены в листе ожидания на исключение.

Депозитарные расписки Юнайтед Медикал Груп КИ ПиЭлСи, допущенные к торгам впервые, включаются в базу расчета Индекса акций широкого рынка, который покинут обыкновенные акции ПАО "ТГК-2".

База расчета Индекса голубых фишек изменится за счет включения в состав депозитарных расписок ТиСиЭс Груп Холдинг ПиЭлСи и исключения депозитарных расписок Икс 5 Ритейл Груп Н.В.

В состав базы расчета Индекса средней и малой капитализации будут добавлены депозитарные расписки Мэйл.ру Груп Лимитед и Юнайтед Медикал Груп КИ ПиЭлСи. Покинут индекс обыкновенные акции ПАО "Аптечная сеть 36.6".

На основании рекомендации Индексного комитета Биржа приняла решение об отраслевой классификации депозитарных расписок Юнайтед Медикал Груп КИ ПиЭлСи и о включении в состав соответствующего отраслевого индекса - Индекса потребительского сектора.

Подробная информация о базах расчета индексов Московской биржи, действующих с 17 сентября 2021 года, размещена [на сайте](#).

8. О рекомендациях по установлению коэффициентов free-float

Индексный комитет рекомендовал установить коэффициенты free-float для следующих ценных бумаг:

Код	Наименование	Новый free-float
BELU	ПАО "Белуга Групп", ао	29%
СВОМ	ПАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК", ао	21%
DSKY	ПАО "Детский мир", ао	69%
ENPG	МКПАО "ЭН+ ГРУП", ао	13%
ETLN	ЭТАЛОН ГРУП ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции	53%

FIXP	Фикс Прайс Груп Лтд, ДР иностранного эмитента на акции	28%
GEMC	Юнайтед Медикал Груп КИ ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции	44%
EM44	Юнайтед Медикал Груп КИ ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции	44%
NHRU	ХэдХантер Групп ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции	59%
HMSG	ГМС ГИДРАВЛИК МАШИНС ЭНД СИСТЕМС ГРУП ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции	17%
LIFE	ПАО "Фармсинтез", ао	43%
NAUK	ПАО НПО "Наука", ао	16%
OZON	Озон Холдингс ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции	27%
SELGP	ПАО "Селигдар", ап	17%

9. О планах по передаче информации для идентификации владельцев ценных бумаг в рамках директивы SRD II

Национальный расчетный депозитарий представил информацию о планах по реализации сервиса по передаче информации для идентификации владельцев ценных бумаг в рамках Директивы SRDII. Оценка разработки данного сервиса проведена на основании рекомендаций комитета по расчетно-депозитарной деятельности и тарифам.

Сервис позволит направлять ответ на запрос эмитента/агента эмитента на идентификацию владельцев по ценным бумагам, учитываемым через НРД или другие депозитарии, в формате XML ISO20022 с помощью единого канала взаимодействия через НРД (файловый шлюз/загрузка файла в Web-кабинете).

Для подключения к сервису необходимо будет заключить с НРД индивидуальный договор и выдать доверенность на право передавать информацию эмитенту/агенту эмитента от имени клиента. Сервисом можно будет воспользоваться на платной основе. Планируемый срок реализации сервиса – I-II квартал 2022 года.

10. О планируемом введении тарифов за услуги, связанные с корпоративными действиями по иностранным ценным бумагам

На заседании комитета по расчетно-депозитарной деятельности и тарифам НРД были представлены планы по введению тарифов за услуги, связанные с корпоративными действиями по иностранным ценным бумагам, которые будут покрывать издержки депозитария при работе с этими инструментами. Также была заслушана информация о намерениях реализовать сервис по конвертации депозитарных расписок с использованием форматов инструкций по корпоративным действиям согласно рыночной практике.

Комитет принял к сведению полученную информацию.

11. Об изменении тарифов на депозитарные услуги

Члены комитета по расчетно-депозитарной деятельности и тарифам НРД были проинформированы о том, что предлагается внести в тарифы изменения, связанные со снижением платы за хранение и проведение операций с дефолтными ценными бумагами, находящимися на счетах депо, для конкурсных управляющих, а также внести корректировки в отношении области применения тарифов.

Комитет рекомендовал одобрить тарифы на депозитарные услуги.