

**Дайджест пользовательских комитетов Группы Московская Биржа
март 2022**

Оглавление

1. О запуске однодневных фьючерсных контрактов с автопродолгацией на курс иностранной валюты к российскому рублю (вечный фьючерс) ¹	1
2. Тарифное стимулирование ликвидности ¹	2
3. Согласование новой редакции Спецификации фьючерсного контракта на Индекс РТС, Спецификации фьючерсного контракта на Индекс РТС (мини), Спецификации фьючерсного контракта на Индекс МосБиржи, Спецификации фьючерсного контракта на Индекс МосБиржи (мини), Спецификации фьючерсных контрактов на Отраслевые Индексы ¹	2
4. О рекомендации по утверждению Правил организованных торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов в новой редакции ²	3
5. Изменение параметров расчетного фьючерсного контракта на курс китайский юань-российский рубль и запуске нового расчетного фьючерсного контракта на курс гонконгский доллар - российский рубль ¹	3
6. Запуск нового расчетного фьючерсного контракта на курс доллара США - гонконгский доллар ¹	3

1. О запуске однодневных фьючерсных контрактов с автопродолгацией на курс иностранной валюты к российскому рублю (вечный фьючерс)

Комитет по срочному рынку одобрил параметры однодневных фьючерсных контрактов с автопродолгацией на курс иностранной валюты к российскому рублю и рекомендовал утвердить соответствующие спецификацию и список параметров.

Вечный фьючерс - новый тип инструментов срочного рынка. Главное его отличие от существующих контрактов – ежедневное автоматическое продление на один день с ежедневной уплатой swar-разницы. В связи с наличием клиентского спроса предлагается запустить вечные фьючерсы на следующие базисные активы:

Параметры контрактов

Наименование контракта	Однодневный фьючерсный контракт с автопродолгацией на курс доллар США – российский рубль	Однодневный фьючерсный контракт с автопродолгацией на курс евро – российский рубль	Однодневный фьючерсный контракт с автопродолгацией на курс британский фунт – российский рубль	Однодневный фьючерсный контракт с автопродолгацией на курс китайский юань – российский рубль
Код контракта	USDRUBF	EURRUBF	GBPRUBF	CNYRUBF
Тип контракта	Расчетный			
Базовый актив	Курс доллара США к российскому рублю	Курс евро к российскому рублю	Курс британского фунта к российскому рублю	Курс китайского юаня к российскому рублю
Лот контракта	1000 USD	1000 EUR	1000 GBP	1000 CNY
Минимальный шаг цены	0,01 RUB			

¹ Комитет по срочному рынку от 25.03.2022

² Комитет по валютному рынку от 18.03.2022

Стоимость минимального шага цены	10 RUB
Котировка	В российских рублях за лот
Тарифная группа	Валютные контракты
ГО	Равно обеспечению по соответствующим фьючерсным контрактам

2. Тарифное стимулирование ликвидности

Комитет по срочному рынку принял к сведению предоставленную информацию о тарифном стимулировании ликвидности. Предлагаемое изменение тарифов состоит из 2-х независимых частей:

1. Отмена комиссионного сбора с пассивной стороны сделки с одновременным увеличением в 3 раза сбора с активной стороны
2. Отмена скидок по скальперским сделкам.

3. Согласование новой редакции Спецификации фьючерсного контракта на Индекс РТС, Спецификации фьючерсного контракта на Индекс РТС (мини), Спецификации фьючерсного контракта на Индекс МосБиржи, Спецификации фьючерсного контракта на Индекс МосБиржи (мини), Спецификации фьючерсных контрактов на Отраслевые Индексы

Члены Комитета по срочному рынку рекомендовали утвердить новую редакцию Спецификации фьючерсного контракта на Индекс РТС, Спецификации фьючерсного контракта на Индекс РТС (мини), Спецификации фьючерсного контракта на Индекс МосБиржи, Спецификации фьючерсного контракта на Индекс МосБиржи (мини), Спецификации фьючерсных контрактов на Отраслевые Индексы.

Рекомендации касаются следующих изменений в спецификациях:

	Действующая редакция Спецификаций	Новая редакция Спецификаций
Стандартный алгоритм	<p>Это правило применяется при условии, что в течение всего Периода расчета суммарная доля стоимости всех акций, используемых для расчета Индекса РТС (далее – Акции; общий вес Акции в Индексе РТС, соответственно), в каждую секунду Периода расчета составляла не менее 75% (далее – условие определения текущей Расчетной цены). При этом общий вес Акции в Индексе РТС рассчитывается по состоянию на каждую секунду Периода расчета и только в отношении тех Акции, торги которыми проводились Биржей в данный момент времени (за исключением торгов Акциями, проводимых в форме дискретного аукциона).</p>	<p>Это правило применяется при условии, что в течение всего Периода расчета суммарная доля стоимости всех акций, используемых для расчета Индекса РТС (далее – Акции; общий вес Акции в Индексе РТС, соответственно), в каждую секунду Периода расчета составляла не менее 75% (далее – условие определения текущей Расчетной цены). При этом для расчета общего веса Акции в Индексе РТС используются веса Акции, определенные на закрытие предыдущего торгового дня, и только в отношении тех Акции, торги которыми проводились Биржей в течение Периода расчета (за исключением торгов Акциями, проводимых в форме дискретного аукциона).</p>
Альтернативный алгоритм	<p>При этом общий вес Акции в Индексе РТС рассчитывается по состоянию на каждую секунду Расчетного времени и только в отношении тех Акции, торги которыми проводились Биржей в данный момент времени (за исключением торгов Акциями, проводимых в форме дискретного аукциона).</p>	<p>При этом для расчета общего веса Акции в Индексе РТС используются веса Акции, определенные на закрытие предыдущего торгового дня, и только в отношении тех Акции, торги которыми проводились Биржей в течение Расчетного времени (за исключением торгов Акциями, проводимых в форме дискретного аукциона).</p>

4. О рекомендации по утверждению Правил организованных торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов в новой редакции

Членам Комитета по валютному рынку было предложено рассмотреть новую редакцию Правил торгов на валютном рынке, предусматривающую право биржи проводить проверки корректности использования предоставленной биржевой информации у клиентов участников торгов (информационный аудит), а также обязанность участника торгов проинформировать своих клиентов о данном праве Московской биржи. Комитет рекомендовал утвердить Правила организованных торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов в новой редакции.

5. Изменение параметров расчетного фьючерсного контракта на курс китайский юань-российский рубль и запуске нового расчетного фьючерсного контракта на курс гонконгский доллар - российский рубль

Комитет по срочному рынку рекомендовал утвердить следующие Спецификацию и Список параметров фьючерсных контрактов на курс иностранной валюты к российскому рублю в новой редакции:

Наименование контракта	Код базисного актива	Базисный актив	Порядок указания цены Контракта в заявке	Лот контракта	Минимальный шаг цены	Стоимость минимального шага цены
Фьючерсный контракт на курс гонконгский доллар – российский рубль	HKD	Курс гонконгский доллар к российскому рублю	в российских рублях за 1 HKD	1 000 HKD	0,01 RUB	10 RUB

6. Запуск нового расчетного фьючерсного контракта на курс доллара США - гонконгский доллар

Комитет по срочному рынку рекомендовал утвердить новую редакцию Спецификации и Списка параметров расчетных фьючерсных контрактов на курс доллара США к иностранной валюте:

Наименование контракта	Фьючерсный контракт на курс доллар США – гонконгский доллар
Код контракта	UHKD
Тип контракта	Расчетный
Базовый актив	Курс доллара США к гонконгскому доллару
Лот контракта	1000 USD
Минимальный шаг цены	0,001 HKD
Стоимость минимального шага цены	1 HKD
Цена исполнения	Курс доллара США к гонконгскому доллару, выраженный в гонконгских долларах за 1 (один) доллар США, опубликованный по адресу https://www.federalreserve.gov/releases/h10/current/ на пятницу, предшествующую 3 (третьему) вторнику месяца и года исполнения контракта
Время опубликования курса доллара США к иностранной валюте	В понедельник в 16:15 по вашингтонскому времени
Последний день заключения и день исполнения контракта	3 (третий) вторник месяца и года исполнения Контракта
Периодичность листинга	Ежеквартально

