

Оглавление

1. О согласовании Спецификаций ¹	1
2. О согласовании подхода к определению дат исполнения однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией на Индекс МосБиржи ¹	1
3. О новой редакции ценовой конвенции для ипотечных ценных бумаг ²	1
4. О статусе рабочей группы по доходностям ²	2
5. Предложения по конфигурации торгов облигациями с истекшим сроком обращения ²	2
6. Продление маркетингового периода по услугам листинга в отношении МСП ²	2
7. О законодательных изменениях, направленных на реформирование института ИИС, вступающих в силу с 1 января 2024 г. ³	2
8. Итоги специализированного DR-тестирования ⁴	2
9. ИТ итоги 2023 года ⁴	3
10. Технологические новации торгово-клиринговых систем 2023 года ⁴	3
11. Выполнение закона «О связи» в части сведений о пользователях оконечного оборудования ⁴ ...	3
12. Статус работ по технологическому развитию биржевого клиентского ПО ⁴	4
13. Trade at Settlement и другие задачи срочного рынка 2024 года ⁴	4

1. О согласовании Спецификаций

Комитет по срочному рынку рекомендовал утвердить спецификации следующих инструментов:

- премиальных опционов на индексы, в список параметров внесен опцион на Индекс Мосбиржи;
- расчетных фьючерсных контрактов на иностранные ценные бумаги в новой редакции, в спецификацию добавлены параметры новых инструментов;
- фьючерсных контрактов на акции российских эмитентов в новой редакции, в спецификацию добавлены параметры новых инструментов: фьючерсных контрактов на акции ПАО Группа Астра и ПАО «Софтлайн»;
- премиальных опционов на курсы иностранных валют к рублю в новой редакции, в спецификацию внесены редакционные правки.

2. О согласовании подхода к определению дат исполнения однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией на Индекс МосБиржи

Комитет по срочному рынку рекомендовал использовать подход к определению дат исполнения однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией на Индекс МосБиржи, заключающийся в подаче поручения на исполнение за три торговых дня до экспирации квартального фьючерсного контракта на Индекс МосБиржи (мини), с марта 2024 года.

3. О новой редакции ценовой конвенции для ипотечных ценных бумаг

Комитет по ценным бумагам с фиксированным доходом рассмотрел информацию о новой редакции ценовой конвенции для ипотечных ценных бумаг – едином общепринятом подходе к оценке денежных потоков по ипотечным облигациям, а также об ипотечном портфеле банковского

¹ Комитет по срочному рынку от 1.12.2023 и 25.12.2023

² Комитет по ценным бумагам с фиксированным доходом от 05.12.2023

³ Комитет по рынку коллективных инвестиций от 21.12.2023

⁴ Информационно-технологический комитет от 7.12.2023

сектора, ипотечных облигациях ДОМ.РФ, секьюритизации ипотеки, достижениях развития рынка репо с ИЦБ ДОМ.РФ.

Комитет принял к сведению новую редакцию ценовой конвенции по ИЦБ ДОМ.РФ.

4. О статусе рабочей группы по доходностям

Комитет по ценным бумагам с фиксированным доходом рассмотрел и принял к сведению информацию о проведенном в октябре заседании рабочей группы по доходностям. На заседании комитета были рассмотрены вопросы по выработке подходов к универсальной оценке доходности облигаций.

5. Предложения по конфигурации торгов облигациями с истекшим сроком обращения

Комитет по ценным бумагам с фиксированным доходом рекомендовал совместно с Российским определяющим комитетом проработать правовое регулирование торгов облигациями с истекшим сроком обращения.

6. Продление маркетингового периода по услугам листинга в отношении МСП

Комитет по ценным бумагам с фиксированным доходом рассмотрел предложение о продлении льготного нулевого тарифа за оказание услуг листинга по включению ценных бумаг в список эмитентов, являющихся субъектами малого и среднего предпринимательства в соответствии с требованиями Федерального закона «О развитии малого и среднего предпринимательства в Российской Федерации» от 24 июля 2007 г. №209-ФЗ.

Комитет одобрил внесение изменений в тарифы за услуги, оказываемые биржей в соответствии с Правилами листинга, утвержденными Наблюдательным советом ПАО Московская Биржа 18.06.2021 (с учетом изменений от 12.12.2022, далее – Тарифы), изложив пункт 2.5.6 раздела 2 тарифов в следующей редакции:

«Особенности взимания вознаграждения за услугу по включению облигаций эмитентов, входящих в единый реестр субъектов малого и среднего предпринимательства:

- вознаграждение за услугу по включению облигаций эмитентов, входящих в единый реестр субъектов малого и среднего предпринимательства (за исключением вознаграждения, предусмотренного пп. 1.3 п. 1 и п. 6 таблицы п. 2.5 тарифов, а также за исключением вознаграждения за услугу по включению выпусков облигаций, объем которых превышает 400 млн рублей), до 31.12.2024 не взимается».

Комитет рекомендовал утвердить изменения в тарифы.

7. О законодательных изменениях, направленных на реформирование института ИИС, вступающих в силу с 1 января 2024 г.

Комитет по рынку коллективных инвестиций рассмотрел информацию по основным изменениям, направленным на реформирование индивидуальных инвестиционных счетов. На данный момент подписан блок поправок в Федеральный закон «О рынке ценных бумаг» от 22.04.1996 №39-ФЗ и в Федеральный закон «Об инвестиционных фондах», а также ожидается подписание поправок в Налоговый кодекс Российской Федерации, таких как:

- возможность владения несколькими счетами вместо одного,
- увеличение срока владения ИИС,
- налоговый вычет на взносы будет комбинированным,
- возможность открытия инвестором счета только нового типа,
- допуск управляющих компаний к управлению ИИС напрямую.

Комитет принял к сведению данную информацию.

8. Итоги специализированного DR-тестирования

18 ноября 2023 года было проведено первое из трех запланированных Disaster Recovery (далее – DR) тестирование с эмуляцией частичной отмены транзакций на срочном рынке.

Комитет рекомендовал в случае возникновения нештатных ситуаций отводить не менее 1,5 часов на восстановление консистентности данных в системах участников торгов с момента готовности торговой системы биржи к рестарту, в том числе с возможностью переноса или отмены промежуточной клиринговой сессии.

9. ИТ итоги 2023 года

Информационно-технологический комитет рассмотрел информацию о достижениях ИТ Московской биржи в 2023 году. В текущих условиях ИТ командой биржи сохранена техническая надежность инфраструктуры и метрики доступности. Коэффициент доступности торговых систем составляет 99,98 %. Биржа располагает трёхкратным запасом производительности и информационной емкости ТКС всех рынков относительно параметров реальных торгов. В 2023 г. команда ТКС реализовала целый ряд масштабных функциональных и технологических проектов. Активно и успешно развивается платформа Финуслуги. Готов к запуску собственный информационно-аналитический торговый терминал Трейд Радар. Продолжается работа над проектом создания маркетплейса информационных продуктов DataShop. Создано ценовое агентство по сбору информации о ценах на товарно-сырьевых рынках и объемах закупок по регионам РФ и СНГ. Ведутся работы в направлении развития витрин и сервисов данных DataHub. Продолжается процесс централизации производственных процессов и инструментов: во всех направлениях внедряется единая DevOps-платформа, единый стек инструментария разработки, достигнуто 100% покрытие всех команд производственными метриками. Продолжаются работы по снижению доли иностранного ПО и оборудования в ландшафте Группы «Московская Биржа». Активно воплощается программа гармонизации ИТ-ландшафта Группы Московская Биржа – сократился на 15% разрыв между текущим ландшафтом и целевым. Биржа представила и опубликовала новую стратегию развития до 2028 года.

10. Технологические новации торгово-клиринговых систем 2023 года

Информационно-технологический комитет принял к сведению информацию о технологических обновлениях платформы ASTS, не потребовавших каких-либо доработок со стороны клиентов биржи. В июне 2023 г. было внедрено масштабное обновление ASTS, благодаря которому ускорено выполнение критически важных операций служб эксплуатации (старт, рестарт, подготовка к старту торговой системы), существенно уменьшена вероятность внесения критических ошибок в код торговой системы, упрощено конфигурирование ТКС для уменьшения вероятности возникновения операционных ошибок. Активно ведутся работы, направленные на ускорение старта и оптимизацию работы ТКС с сотнями миллионов кодов клиентов. Комитет принял к сведению информацию о технологических новациях платформы Spectra в части планируемого перехода на PostgreSQL, что является важной задачей 2023–2025 гг. Ведутся работы по миграции на PostgreSQL существующих сервисов и модулей (система управления бэкофисом, биллинг, отчетная подсистема, индикативные курсы, ОТС Монитор, система контроля маркетмейкеров и др.). Монолитная система SQL постепенно будет разделена на отдельные сервисы, для каждого из которых будет выбираться лучшая технология реализации. В 2023 г. внедрены доработки, связанные с увеличением производительности системы Spectra. Реализовано партиционирование клиентов в сервисах расчёта лимитов и позиций. В течение 2023 г. были реализованы несколько задач, направленных на упрощение и оптимизацию публикации в шину Plaza2 данных из больших таблиц СУБД. Для конечных пользователей это заметно прежде всего при формировании данных по итогам клиринга в 19:00 – время публикации данных уменьшилось в среднем на 1 минуту по сравнению с прошлым годом.

11. Выполнение закона «О связи» в части сведений о пользователях оконечного оборудования

Подключение к интернет и ТКС в зоне колокации, а также доступ через VPN, являются услугами связи и оказываются профильным оператором ООО «МБ Защита информации». По требованию регуляции в рамках предоставления услуг связи оператор обязан ежеквартально предоставлять уполномоченным государственным органам информацию о пользователях услугами связи и об оказанных им услугах связи. Требуемая информация о пользователях оконечного оборудования

заполняется по форме с сайта биржи на бланке организации. Во втором квартале 2024 г. планируется реализовать возможность передачи списка пользователей через заполнение соответствующей формы в ЛКУ. С 2024 г. Биржа будет ежеквартально рассылать напоминания о необходимости заполнения формы с данными по пользователям окончательного оборудования.

12. Статус работ по технологическому развитию биржевого клиентского ПО

Информационно-технологический комитет рассмотрел информацию по текущему статусу и графику проекта замещения технологий биржевого клиентского программного обеспечения. Часть функционала в УФС (перенос заявлений в адрес НКЦ и API для отправки заявлений) будет реализована позднее ранее заявленного срока, в течение 2024 г. Работа по остальным изменениям ведётся по плану. 18 декабря 2023 года внедряется в эксплуатацию интеграционный шлюз НРД, функционал доступен для тестирования.

Кроме того, комитету была представлена информация по соответствующим изменениям в законодательстве. Регулятор выделил в отдельные группы процессы операционной надёжности (Положения Банка России от 15.11.2021 N 779-П и от 12.01.2022 № 787-П), а также внесены изменения в Правила категорирования объектов критической информационной инфраструктуры. В результате многие финансовые организации попали в перечень обладателей значимых объектов критической информационной инфраструктуры. Участникам торгов рекомендуется обратить внимание на представленные изменения и перепроверить принадлежность к той или иной категории объектов своей инфраструктуры. В случае необходимости Банком России могут быть согласованы исключения. Биржа со своей стороны готова оказать консультации в рабочем порядке.

13. Trade at Settlement и другие задачи срочного рынка 2024 года

Информационно-технологическому комитету была представлена информация по основным задачам срочного рынка, запланированным к внедрению в 2024 году. В первом квартале года планируется ввести в эксплуатацию новую web-версию опционного калькулятора (включая API), и другие новые инструменты. Биржа представила информацию по развитию линейки классических контрактов, вечных фьючерсов и премиальных опционов.