

Дайджест пользовательских комитетов Группы Московская Биржа июль 2024

Оглавление

1. План реализации переноса лимитных заявок в вечернюю сессию на рынке облигаций ¹	1
2. Об установлении требований по раскрытию нефинансовой отчетности ²	1
3. Согласование спецификаций фьючерсных контрактов ³	1
4. Приоритетные направления развития денежного рынка ⁴	1
5. Отчеты по итогам рабочих совещаний за истекший период ⁴	2
6. Открепленная подпись в отчетах фондового и валютного рынков ⁴	2
7. API для опционного калькулятора ⁴	2

1. План реализации переноса лимитных заявок в вечернюю сессию на рынке облигаций

Комитет по ценным бумагам с фиксированным доходом рассмотрел вопрос об исполнении лимитных заявок, не реализованных в основную сессию. На Московской бирже с 17 июня 2024 года работает механизм переноса заявок в вечернюю сессию. Данному решению предшествовали пожелания от ряда участников рынка об автоматическом переносе или настройке на уровне торгово-клирингового счета.

Члены комитета рассмотрели и приняли к сведению план переноса лимитных заявок в вечернюю сессию на рынке облигаций, который предполагается в IV квартале текущего года.

2. Об установлении требований по раскрытию нефинансовой

Комитет эмитентов акций по результатам своего заседания принял решение признать целесообразным установление в Правилах листинга требований по раскрытию нефинансовой отчетности.

3. Согласование спецификаций фьючерсных контрактов

Комитет по срочному рынку рекомендовал утвердить спецификации фьючерсных контрактов на акции российских эмитентов, опционов на акции российских эмитентов в новой редакции, опционов на акции иностранных эмитентов, маржируемых опционов на фьючерсные контракты на акции иностранных эмитентов, фьючерсных контрактов на курс иностранной валюты к российскому рублю, маржируемых опционов на фьючерсные контракты на курс иностранной валюты к российскому рублю, премиальных опционов на курсы иностранной валюты к российскому рублю, фьючерсного контракта на индекс Мосбиржи IPO, а также список параметров поставочных фьючерсных контрактов на акции иностранных эмитентов.

4. Приоритетные направления развития денежного рынка

Участники информационно-технологического комитета на своем заседании ознакомились с результатами опроса, проведенного среди членов комитета по репо и кредитованию ценными бумагами, отразившего относительную востребованность ряда проектов денежного рынка с точки зрения бизнеса. На фоне изменений ключевой ставки Банка России на денежном рынке активно развиваются сделки с плавающими ставками и, в связи с этим, запланировано изменение в подходе к маржированию таких сделок. Ожидается запуск операций по займу ценных бумаг с Федеральным Казначейством, с центральным контрагентом. Прорабатывается запуск свопов с

¹ Комитет по ценным бумагам с фиксированным доходом от 9.07.2024

² Комитет эмитентов акций от 8.07.2024

³ Комитет по срочному рынку от 4.07.2024 и 5.07.2024

⁴ Информационно-технологический комитет от 4.07.2024

ценными бумагами. Готовится к внедрению функционал репо с открытой датой EverGreen. Также в 2024 году планируется продлить расчет рублевого RUSFAR real time с текущего ограничения 12:30 до вечера, что позволит участникам и их клиентам получать данные об индикативных ставках репо с КСУ в онлайн-режиме в течение всего торгового дня.

5. Отчеты по итогам рабочих совещаний за истекший период

В июне текущего года было проведено рабочее совещание по вопросам замены оборудования в зоне колокации и переезда резервного ЦОД Московской биржи. Биржа приняла решение заменить коммутационное оборудование, а также отказаться от 1 Gb подключений до конца октября 2024 года. Представлены варианты возможной маркетинговой программы на новые 10 Gb подключения, предложения по высокоскоростным подключениям участники совещания рекомендовали доработать. В рамках процедуры замены коммутационного оборудования всем клиентам потребуется провести тестирование и переключение своих подключений на новое оборудование. Биржа организовала для клиентов возможность проведения тестирования новых подключений на тестовом стенде.

Биржа планирует завершить переезд своего оборудования в новый резервный ЦОД NORD до конца 2024 года. Клиенты ConnectME уже сейчас могут начать работы по переезду, для них будет сохранена возможность оставить свои подключения в ЦОД M1 после завершения переезда оборудования Московской биржи вплоть до конца первого полугодия 2025 года. План-график работ по переезду в резервный ЦОД NORD приведен в сопроводительных материалах.

6. Открепленная подпись в отчетах фондового и валютного рынков

Для отчетов по итогам торгов и клиринга на фондовом и валютном рынках планируется замена прикрепленной электронной подписи на открепленную, где файл подписи будет формироваться отдельно от исходного файла отчета. Изменения будут реализованы по аналогии с открепленной подписью отчетов на срочном рынке, представленной в релизе Spectra 2024-1. Предварительно внедрение запланировано на сентябрь этого года. Функционал доступен для тестирования.

7. API для опционного калькулятора

С 4 июля этого года Московская биржа расширила функционал опционного калькулятора. Стала доступна технология обмена данными с помощью REST API, что дает возможность автоматически получать рассчитываемые показатели опционов напрямую в свою торговую систему или приложение. Технология REST API опционного калькулятора позволяет получать перечень всех доступных опционов и их базовых активов, краткую сводку по опционам с ценами, рассчитанными комиссиями, а также доску опционов и данные для построения графиков. Кроме того, технология позволит пользователям сервиса собрать портфель из опционов и их базовых активов, а также рассчитать суммарное гарантийное обеспечение по любому набору инструментов срочного рынка с учетом неттирования.

Опционный калькулятор был запущен 1 августа 2023 года для быстрого и эффективного построения торговых стратегий на срочном рынке. Он упрощает процесс принятия торговых решений и осуществляет автоматический расчет большинства необходимых показателей. Опционный калькулятор – бесплатный и открытый сервис для всех пользователей.