

Дайджест пользовательских комитетов Группы Московская Биржа сентябрь 2024

1. Согласование спецификаций фьючерсных контрактов ¹	1
2. О согласовании тарифов срочного рынка в новой редакции ¹	2
3. Маркетинговый период по минимальному комиссионному вознаграждению ²	2
4. О рекомендациях по учету обмена депозитарных расписок ³ (Индексный комитет от 23.09.2024)	2
5. О рекомендациях по изменению состава листа ожидания на включение в Индекс МосБиржи и Индекс РТС ³	2
6. Замена публикации данных о позициях по инструментам в системе валютного рынка ⁴	2
7. Аукцион обновления цен на валютном рынке ⁴	2
8. Доработки торгово-клиринговых счетов срочного рынка ⁴	2
9. Замена токенов MobilePass на Avanpost ⁴	3

1. Согласование спецификаций фьючерсных контрактов

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. Внесено изменение - расчетная цена в вечерний клиринг равна значению закрытия индекса ИМОЕХ;
- спецификацию однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией на акции российских эмитентов (с возможностью исполнения путем заключения фьючерсного контракта на акцию российского эмитента), установив шаг цены равным 0,01 руб. (стоимость 1 рубль). В связи с расширением линейки однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией утверждается спецификация, в список параметров добавляются однодневные фьючерсные контракты с автопродлонгацией на обыкновенные акции ПАО Сбербанк и ПАО «Газпром»;
- спецификацию и список параметров фьючерсных контрактов на товары мирового агропромышленного комплекса. В список параметров внесен фьючерсный контракт на какао;
- спецификацию и список параметров фьючерсных контрактов на цветные и промышленные металлы в новой редакции. В список параметров добавлены инструменты с обновленными параметрами: унификация срока обращения контрактов - один квартал; уменьшение в 10 раз лота новых контрактов по сравнению текущими, что пропорционально уменьшает стоимость новых фьючерсов и размер гарантийного обеспечения для открытия позиции; увеличение в два раза до одного рубля шага цены фьючерсов на медь;
- спецификацию фьючерсных контрактов на акции российских эмитентов в новой редакции. В рамках расширения линейки фьючерсных контрактов на акции российских эмитентов в Список параметров добавлен новый базовый актив: обыкновенные акции ПАО «ЭсЭфАй».

¹ Комитет по срочному рынку от 09.09.2024, 12.09.2024, 19.09.2024

² Комитет по валютному рынку от 19.09.2024

³ Индексный комитет от 23.09.2024

⁴ Информационно-технологический комитет от 5.09.2024

2. О согласовании тарифов срочного рынка в новой редакции

Комитет по срочному рынку рекомендовал утвердить тарифы срочного рынка в новой редакции. В документ внесена информация, регламентирующая тарифы по однодневным фьючерсным контрактам с автопродлонгацией на акции российских эмитентов.

3. Маркетинговый период по минимальному комиссионному вознаграждению

Комитет по валютному рынку рекомендовал утвердить маркетинговый период в отношении минимального комиссионного вознаграждения (абонентской плате) по итогам совершения сделок спот и сделок фикс на валютном рынке и рынке драгоценных металлов в новой редакции.

4. О рекомендациях по учету обмена депозитарных расписок

Индексный комитет рассмотрел предложения биржи по учету обмена депозитарных расписок иностранного эмитента на акции HeadHunter Group PLC на обыкновенные акции МКПАО «Хэдхантер» в индексах акций Московской биржи.

Комитет рекомендовал заменить депозитарные расписки иностранного эмитента на акции HeadHunter Group PLC в индексах акций Московской биржи на обыкновенные акции МКПАО «Хэдхантер» и установить по ним те же параметры, что и по депозитарным распискам.

5. О рекомендациях по изменению состава листа ожидания на включение в Индекс МосБиржи и Индекс РТС

Индексный комитет рассмотрел вопрос о включении в лист ожидания на включение в Индекс МосБиржи и Индекс РТС обыкновенных акций МКПАО «МД Медикал Груп». Комитет рекомендовал оставить лист ожидания на включение в Индекс МосБиржи и Индекс РТС без изменений.

6. Замена публикации данных о позициях по инструментам в системе валютного рынка

В целях унификации с подходом, применяемым в системе фондового рынка, для системы валютного рынка планируется замена публикации данных о позициях по инструментам в разрезе тэгов инструментов (в таблице «Позиции по инструментам» POSITIONS) на публикацию данных об обязательствах и требованиях по валютным парам (новая таблица). В таблице POSITIONS по-прежнему будет публиковаться информация о позициях по средствам и по лимитам. Изменения впервые было анонсировано в апреле 2024 года, по просьбам участников торгов биржа предоставила дополнительные разъяснения и получила положительную обратную связь о готовности к представленному переходу. Изменение запланировано к внедрению в составе третьего релиза.

7. Аукцион обновления цен на валютном рынке

Участники заседания информационно-технологического комитета заслушали и приняли к сведению информацию о проекте запуска аукциона обновления цен (АОЦ) на валютном рынке, который будет запускаться автоматически при удержании на планке установленный промежуток времени – в настоящее время он составляет 10 сек. АОЦ предложен для снижения неопределенности курса при резких движениях цен в ходе торгов, приведших к необходимости сдвига текущих границ после истечения установленного времени ожидания рынка на какой-либо ценовой границе (на планке). АОЦ будет реализован аналогично действующему в настоящее время на фондовом рынке аукциону открытия.

8. Доработки торгово-клиринговых счетов срочного рынка

Информационно-технологический комитет принял к сведению информацию о планируемых доработках на стороне биржи в рамках Указания Банка России № 6681-У («О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных сделок за счет клиента», дата вступления в силу 01.04.2025). Брокерам устанавливаются дополнительные

требования по соблюдению нормативов НПП1 (норматив покрытия риска при исполнении поручения клиента) и НПП2 (норматив покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента). Для корректного расчёта НПП1 при открытии позиций биржа готовит доработки проверки заявок на обеспеченность в рамках претрейд контроля. Риск-сценарии будут фиксироваться в клиринг и между клиринговыми сессиями меняться не будут, за исключением раздвижки планок. Для корректного расчёта НПП2 планируется реализовать отдельный сервис по трансляции индикативного индивидуального гарантийного обеспечения по семизнамкам. По просьбам участников период перерасчёта риск-сценариев установлен в 10 мин.

9. Замена токенов MobilePass на Avanpost

Московская биржа приступает к переводу пользователей терминала MOEX Treasury на использование новых токенов Avanpost. Все пользователи аппаратных токенов получают новые физические токены бесплатно, пользователи программных токенов получают соответствующие инструкции по переходу. Первый месяц использования новых токенов будет бесплатен для всех пользователей. 20 декабря 2024 года все старые токены будут аннулированы.