

Оглавление

| | |
|---|---|
| 1. Согласование новой редакции Спецификации фьючерсов на иностранные ценные бумаги и маржируемых опционов на них ¹ | 1 |
| 2. Согласование новой редакции Спецификации однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией на курс иностранной валюты к российскому рублю ¹ | 1 |
| 3. О согласовании новой редакции Правил организованных торгов на срочном рынке ¹ | 2 |
| 4. О начале расчета индекса облигаций в юанях ² | 2 |
| 5. Об ограничении доли стоимости облигаций в индексах ² | 2 |
| 6. Об использовании кредитных рейтингов при оценке кредитного качества эмитентов ² | 2 |
| 7. Об индексах облигаций, сегментированных по кредитным рейтингам, присвоенным международными рейтинговыми агентствами ² | 2 |
| 8. Итоги нагрузочного тестирования ³ | 2 |
| 9. Бизнес-задачи текущего периода ³ | 3 |
| 10. Новая редакция требований к уровню резервирования подключения к программно-техническому комплексу Московской биржи ³ | 3 |
| 11. Вывод из эксплуатации сервиса «Web-клиринг» ³ | 3 |
| 12. Планируемые изменения Моих Browser Plugin и сопутствующие изменения функциональности клиентских интерфейсов ³ | 3 |
| 13. Изменения архитектуры сетевой инфраструктуры для внешних подключений из зоны колокации ³ | 4 |
| 14. Согласование Правил осуществления репозитарной деятельности НРД в новой редакции ⁴ | 4 |

1. Согласование новой редакции Спецификации фьючерсов на иностранные ценные бумаги и маржируемых опционов на них

Комитет по срочному рынку рекомендовал утвердить новую редакцию Спецификации фьючерсных контрактов на иностранные ценные бумаги и маржируемых опционов на фьючерсные контракты на иностранные ценные бумаги. В рамках развития сегмента фондовых деривативов в спецификации добавлены параметры новых контрактов на иностранные индексы.

2. Согласование новой редакции Спецификации однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией на курс иностранной валюты к российскому рублю

Комитет по срочному рынку рекомендовал утвердить новую редакцию Спецификации однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией на курс иностранной валюты к российскому рублю.

Основные изменения в спецификации связаны с исполнением «вечного» фьючерса в квартальный контракт, а также с изменением расчета вариационной маржи в вечерний клиринг.

¹ Комитет по срочному рынку от 7.10.2022

² Комитет по индикаторам долгового рынка от 7.10.2022

³ Информационно-технологический комитет от 27.10.2022

⁴ Комитет пользователей репозитарных услуг от 14.10.2022

3. О согласовании новой редакции Правил организованных торгов на срочном рынке

Комитет по срочному рынку рекомендовал утвердить Правила организованных торгов на срочном рынке.

В связи с запуском аукциона открытия в Правила добавлены соответствующие статьи, введены новые термины, изменено расписание торговых сессий. Также в новую редакцию внесена новая категория заявок - заявка с признаком «только пассивная».

4. О начале расчета индекса облигаций в юанях

Комитет по индикаторам долгового рынка рекомендовал внести изменения в Методику расчета индексов облигаций, позволяющие начать расчет индекса облигаций, выпущенных российскими эмитентами и номинированных в китайских юанях.

5. Об ограничении доли стоимости облигаций в индексах

Комитет по индикаторам долгового рынка на своем заседании рассмотрел вопрос о новых критериях ограничения максимального удельного веса облигаций эмитентов в индексах. Комитет рекомендовал установить следующие ограничения удельного веса эмитента в облигационных индексах:

- если количество эмитентов, выпуски облигаций которых включены в базу расчета, более 11, удельный вес эмитента ограничивается 10%;
- если количество эмитентов, выпуски облигаций которых включены в базу расчета, от 7 до 11 включительно, удельный вес эмитента ограничивается 15%;
- если количество эмитентов, выпуски облигаций которых включены в базу расчета, от 4 до 6 включительно, удельный вес эмитента ограничивается 30%;
- если в базу расчета включены выпуски облигаций 3-х эмитентов, удельный вес эмитента ограничивается 40%.

6. Об использовании кредитных рейтингов при оценке кредитного качества эмитентов

На заседании Комитета по индикаторам долгового рынка был заслушан вопрос об использовании кредитных рейтингов, присвоенных эмитентам и выпускам агентствами «Национальное Рейтинговое Агентство» и «Национальные Кредитные Рейтинги», при включении в базы расчета облигационных индексов, сегментированных по национальной рейтинговой шкале.

Комитет рекомендовал при оценке кредитного качества эмитентов и выпусков при включении в базы расчета индексов облигаций, сегментированных по национальной рейтинговой шкале, использовать рейтинги российских агентств, методика которых аккредитована Банком России.

7. Об индексах облигаций, сегментированных по кредитным рейтингам, присвоенным международными рейтинговыми агентствами

Комитет по индикаторам долгового рынка рекомендовал прекратить расчет индексов облигаций, сегментированных по кредитным рейтингам, присвоенным международными рейтинговыми агентствами, с 1 января 2023 года.

8. Итоги нагрузочного тестирования

10 сентября 2022 года Московская биржа провела ежегодное нагрузочное тестирование систем валютного, срочного и фондового рынков на промышленном контуре. Тестирование позволило участникам торгов и их клиентам провести реалистичную оценку производительности своих систем и каналов связи при росте числа и интенсивности транзакций на рынках и эффективно запланировать модернизацию инфраструктуры для устранения «узких мест». Тестирование проведено в соответствии с планом и признано успешным.

Информационно-технологический комитет утвердил отчет по итогам нагрузочного тестирования.

9. Бизнес-задачи текущего периода

На заседании Информационно-технологического комитета была представлена информация по новым инструментам валютного рынка. Запускаются новые биржевые валютные пары KGS/RUB, TJS/RUB, USD/KGS, USD/TJS, USD/HKD, новые внебиржевые валютные пары в клиринге с ЦК KGS/RUB, TJS/RUB, USD/KGS, USD/TJS, ZAR/RUB, USD/ZAR, BYN/RUB, KZT/RUB, USD/KZT, AMD/RUB, USD/AMD. Для CNY, TRY, KZT, BYN, ZAR время торгов TOD продлевается с 12:00 до 12:30.

В декабре текущего года планируется внедрить новый вид заявки «Book or cancel» и функционал ограничения агрессивности лимитных заявок (вероятно, в статусе технической готовности, запуск в промышленную эксплуатацию может быть отложен на 1 квартал 2023 г.). Торги TOD и O/N по HKD и CNY продлеваются до 19:00. Изменится шаг цены спот TRY/RUB по аналогии с CNY/RUB (с 0,0001 руб., до 0,001 руб.).

Представлена информация по доработкам в OTC-мониторе в связи с планируемым вступлением в силу нового регулирования. Новое Указание ЦБ РФ «О предоставлении на биржу информации о заключенных не на организованных торгах договорах купли-продажи ценных бумаг, а также порядке (правилах, составе и сроках) ее раскрытия биржей» заменит Положение № 06-67/пз-н «Об утверждении Положения о предоставлении информации о заключении сделок».

На срочном рынке в декабре 2022 года планируется реализовать выход из вечного фьючерса в квартальный, а также механизм штрафного фандинга в вечных фьючерсах на валюту. В первом квартале будущего года также планируется реализовать возможность снятия пассивной кросс-заявки. Добавится новый признак для клиентского кода, позволяющий при наличии встречной заявки с таким же 7кк или ИНН снимать вместо активной заявки пассивную (сейчас всегда снимается активная). По запросам клиентов готовится к внедрению обновление сервиса для гибкого управления ГО на клиентском уровне брокера.

С ноября 2022 года на рынке акций вводится новая модель тарификации с ассиметричным взиманием комиссии. Одновременно станет доступна постановка заявок с типом исполнения по остатку "Book or cancel".

10. Новая редакция требований к уровню резервирования подключения к программно-техническому комплексу Московской биржи

Члены Информационно-технологического комитета рассмотрели проект требований к уровню резервирования подключения к программно-техническому комплексу Московской биржи в новой редакции. В представленном проекте обновлена терминология, в том числе актуализировано наименование компании, обновлены требования к оборудованию, скорректированы ссылки на соответствующий раздел сайта биржи, в текст документа добавлено требование о резервировании внешних программно-технических средств (ранее эта информация была оформлена в виде ссылки на другой документ), а также добавлен новый пункт о работе с резервными контурами биржевых сервисов. Комитет рекомендовал утвердить требования в новой редакции.

11. Вывод из эксплуатации сервиса «Web-клиринг»

В настоящее время для документооборота между участниками клиринга и НКЦ используются два дублирующих друг друга сервиса «Web-клиринг» и «Клиринговый терминал». Современное web-приложение «Клиринговый терминал» предоставляет участникам больше возможностей и полностью покрывает функционал сервиса «Web-клиринг».

Информационно-технологический комитет рекомендовал в порядке исключения отступить от принятой политики декомиссии и уменьшить срок поддержки сервиса «Web-клиринг» до одного года при условии своевременного информирования пользователей данного терминала.

12. Планируемые изменения Моих Browser Plugin и сопутствующие изменения функциональности клиентских интерфейсов

Браузерное расширение Моих Browser Plugin отвечает за взаимодействие браузерных интерфейсов Московской биржи и НКЦ с СКЗИ (средства криптографической защиты информации). В 1 квартале 2023 года планируется выпустить обновление плагина, которое обеспечит совместимость с браузерами семейства Chromium, использующими Manifest V3, а также повысит

эффективность защиты данных пользователей и устранил выявленные уязвимости. Новая версия программного модуля не будет поддерживать Internet Explorer, изменится логика скачивания файлов (файлы будут скачиваться в виде архива). В целях обеспечения плавного перехода на новую версию плагина текущая и обновлённая версии будут поддерживаться параллельно до июня 2023 года.

13. Изменения архитектуры сетевой инфраструктуры для внешних подключений из зоны колокации

В 2021 году биржа анонсировала планы по изменению сетевой схемы для подключений в зону колокации из зоны Proximity. Техническая реализация изменений заняла больше времени, чем планировалось изначально.

На текущий момент со стороны биржи и операторов связи достигнута техническая готовность к изменению архитектуры сетевой инфраструктуры для внешних подключений из зоны колокации. В конце декабря 2022 года – начале января 2023 года будет изменена сетевая схема для подключений в линии авторизованных операторов связи между 202 и 217 залами ЦОД Dataspace, что внесет в них дополнительную задержку в 100 мкс. Все клиенты зоны колокации проинформированы об изменениях. Дата изменения будет сообщена дополнительно после согласования с операторами связи.

14. Согласование Правил осуществления репозитарной деятельности НРД в новой редакции

Комитет пользователей репозитарных услуг НРД рекомендовал согласовать новую редакцию Правил осуществления репозитарной деятельности НРД. По тексту Правил были внесены технические и редакционные правки, а также правки, связанные с актуализацией условий оказания репозитарных услуг участникам.