

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

## Оглавление

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

<sup>1</sup> Комитет по валютному рынку от 16.08.2023

<sup>2</sup> Комитет по срочному рынку от 11.08.2023

<sup>3</sup> 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:

<b>Код</b>	<b>Наименование</b>	<b>Новый free-float</b>
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](#).