

# Дайджест пользовательских комитетов Группы Московская Биржа январь 2024

## Оглавление

1. Согласование спецификации вечных фьючерсов на индексы в новой редакции <sup>1</sup> .....	1
2. Согласование спецификаций валютных фьючерсов в новых редакциях <sup>1</sup> .....	1
3. О порядке исключения депозитарных расписок QIWI PLC из индексов акций в связи с понижением уровня листинга <sup>2</sup> .....	1
4. О начале расчета индекса ОФЗ-ПД с дюрацией 7 лет и выше <sup>3</sup> .....	1

### **1. Согласование спецификации вечных фьючерсов на индексы в новой редакции**

Комитет по срочному рынку рекомендовал утвердить спецификацию однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией на индексы (с возможностью исполнения путем заключения фьючерсного контракта на индекс) в новой редакции.

В новой редакции спецификации уточняется п. 2.1.3.2 в части формул расчета вариационной маржи в вечерний клиринг для случаев, когда

- 1) позиция была на предыдущий вечерний клиринг или сформировалась в вечернюю сессию;
- 2) позиция сформировалась в утреннюю сессию или в основную до дневного клиринга;
- 3) позиция сформировалась после дневного клиринга.

### **2. Согласование спецификаций валютных фьючерсов в новых редакциях**

В связи с расширением линейки фьючерсных контрактов на курсы валют и подготовке к запуску фьючерсных контрактов на курс BYN/RUB и на курс USD/KZT вносятся изменения в спецификации соответствующих контрактов.

Комитет по срочному рынку рекомендовал утвердить спецификации.

### **3. О порядке исключения депозитарных расписок QIWI PLC из индексов акций в связи с понижением уровня листинга**

Индексный комитет рассмотрел вопрос о порядке исключения депозитарных расписок QIWI PLC из индексов акций Московской биржи в связи с понижением уровня листинга. Комитет рекомендовал перенести рассмотрение вопроса об исключении из состава индексов акций депозитарных расписок QIWI PLC на свое следующее заседание в связи с необходимостью выработки единого подхода к ценным бумагам иностранных эмитентов, принявших решение о продаже российских активов.

### **4. О начале расчета индекса ОФЗ-ПД с дюрацией 7 лет и выше**

На заседании Комитета по индикаторам долгового рынка был рассмотрен вопрос о начале расчета индекса ОФЗ-ПД, в базу которого включаются облигации федерального займа с дюрацией 7 лет и выше. Комитет рекомендовал начать расчет данного индекса.

---

<sup>1</sup> Комитет по срочному рынку от 19.01.2024

<sup>2</sup> Индексный комитет от 30.01.2024

<sup>3</sup> Комитет по индикаторам долгового рынка от 12.01.2024