

Информационные продукты

ИНДЕКСЫ

Индекс МосБиржи и Индекс РТС являются ключевыми индикаторами российского рынка ценных бумаг, в их базы расчета входят наиболее ликвидные акции крупнейших и динамично развивающихся российских эмитентов. Семейство индексов акций Биржи также состоит из Индекса голубых фишек, включающего 15 акций наиболее ликвидных и капитализированных эмитентов, Индекса акций средней и малой капитализации, состоящего из ликвидных акций компаний среднего и малого уровня капитализации, и Индекса акций широкого рынка, в который входят ценные бумаги, составляющие топ-100 акций российского рынка по ликвидности и капитализации. На основе разделения базы расчета Индекса широкого рынка по отраслевой принадлежности формируются корзины отраслевых индексов.

Семейство облигационных индексов Биржи включает индексы корпоративных, государственных и муниципальных облигаций, сегментированных по дюрации и кредитному качеству.

Кроме того, Биржа рассчитывает несколько тематических индексов – индикаторов определенного сегмента рынка, не входящих в основную линейку: индексы государственного сектора, инноваций и Индекс МосБиржи 10.

Ребрендинг индексной линейки

Биржа завершила ребрендинг всей индексной линейки. На первом этапе – в конце 2017 года – изменения затронули основной индикатор российского финансового рынка: Индекс ММВБ был переименован в Индекс МосБиржи (английское название – MOEX Russia Index, новый торговый код – IMOEX). На втором этапе – с 21 января 2019 года – еще 19 индикаторов получили новые наименования, в основе которых лежит бренд «Индекс МосБиржи». Индекс РТС, имеющий с Индексом МосБиржи одинаковые базы расчета, но разные валюты расчета, сохранил свое название.

Ребрендинг индексной линейки способствует росту узнаваемости и ценности бренда Группы, целостности восприятия Биржи и всего российского финансового рынка российскими и международными профессиональными инвестиционными сообществами, частными инвесторами.

Торговые коды индексов используются на сайте Биржи, в торговых системах фондового и срочного рынков, на информационно-статистическом сервере, в информационных продуктах, а также потоках FAST.

Новые индикаторы

Биржа начала расчет и публикацию нового индикатора денежного рынка – индекса MOEXREPO GCC, который определяется на основании сделок в режиме торгов репо с ЦК с КСУ. Он отражает стоимость обеспеченных денег, очищенную от контрагентского риска и специфики отдельных выпусков ценных бумаг, и позволяет быстро сопоставлять ставки на различных сегментах высоколиквидного рынка репо с ЦК. Индекс MOEXREPO GCC дополнил линейку индикаторов ставок репо с ЦК с облигациями и акциями.

В 2018 году Биржа предоставила управляющим активами и участникам, вовлеченным в процесс запуска и поддержки структурных финансовых продуктов, новую услугу по расчету индикативной стоимости чистых активов (Indicative Net Asset Value, iNAV). Данная услуга стала особенно актуальной в связи с появлением в 2018 году регулирования БПИФов.

В самом конце 2018 года Биржа начала расчет Индекса МосБиржи российских ликвидных еврооблигаций. Новый бенчмарк является индикатором рынка суверенных и корпоративных еврооблигаций, выпущенных российскими эмитентами или в интересах российских эмитентов. Индекс включает 10 наиболее ликвидных выпусков еврооблигаций высокого кредитного качества сроком до погашения от одного года до 10 лет и рассчитывается методом совокупного дохода.

Биржа осуществляет расчет индексов по заказу клиентов. Это могут быть индексы различных сегментов – акций, облигаций, обращающихся как на Бирже, так и на зарубежных площадках. Подобные индикаторы широко распространены во всем мире и используются для реализации индивидуальных стратегий клиентов.

Международное признание индикаторов

Результаты ежегодного внешнего аудита международной аудиторско-консалтинговой компании Ernst & Young подтвердили соответствие деятельности индекс-менеджмента 19 принципам Международной организации комиссий по ценным бумагам (International Organization of Securities Commissions, IOSCO).

Аудит прошли валютные фиксинги, индексы акций, государственных и корпоративных облигаций, индексы рынка активов пенсионных накоплений и индикаторы рынков репо и своп.

Аудиторское заключение свидетельствует о прозрачности процесса администрирования индексной деятельности, высоком качестве формирования, расчета и раскрытия информации по индикаторам, наличии внутреннего контроля над процессом создания, разработки и распространения финансовых индикаторов, бенчмарков рынка.

БИРЖЕВАЯ ИНФОРМАЦИЯ

Основным направлением деятельности Биржи в сфере оказания информационных услуг является предоставление биржевой информации (market data), содержащей ценовые, количественные и объемные параметры по заявкам и сделкам, совершаемым на рынках Биржи, а также агрегированные показатели, используемые в финансово-инвестиционной деятельности: рыночные цены и признаваемые котировки. Информационные сервисы, связанные с предоставлением биржевых данных, содержат котировальные потоки в режиме реального времени, официальные итоги торгов за каждую торговую сессию на каждом отдельно взятом рынке Биржи и архивные данные, накопленные Биржей за многолетний период. Котировальная информация, предоставляемая Биржей, активно используется в системах риск-менеджмента и автоматической торговли участников торгов, для размещения на публичных веб-сайтах информационных вендоров и участников торгов с целью привлечения новых клиентов, а также для создания новых производных индикаторов, отражающих состояние российского финансового рынка.

В качестве каналов доставки информации о торгах Биржа использует как инфраструктуру своих партнеров из числа ведущих российских и международных информационных агентств – вендоров (на текущий момент их более 20), так и интерфейсы собственного корпоративного интернет-сайта и разработанных специалистами Биржи специализированных программ. В рамках развития информационного бизнеса по предоставлению котировальных потоков и архивных данных Биржей заключено более 450 информационных договоров, из которых почти 400 – с российскими контрагентами.

В 2018 году успешно осуществлен запуск нового информационного сервиса для участников торгов – предоставления оперативных отчетов по нестандартным сделкам с целью повышения уровня внутреннего контроля за соответствием требованиям законодательства и регулятора финансовых рынков на стороне участников торгов. Сервис позволяет участникам в ежедневном режиме получать и реагировать на информацию о собственных нестандартных заявках и сделках, а также о нестандартных заявках и сделках своих клиентов. Помимо большей оперативности, участники торгов получили возможность равномерно распределить на месяц работу по анализу нестандартных заявок и сделок и подготовке ежемесячной отчетности перед регулятором.