

## Дайджест пользовательских комитетов Группы Московская Биржа май 2022

### Оглавление

1. Ограничение агрессивности рыночных заявок на всем торговом периоде на валютном рынке <sup>1</sup> ..	1
2. Новые валютные пары на валютном рынке в 2022 году <sup>1</sup> .....	1
3. Модификация алгоритма TWAP <sup>1</sup> .....	1
4. О рекомендациях по изменению состава баз расчета индексов и по установлению коэффициентов free-float <sup>2</sup> .....	1

#### **1. Ограничение агрессивности рыночных заявок на всем торговом периоде на валютном рынке**

Членам Комитета по валютному рынку была представлена инициатива распространения механизма ограничения агрессивности рыночных заявок на весь период торговой сессии валютного рынка с 7:00 до 23:50. Данный механизм показал свою эффективность в период утренних торгов и позволит минимизировать количество пробоев при использовании рыночных заявок в течение всего торгового дня на разряженном рынке.

Комитету было предложено увеличение коэффициента максимального допустимого отклонения от лучшей встречной заявки до 1% для всех валютных пар.

Участники заседания одобрили предложенную инициативу.

#### **2. Новые валютные пары на валютном рынке в 2022 году**

Комитет по валютному рынку заслушал информацию о рассматриваемых к запуску валютных парах и развитии расчетов в национальных валютах. В ближайшие месяцы на валютном рынке планируются к запуску торги армянским драмом и эмиратским дирхамом.

Комитет принял к сведению полученную информацию и рекомендовал рассмотреть возможность синхронизации корреспондентских счетов между НКО НКЦ (АО) и НКО АО НРД по всем валютам, доступным на валютном рынке Московской биржи.

#### **3. Модификация алгоритма TWAP**

Комитет по валютному рынку заслушал информацию о введении дополнительных проверок и уведомлений в механизме выставления алгоритмических пакетов заявок (TWAP). С целью минимизации операционных ошибок при выставлении заявок были предложены следующие доработки:

- дополнительное уведомление о максимальном объеме алгопакета
- контроль объемов связанных заявок в TWAP.

Комитет одобрил введение дополнительных уведомлений в механизме выставления алгоритмических пакетов заявок.

#### **4. О рекомендациях по изменению состава баз расчета индексов и по установлению коэффициентов free-float**

Индексный комитет рассмотрел на своем заседании вопросы об изменении состава баз расчета индексов и об изменении коэффициента free-float по ряду эмитентов.

Базу расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС покидают обыкновенные акции ПАО «ФСК ЕЭС».

База расчета Индекса голубых фишек и Индекса МосБиржи инноваций остается без изменений.

<sup>1</sup> Комитет по валютному рынку от 16.05.2022

<sup>2</sup> Индексный комитет от 26.05.2022

В Базу расчета Индекса средней и малой капитализации войдут обыкновенные акции ПАО «ГК «Самолет», ПАО «Русская Аквакультура» и ПАО «Аптечная сеть 36,6». При этом покинут индекс обыкновенные акции ПАО «Корпорация ВСМПО-АВИСМА», ПАО «Акрон», МКПАО «Лента», а также ПАО «Группа Ренессанс Страхование».

База расчета Индекса нефти и газа изменится за счет исключения привилегированных акций ПАО «АНК Башнефть» и обыкновенных акций ПАО «НК РуссНефть».

Обыкновенные акции ПАО «СПБ Биржа» войдут в состав Баз расчета Индекса акций широкого рынка и Индекса финансов, а обыкновенные акции ПАО «МРСК Урала» будут включены в Индекс акций широкого рынка и Индекс электроэнергетики.

Обновлены корзины индексов активов пенсионных накоплений.

#### Сводная таблица основных изменений в списках индексов Московской биржи

Индекс	Включены	Исключены
Индекс МосБиржи и РТС		ПАО «ФСК ЕЭС», ао
Индекс широкого рынка	ПАО «СПБ Биржа», ао ПАО «МРСК Урала», ао	
Индекс средней и малой капитализации	ПАО «ГК "Самолет", ао ПАО «Русская Аквакультура», ао ПАО «Аптечная сеть 36,6», ао	ПАО «Корпорация ВСМПО-АВИСМА», ао ПАО «Акрон», ао МКПАО «Лента», ао ПАО «Группа Ренессанс Страхование», ао
Индекс нефти и газа		ПАО «АНК Башнефть», ап ПАО «НК РуссНефть», ао
Индекс финансов	ПАО «СПБ Биржа», ао	
Индекс электроэнергетики	ПАО «МРСК Урала», ао	
Индекс МосБиржи 10	ПАО «НОВАТЭК», ао Яндекс Н.В., акции иностранного эмитента ТиСиЭс Груп Холдинг ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции ПАО «Сбербанк», ап	ПАО «Алроса», ао ПАО «Газпром», ао ПАО «ЛУКОЙЛ», ао ПАО «НК «Роснефть», ао ПАО «Сбербанк», ао Банк ВТБ (ПАО), ао
Субиндекс акций пенсионных накоплений	РУСАЛ ОК МКПАО, ао	ПАО «Транснефть», ап

#### Сводная таблица изменений количества акций, учитываемого в индексах Московской биржи и листах ожидания, а также коэффициентов free-float

Код	Наименование	Действующее количество акций	Новое количество акций	Действующий free-float	Новый free-float
DSKY	ПАО "Детский мир", ао	739 000 000	739 000 000	69%	55%
GEMA	ПАО "Международный Медицинский Центр Обработки и Криохранения Биоматериалов", ао	1 492 992	1 492 992	15%	18%
GMKN	ПАО "ГМК "Норильский никель", ао	153 654 624	153 654 624	38%	37%

ISKJ	ПАО "Институт Стволовых Клеток Человека", ао	85 000 000	85 000 000	18%	13%
KAZT	ПАО "КуйбышевАзот", ао	234 147 999	234 147 999	35%	31%
MOEX	ПАО Московская Биржа, ао	2 276 401 458	2 276 401 458	63%	64%
MRKV	ПАО "МРСК Волги", ао	188 307 958 732	188 307 958 732	21%	20%
MSNG	ПАО "Мосэнерго", ао	39 749 359 700	39 749 359 700	15%	20%
MTLR	ПАО "Мечел", ао	416 270 745	416 270 745	43%	42%
MVID	ПАО "М.видео", ао	179 768 227	179 768 227	24%	25%
NAUK	ПАО НПО "Наука", ао	11 789 500	11 789 500	16%	6%
PHOR	ПАО "ФосАгро", ао	129 500 000	129 500 000	25%	26%
POGR	Petrovavlovsk PLC (Петропавловск ПиЭлСи), акции иностранного эмитента	3 957 270 254	3 958 751 735	65%	65%
RUAL	МКПАО "Объединенная компания РУСАЛ", ао	15 193 014 862	15 193 014 862	17%	18%
SELG	ПАО "Селигдар", ао	992 354 730	992 354 730	28%	26%
SGZH	ПАО ГК "Сегежа", ао	15 690 000 000	15 690 000 000	24%	25%
SMLT	ПАО "ГК "Самолет", ао	61 579 358	61 579 358	10%	8%
SPBE	ПАО «СПБ Биржа», ао	132 843 907	132 843 907	38%	21%
TGKA	ПАО "ТГК-1", ао	3 854 341 416 571	3 854 341 416 571	19%	18%
TGKD	ПАО "Квадра", ао	1 912 495 577 759	1 912 495 577 759	14%	15%

С 17 июня 2022г. в листах ожидания на включение и исключение из индексов Московской биржи будут находиться следующие ценные бумаги:

#### Листы ожидания на включение в индексы Московской биржи

Код	Наименование	Индекс
INGR	ПАО "ИНГРАД", ао	Индекс широкого рынка
POSI	ПАО "Группа Позитив", ао	
ZILL	АМО ЗИЛ, ао	
KRKNP	ПАО "Саратовский НПЗ", ап	
DVEC	ПАО "Дальневосточная энергетическая компания", ао	
CHMK	ПАО "Челябинский металлургический комбинат", ао	
ISKJ	ПАО "ИСКЧ", ао	
TGKB	ПАО "ТГК-2", ао	

#### Листы ожидания на исключение из индексов Московской биржи

Код	Наименование	Индекс
SFIN	ПАО "САФМАР Финансовые инвестиции", ао	Индекс широкого рынка
HHRU	HeadHunter Group PLC (ХэдХантер Групп ПиЭлСи), ДР иностранного эмитента на акции (эмитент ДР — JPMorgan Chase Bank, N.A.)	Индекс МосБиржи Индекс РТС
POGR	Petrovavlovsk PLC (Петропавловск ПиЭлСи), акции иностранного эмитента	