

**Дайджест пользовательских комитетов Группы Московская Биржа
август 2023**

Оглавление

1. Об изменениях в Правилах торгов на валютном рынке и рынке драгметаллов ¹	1
2. Об изменении в Правилах допуска к участию в торгах ¹	1
3. Согласование списка параметров премиальных опционов на курсы иностранных валют к рублю в новой редакции ²	2
4. Согласование спецификации премиальных опционов на драгметаллы и списка параметров премиальных опционов на драгметаллы ²	2
5. О параметрах бессрочных фьючерсов на валюту ²	2
6. Согласование спецификации фьючерсов на акции российских эмитентов в новой редакции ²	2
7. Об исполнении опционов на Polymetal International plc. ²	2
8. Рекомендации по изменению состава баз расчета индексов Московской биржи ³	2
9. О методике расчета Индекса МосБиржи средней и малой капитализации ³	3
10. О порядке присвоения коэффициента free-float акциям квазироссийских компаний при редомициляции ³	3
11. Рекомендации по установлению коэффициентов free-float ³	3
12. Рекомендации по установлению дополнительных весовых коэффициентов ³	3

1. Об изменениях в Правилах торгов на валютном рынке и рынке драгметаллов

Комитет по валютному рынку рассмотрел изменения в Правилах торгов, связанные с планируемой реализацией на валютном рынке айсберг-заявок в отношении сделок своп, а также с уточнением мер ответственности в случае распространения и/или предоставления участником торгов биржевой информации третьим лицам.

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

2. Об изменении в Правилах допуска к участию в торгах

Комитет по валютному рынку рассмотрел изменения в Правилах допуска к участию в организованных торгах в части допуска на валютный рынок и рынок драгоценных металлов.

Изменения вносятся в связи с планируемой возможностью предоставления допуска негосударственным пенсионным фондам в категории «B2».

Комитет рекомендовал внести в Правила допуска к участию в организованных торгах следующие изменения:

1. Утвердить Правила допуска к участию в организованных торгах ПАО Московская Биржа. Часть I. Общая часть в новой редакции.
2. Утвердить Правила допуска к участию в организованных торгах ПАО Московская Биржа. Часть II. Валютный рынок и рынок драгоценных металлов в новой редакции.

¹ Комитет по валютному рынку от 16.08.2023

² Комитет по срочному рынку от 11.08.2023

³ Индексный комитет от 29.08.2023

3. Согласование списка параметров премиальных опционов на курсы иностранных валют к рублю в новой редакции

Комитет по срочному рынку рекомендовал утвердить Список параметров премиальных опционов на курсы иностранных валют к российскому рублю в новой редакции, уменьшив лот с 1000 до 100 единиц валюты для опционов на USD/RUB, EUR/RUB, CNY/RUB.

4. Согласование спецификации премиальных опционов на драгметаллы и списка параметров премиальных опционов на драгметаллы

Комитет по срочному рынку в связи с расширением линейки премиальных опционов рассмотрел вопрос о согласовании Спецификации новых контрактов. Комитет рекомендовал утвердить Спецификацию премиальных опционов на драгоценные металлы и Список параметров премиальных опционов на драгоценные металлы.

5. О параметрах бессрочных фьючерсов на валюту

Комитет по срочному рынку рекомендовал:

- оставить параметр K1 по USDRUBF без изменений (0,05%), параметр K1 по EURRUBF установить в размере 0,05%, параметр K1 по CNYRUBF установить в размере 0,03%;
- установить минимальный шаг цены по CNYRUBF в размере 0,001 руб.

6. Согласование спецификации фьючерсов на акции российских эмитентов в новой редакции

Комитет по срочному рынку рекомендовал утвердить Спецификацию фьючерсных контрактов на акции российских эмитентов в новой редакции: в Спецификацию добавлены новые базовые активы.

7. Об исполнении опционов на Polymetal International plc.

Комитет по срочному рынку рекомендовал:

1. Осуществить исполнение опционных контрактов (код POLYP020823CExxx, POLYP020823PExxx, POLYP160823CExxx, POLY160823PExxx) на обыкновенные акции «Полиметалл Интернэшнл» (далее – «Акция»), установив в качестве цены исполнения цену закрытия Акции на 25 июля 2023 года в размере 558,8 руб.
2. Рассмотреть возможность возобновления торгов обыкновенными акциями «Полиметалл Интернэшнл» (POLY)

8. Рекомендации по изменению состава баз расчета индексов Московской биржи

Индексный комитет рассмотрел вопрос об изменении состава баз расчета индексов Московской биржи.

Комитет рекомендовал включить в состав Базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС: обыкновенные акции ПАО "Группа Позитив"

- депозитарные расписки иностранного эмитента QIWI PLC
- обыкновенные акции ПАО "Юнипро"
- обыкновенные акции ПАО "Селигдар"

и исключить депозитарные расписки иностранного эмитента Fix Price Group Ltd.

Комитет рекомендовал включить в состав Базы расчета Индекса акций широкого рынка обыкновенные акции ПАО "Челябинский металлургический комбинат".

Комитет рекомендовал включить в базу расчета Индекса голубых фишек обыкновенные акции ПАО «Северсталь» и исключить обыкновенные акции АК «АЛРОСА» (ПАО).

Комитет рекомендовал включить в базу расчета Индекса средней и малой капитализации депозитарные расписки иностранного эмитента HeadHunter Group PLC.

Комитет рекомендовал исключить из баз расчета Индекса широкого рынка, Индекса средней и малой капитализации и отраслевого Индекса металлов и добычи обыкновенные акции ПАО «Ашинский металлургический завод».

Комитет рекомендовал включить в лист ожидания на исключение из Индекса МосБиржи и Индекса РТС обыкновенные акции ПАО «Магнит».

9. О методике расчета Индекса МосБиржи средней и малой капитализации

Индексный комитет рекомендовал внести изменения в Методику расчета Индексов акций Московской Биржи в части:

- исключения требования к отсутствию акций финансового сектора в Индексе средней и малой капитализации как утратившего актуальность;
- включения пункта о возможности поэтапного снижения веса акций крупных компаний (от 5%) в индексах перед их исключением;
- включения пункта об исключении из индексов акций компаний, заявивших о планах по делистингу.

10. О порядке присвоения коэффициента free-float акциям квазироссийских компаний при редомициляции

Индексный комитет рекомендовал устанавливать коэффициенты free-float по акциям редомицилируемых компаний равными коэффициентам free-float, действовавшим до редомициляции.

11. Рекомендации по установлению коэффициентов free-float

Индексный комитет рекомендовал установить следующие значения коэффициентов free-float:

Код	Наименование	Новый free-float
CARM	ПАО "СТГ", ао	16%
GECO	ПАО "ЦГРМ "ГЕНЕТИКО", ао	16%
GEMA	ПАО "ММЦБ", ао	16%
GTRK	ПАО "ГТМ", ао	21%
LIFE	ПАО "Фармсинтез", ао	33%
MGNT	ПАО "Магнит", ао	50%
NSVZ	ПАО "Наука-Связь", ао	3%
RNFT	ПАО "НК "РуссНефть", ао	15%
SELG	ПАО "Селигдар", ао	26%
SMLT	ПАО "ГК "Самолет", ао	10%
VTBR	Банк ВТБ (ПАО), ао	17%

12. Рекомендации по установлению дополнительных весовых коэффициентов

Индексный комитет рассмотрел вопрос об изменении дополнительных весовых коэффициентов по ряду эмитентов.

Новые значения дополнительных весовых коэффициентов, рассчитанных на основе информации о доступности ценных бумаг для совершения сделок, [доступны по ссылке](#).