

**Дайджест пользовательских комитетов Группы Московская Биржа
январь – февраль 2023**

Оглавление

1. Об изменениях в Правила допуска к участию в организованных торгах Московской биржи ^{1 2 3 4}	2
2. О согласовании Правил организованных торгов на срочном рынке в новой редакции ⁵	2
3. О рекомендации по утверждению Правил организованных торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов в новой редакции ¹	2
4. Методика изменения шага цены на валютном рынке ¹	2
5. О рекомендациях по утверждению Правил листинга Московской биржи в новой редакции ^{2 6}	2
6. Об итогах межкомитетской рабочей группы по кросс-сделкам ⁶	3
7. Альтернативная торговая система рынка акций ⁶	3
8. Об утверждении новых редакций спецификаций фьючерсных контрактов на курс доллара США к иностранной валюте и опционов на них ⁵	3
9. Об утверждении новой редакции Спецификации фьючерсных контрактов на курс евро к иностранной валюте ⁵	3
10. Об утверждении новых редакций ряда спецификаций ⁵	3
11. О согласовании Спецификации фьючерсного контракта на Индекс пшеницы на условиях поставки СРТ Новороссийск в новой редакции ⁵	3
12. О рассмотрении новой редакции списка параметров фьючерсных контрактов на депозитарные расписки ⁵	4
13. О рассмотрении новой редакции Спецификации фьючерсных контрактов на курс доллара США к иностранной валюте ⁵	4
14. О рекомендации по прекращении действия Спецификации фьючерсного контракта на ставку RUSFARUSD ⁵	4
15. Об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией в 2023 году ⁵	4
16. О прекращении действия ряда спецификаций ⁵	4
17. О новых инструментах срочного рынка ⁵	5
18. О рекомендациях по установлению коэффициентов free-float ⁷	5
19. О рекомендациях по установлению дополнительных весовых коэффициентов ⁷	5
20. О рекомендациях по изменению состава баз расчета индексов ⁷	7
21. Об учете факта раскрытия эмитентами отчетности в международном формате при формировании индексов ⁷	7

¹ Комитет по валютному рынку от 9.02.2023

² Комитет по ценным бумагам с фиксированным доходом от 12.01.2023 и 8.02.2023

³ Комитет по рынку депозитов от 7.02.2023

⁴ Комитет по рынку кредитов от 7.02.2023

⁵ Комитет по срочному рынку от 24.01.2023 и 7.02.2023

⁶ Комитет по фондовому рынку от 12.01.2023, 31.01.2023, 9.02.2023

⁷ Индексный комитет от 27.02.2023

1. Об изменениях в Правила допуска к участию в организованных торгах Московской биржи

В Правила допуска к участию в организованных торгах Московской биржи (Общая часть) внесены ряд уточнений (в том числе в связи с вступлением в силу с 1 апреля 2023 года изменений в Положение Банка России от 17.10.2014 № 437-П «О деятельности по проведению организованных торгов»), касающиеся:

- запрета совершения кросс-сделок в безадресных режимах и возможности разрешения кросс-сделок только на основании адресных заявок;
- выбора способа отклонения заявки, приводящей к кросс-сделке (новый функционал для срочного и валютного рынков);
- внесения информации об уникальных кодах иностранного клиента второго уровня, если иностранному брокеру-клиенту первого уровня запрещена трансграничная передача сведений о своих клиентах.

В Части II (Валютный рынок и рынок драгоценных металлов): для банков из ЕАЭС/ЕврАзЭС предоставлена возможность допуска к сделкам купли-продажи драгоценных металлов.

Комитеты рекомендовали внести в Правила допуска следующие изменения:

Утвердить Правила допуска к участию в организованных торгах ПАО Московская Биржа. Часть I. Общая часть в новой редакции.

Комитет по валютному рынку также рекомендовал утвердить Правила допуска к участию в организованных торгах ПАО Московская Биржа. Часть II. Валютный рынок и рынок драгоценных металлов в новой редакции.

2. О согласовании Правил организованных торгов на срочном рынке в новой редакции

Комитет по срочному рынку рекомендовал утвердить Правила организованных торгов на срочном рынке Московской биржи в новой редакции.

С учетом требований, предусмотренных законом 437-П, прописан запрет на заключение кросс-сделок на основании безадресных заявок, внесены уточнения по выбору способа отклонения заявки, приводящей к кросс-сделке в отношении участника торгов и его клиентов, описаны случаи аннулирования кросс-сделок в период проведения аукциона открытия.

Также внесены уточнения по правам биржи в случае аннулирования зарегистрированных заявок на этапе сбора заявок в случае выявления ошибок в работе программного обеспечения в период проведения аукциона открытия, а также обеспечение информирования участников торгов в таких случаях.

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

Члены комитета по валютному рынку рассмотрели новую редакцию Правил торгов с учетом нового типа заявок «passive only» и планируемого запрета кросс-сделок.

Комитет рекомендовал утвердить Правила организованных торгов Московской биржи на валютном рынке и рынке драгоценных металлов в новой редакции.

4. Методика изменения шага цены на валютном рынке

Участникам заседания комитета по валютному рынку была предложена методология изменения шага цены по валютным парам в Системном режиме торгов (CETS), а также изменение шага цены по спот инструментам валютных пар USDCNY, EURUSD, HKDRUB (подробнее <https://www.moex.com/s3465>).

Комитет принял к сведению полученную информацию.

5. О рекомендациях по утверждению Правил листинга Московской биржи в новой редакции

Комитет по фондовому рынку рекомендовал утвердить Правила листинга Московской биржи в новой редакции.

Изменения связаны с новыми требованиями для регистрации биржевых облигаций и структуры Сектора устойчивого развития (новая редакция Положения Банка России № 706-П «О стандартах

эмиссии ценных бумаг»). Изменение структуры Сектора устойчивого развития обусловлено появлением новых типов облигаций в Положении № 706-П (облигации, связанные с целями устойчивого развития, облигации климатического перехода, адаптационные облигации).

6. Об итогах межкомитетской рабочей группы по кросс-делкам

Комитет по фондовому рынку рассмотрел итоги межкомитетской рабочей группы по кросс-делкам. Участники заседания уделили внимание вступающим в силу 1 апреля текущего года требованиям Положения Банка России от 17.10.2014 №437-П «О деятельности по проведению организованных торгов», касающимся полного запрета заключения кросс-делок в анонимных режимах торгов, а также иных изменений.

Комитет по фондовому рынку принял к сведению полученную информацию.

7. Альтернативная торговая система рынка акций

Участники заседания Комитета по фондовому рынку заслушали информацию о технологии заключения внебиржевых сделок с центральным контрагентом.

Комитет принял к сведению информацию о внедрении альтернативной торговой системы рынка акций.

8. Об утверждении новых редакций спецификаций фьючерсных контрактов на курс доллара США к иностранной валюте и опционов на них

Комитет по срочному рынку на своем заседании рекомендовал утвердить новые редакции Спецификации фьючерсных контрактов на курс доллара США к иностранной валюте и Спецификации маржируемых опционов на фьючерсные контракты на курс доллара США к иностранной валюте.

Списки параметров добавлены в Спецификации в качестве приложений. В Списки параметров спецификаций добавлены контракты на курс USD/CNY. Изменения связаны с обновлением Методики индикативных валютных курсов.

Также внесены редакционные правки.

9. Об утверждении новой редакции Спецификации фьючерсных контрактов на курс евро к иностранной валюте

Комитет по срочному рынку рекомендовал утвердить новую редакцию Спецификации фьючерсных контрактов на курс евро к иностранной валюте.

В Спецификацию внесены изменения в связи с обновлением Методики индикативных валютных курсов. Список параметров добавлен в Спецификации в качестве Приложения 1. Также внесены редакционные правки.

10. Об утверждении новых редакций ряда спецификаций

Участники заседания Комитета по срочному рынку рекомендовали утвердить новые редакции Спецификации фьючерсных контрактов на курс иностранной валюты к российскому рублю и Спецификации маржируемых опционов на фьючерсные контракты на курс иностранной валюты к российскому рублю.

В Списки параметров спецификаций добавлены контракты на новые базисные активы.

11. О согласовании Спецификации фьючерсного контракта на Индекс пшеницы на условиях поставки СРТ Новороссийск в новой редакции

Комитет по срочному рынку рекомендовал утвердить Спецификацию фьючерсного контракта на Индексе пшеницы на условиях поставки СРТ Новороссийск в новой редакции.

В пункт 2.2.2. Спецификации внесено изменение в параметры расчета цены исполнения контракта для исключения неопределенности при определении даты исполнения, в случае если календари

торговли бирж, на которых торгуется базовый актив и фьючерсный контракт на него, не совпадают.

12. О рассмотрении новой редакции списка параметров фьючерсных контрактов на депозитарные расписки

В связи с отсутствием торгов депозитарными расписками на акции Байду Инк. и депозитарными расписками на акции Алибаба Груп Холдинг Лимитед на фондовом рынке Московской биржи Комитет по срочному рынку предложил исключить фьючерсные контракты на них из списка параметров фьючерсных контрактов на депозитарные расписки.

Комитет рекомендовал утвердить новую редакцию списка параметров фьючерсных контрактов на депозитарные расписки.

13. О рассмотрении новой редакции Спецификации фьючерсных контрактов на курс доллара США к иностранной валюте

В связи с невостребованностью фьючерсного контракта на курс доллара США к украинской гривне Комитет по срочному рынку предложил исключить его из списка параметров фьючерсных контрактов на курс доллара США к иностранной валюте.

Комитет рекомендовал утвердить новую редакцию Спецификации фьючерсных контрактов на курс доллара США к иностранной валюте.

14. О рекомендации по прекращении действия Спецификации фьючерсного контракта на ставку RUSFARUSD

Комитет по срочному рынку в связи с прекращением расчета индикаторов с валютой расчетов доллары США рекомендовал прекратить действие Спецификации фьючерсного контракта на ставку RUSFARUSD.

15. Об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией в 2023 году

Комитет по срочному рынку рекомендовал согласовать новый подход к исполнению однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией в части изменения комиссии за исполнение с 0,1% до 1% и рекомендовать реализацию такого подхода с марта 2023 года.

16. О прекращении действия ряда спецификаций

Комитет по срочному рынку рекомендовал прекратить действие спецификаций:

- фьючерсного контракта на расчетную величину (0,1 стоимости одной акции ПАО «Транснефть»), фьючерсного контракта на акции иностранных эмитентов, обращающиеся на Frankfurt Stock Exchange,
- фьючерсного контракта на Индекс голубых фишек,
- фьючерсного контракта на Индекс IBOVESPA,
- фьючерсного контракта на Индекс SENSEX,
- фьючерсного контракта на Индекс Hang Seng,
- фьючерсного контракта на Индекс FTSE/JSE Top40,
- фьючерсных контрактов на корзину облигаций федерального займа,
- фьючерсного контракта на еврооблигации Российской Федерации,
- фьючерсного контракта на ставку MosPrime,
- фьючерсного контракта на ставку MOEXREPO.

Прекращение действия спецификаций данных фьючерсных контрактов связано с отсутствием сделок и интереса со стороны участников в течение продолжительного времени.

17. О новых инструментах срочного рынка

Комитету по срочному рынку была представлена информация о запуске контрактов на новые базовые активы, параметры которых были утверждены ранее. Комитет принял к сведению информацию о фьючерсных контрактах на турецкую лиру – российский рубль и гонконгский доллар – российский рубль, а также опционах на них.

18. О рекомендациях по установлению коэффициентов free-float

Индексный комитет рассмотрел вопрос об изменении коэффициента free-float по ряду эмитентов. Комитет рекомендовал установить следующие значения коэффициентов free-float:

Код	Наименование	free-float
GEMA	ПАО "ММЦБ", ао	16%
HHRU	ХэдХантер Групп ПИЭЛСИ, ДР иностранного эмитента	62%
MTLR	ПАО "Мечел", ао	43%
NAUK	ПАО НПО "Наука", ао	6%
NSVZ	ПАО "Наука-Связь", ао	8%
POLY	Полиметалл Интернэшнл плс, акции иностранного эмитента	72%
SELG	ПАО "Селигдар", ао	25%
SMLT	ПАО "ГК "Самолет", ао	9%
WUSH	ПАО "ВУШ Холдинг", ао	10%

19. О рекомендациях по установлению дополнительных весовых коэффициентов

Индексный комитет рассмотрел вопрос об изменении дополнительных весовых коэффициентов по ряду эмитентов. Комитет рекомендовал установить следующие значения дополнительных весовых коэффициентов:

Код	Наименование	Новый LW
GAZP	ПАО "Газпром", ао	0.7
LKOH	ПАО "ЛУКОЙЛ", ао	0.8
SBER	ПАО Сбербанк, ао	0.6
GMKN	ПАО "ГМК "Норильский никель", ао	0.7
NVTK	ПАО "НОВАТЭК", ао	0.6
YNDX	Яндекс Н.В., акции иностранного эмитента	0.5
ROSN	ПАО "НК "Роснефть", ао	0.7
MGNT	ПАО "Магнит", ао	0.6
TCSG	ТиСиЭс Груп Холдинг ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции	0.6
TATN	ПАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина, ао	0.9
PHOR	ПАО "ФосАгро", ао	0.6
PLZL	ПАО "Полюс", ао	0.7
SNGS	ПАО "Сургутнефтегаз", ао	0.8
MTSS	ПАО "МТС", ао	0.7
ALRS	АК "АЛРОСА" (ПАО), ао	0.7
SNGSP	ПАО "Сургутнефтегаз", ап	0.7
FIVE	Икс 5 Ритейл Груп Н.В., ДР иностранного эмитента на акции	0.6
NLMK	ПАО "НЛМК", ао	0.7
CHMF	ПАО "Северсталь", ао	0.7
RUAL	МКПАО "Объединенная компания "РУСАЛ", ао	0.8

MOEX	ПАО Московская Биржа, ао	0.6
SBERP	ПАО Сбербанк, ап	0.8
POLY	Полиметалл Интернэшнл плс, акции иностранного эмитента	0.6
IRAO	ПАО "Интер РАО", ао	0.8
OZON	Озон Холдингс ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции	0.6
VTBR	Банк ВТБ (ПАО), ао	0.8
HYDR	ПАО "РусГидро", ао	0.6
MAGN	ПАО "ММК", ао	0.8
TATNP	ПАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина, ап	0.9
VSMO	ПАО "Корпорация ВСМПО-АВИСМА", ао	0.9
TRNFP	ПАО "Транснефть", ап	0.7
RTKM	ПАО "Ростелеком", ао	0.8
VKCO	VK Company Limited, ДР иностранного эмитента на акции	0.6
ENPG	МКПАО "ЭН+ ГРУП", ао	0.7
AFKS	ПАО АФК "Система", ао	0.8
FIXP	Фикс Прайс Груп Лтд, ДР иностранного эмитента на акции	0.3
CBOM	ПАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК", ао	0.9
GLTR	Глобалтранс Инвестмент ПЛС, ДР иностранного эмитента	0.6
DSKY	ПАО "Детский мир", ао	0.7
AGRO	РОС АГРО ПЛС, ДР иностранного эмитента на акции	0.9
AFLT	ПАО "Аэрофлот", ао	0.9
NKNC	ПАО "Нижнекамскнефтехим", ап	0.6
FESH	ПАО "ДВМП", ао	1
FEES	ПАО "ФСК ЕЭС", ао	0.8
MTLR	ПАО "Мечел", ао	0.8
SMLT	ПАО "ГК "Самолет", ао	0.7
LENT	МКПАО "Лента", ао	0.6
LSRG	ПАО "Группа ЛСР", ао	0.8
FLOT	ПАО "Совкомфлот", ао	0.9
MSNG	ПАО "Мосэнерго", ао	0.9
RASP	ПАО "Распадская", ао	0.9
UPRO	ПАО "Юнипро", ао	0.9
BANEP	ПАО АНК "Башнефть", ап	0.9
ETLN	ETALON GROUP PLC, ДР иностранного эмитента	0.9
BELU	ПАО "Белуга Групп", ао	0.6
MTLRP	ПАО "Мечел", ап	0.9
BSPB	ПАО "Банк "Санкт-Петербург", ао	0.8
MDMG	МД МЕДИКАЛ ГРУП ИНВЕСТМЕНТС ПЛС, ДР иностранного эмитента	0.7
OGKB	ПАО "ОГК-2", ао	0.8
CIAN	Cian PLC, ДР иностранного эмитента на акции	0.6
NMTP	ПАО "НМТП", ао	0.5
MVID	ПАО "М.видео", ао	0.8
GEMC	ЮНАЙТЕД МЕДИКАЛ ГРУП КИ ПИЭЛСИ, ДР иностранного эмитента на акции	0.4
POSI	ПАО "Группа Позитив", ао	0.9
AQUA	ПАО "Русская Аквакультура"	0.9
SFTL	Softline Holding PLC, ДР иностранного эмитента на акции	0.7

TGKA	ПАО "ТГК-1", ао	0.9
HNHRU	ХэдХантер Групп ПИЭЛСИ, ДР иностранного эмитента	0.1
MRKP	ПАО "МРСК Центра и Приволжья", ао	0.9
MRKC	ПАО "МРСК Центра", ао	0.8
MRKU	ОАО "МРСК Урала", ао	0.9
AMEZ	ПАО "Ашинский метзавод", ао	0.9
OKEY	АО О'КЕЙ ГРУПП, ДР иностранного эмитента на акции	0.7
SVAV	ПАО "СОЛЛЕРС", ао	0.9
TTLK	ПАО "Таттелеком", ао	0.9
MRKZ	ПАО "МРСК Северо-Запада", ао	0.9

20. О рекомендациях по изменению состава баз расчета индексов

Индексный комитет рассмотрел вопрос об изменении состава баз расчета индексов Московской биржи. Комитет рекомендовал включить в состав Базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС депозитарные расписки иностранного эмитента ROS AGRO PLC.

Комитет рекомендовал включить в состав Базы расчета Индекса акций широкого рынка обыкновенные акции следующих эмитентов: ПАО «ДЭК», ПАО «ИСКЧ», ПАО «ТГК-2» и ПАО «ВУШ Холдинг».

Комитет рекомендовал включить в состав Базы расчета Индекса средней и малой капитализации обыкновенные акции ПАО «Аптечная сеть 36,6».

Комитет рекомендовал включить в состав Базы расчета отраслевого Индекса металлов и добычи обыкновенные акции МКПАО «ЭН+ ГРУПП», в отраслевой Индекс электроэнергетики – обыкновенные акции ПАО «ДЭК» и обыкновенные акции ПАО «ТГК-2», а в отраслевой Индекс потребительского сектора – обыкновенные акции ПАО «ИСКЧ» и обыкновенные акции ПАО «ВУШ Холдинг».

Комитет рекомендовал оставить без изменений Базу расчета Индекса голубых фишек.

Комитет рекомендовал исключить обыкновенные акции ПАО «Детский мир» из Баз расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС, Индекса средней и малой капитализации, Индекса акций широкого рынка и отраслевого Индекса потребительского сектора.

21. Об учете факта раскрытия эмитентами отчетности в международном формате при формировании индексов

Индексный комитет рассмотрел вопрос об учете факта раскрытия эмитентами отчетности в международном формате при формировании индексов.

Комитет рекомендовал инициировать обращение к эмитентам с рекомендацией о раскрытии финансовой отчетности в международном формате с целью ее учета при формировании индексов акций Московской биржи.