

# Информационные продукты

Основным направлением деятельности Биржи в сфере оказания информационных услуг является предоставление биржевой информации, содержащей ценовые, количественные и стоимостные параметры заявок и сделок,

совершаемых на рынках Биржи, а также агрегированные показатели и индикаторы, используемые в финансово-инвестиционной деятельности: индексы, рыночные цены и признаваемые котировки.

## ИНДЕКСЫ

Индекс МосБиржи и Индекс РТС – ключевые индикаторы российского рынка ценных бумаг, в их базы расчета входят наиболее ликвидные акции крупнейших и динамично развивающихся российских эмитентов.

Семейство индексов акций Биржи состоит также из Индекса голубых фишек, включающего 15 акций наиболее ликвидных и капитализированных эмитентов, Индекса средней и малой капитализации, состоящего из ликвидных акций компаний среднего и малого уровня капитализации, и Индекса 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.

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

В 2019 году активное развитие получила услуга по расчету индикативной стоимости чистых активов (Indicative Net Asset Value, iNAV) для управляющих активами

и участников, вовлеченных в процесс запуска и поддержки структурных финансовых продуктов. Данная услуга востребована прежде всего управляющими биржевых паевых инвестиционных фондов (БПИФ). На конец 2019 года Биржа рассчитывала 24 iNAV для 19 биржевых фондов.

Кроме того, по итогам 2019 года число индексных биржевых фондов, повторяющих структуру бенчмарков Биржи, достигло 14, объем средств под их управлением составил 16,9 млрд рублей. За 2019 год было создано пять новых БПИФов на индексы Биржи.

## Новые индикаторы

С апреля 2019 года Биржа начала ежедневный расчет и публикацию индексов устойчивого развития «Ответственность и открытость» и «Вектор устойчивого развития». Они рассчитываются на основе анализа крупнейших российских компаний в области ESG (Environmental, Social, Governance), ежегодно осуществляемого Российским союзом промышленников и предпринимателей (РСПП). В базу расчета индексов входят ценные бумаги эмитентов, которые раскрывают наиболее полную информацию о деятельности в сфере устойчивого развития и корпоративной социальной ответственности.

Фондовый индекс «Ответственность и открытость» рассчитывается на основе цен акций 22 эмитентов – лидеров по раскрытию информации в области устойчивого развития, индекс «Вектор устойчивого развития» – на основе цен акций 15 эмитентов, показавших лучшую динамику показателей устойчивого развития к предыдущему году.

Состав баз расчета индексов пересматривается ежегодно. Значения индексов публикуются на сайтах Биржи и РСПП, а также транслируются через информационные агентства на ежедневной основе. Индексы устойчивого развития отмечены международной премией ISAR Honours – 2019.

В апреле 2019 года начался расчет нового индикатора денежного рынка – ставки RUSFAR, которая отражает стоимость обеспеченных денег и рассчитывается на базе репо с центральным контрагентом с клиринговыми сертификатами участия. В августе ставка RUSFAR начала рассчитываться также в долларах США. Таким образом, участникам рынка репо и валютных свопов предоставлены объективные рыночные индикаторы стоимости фондирования в российских рублях и в американской валюте.

Внедрена новая услуга – расчет индексов, сконфигурированных в соответствии с требованиями клиентов. Заказные индексы широко распространены во всем мире и используются для реализации индивидуальных клиентских стратегий. В 2019 году начат расчет восьми заказных индексов в сегментах еврооблигаций, корпоративных облигаций, акций и иностранных ценных бумаг.

## ***Международное признание индикаторов***

Ежегодный аудит, проведенный международной аудиторско-консалтинговой компанией Ernst & Young, подтвердил соответствие деятельности индекс-менеджмента Биржи 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 активов пенсионных накоплений, индикаторы рынков репо и своп, а также кривая бескупонной доходности государственных облигаций России, которые по итогам проверки были включены в Заявление о соответствии в 2019 году.

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

## БИРЖЕВАЯ ИНФОРМАЦИЯ

Информационные сервисы по предоставлению биржевых данных содержат котировальные потоки в режиме реального времени, официальные итоги торгов за каждую торговую сессию на любом 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.

Доставка информации о биржевых торгах клиентам осуществляется как посредством корпоративного интернет-сайта Биржи и специализированных программ, так и через инфраструктуру партнеров из числа ведущих российских и международных информационных агентств – вендоров. На конец 2019 года у Биржи были заключены договоры более чем с 30 вендорами, распространяющими биржевые данные в реальном времени, и более чем с 50 компаниями, распространяющими данные об итогах биржевых торгов.

Группа постоянно расширяет список информационных услуг и в данный момент предлагает более 70 уникальных сервисов (а вместе с технологическими услугами – более 200 сервисов) участникам торгов

и иным пользователям услуг финансового рынка. Исключительная экспертиза и высокий уровень компетенции позволяют Группе расширять линейку информационных и аналитических продуктов и сервисов, развивая их в новых областях.

В октябре 2019 года был запущен сервис по расчету индикативных ставок риска для ценных бумаг, не торгуемых на рынках Биржи. Данный сервис позволяет участникам торгов и их клиентам не осуществлять операции, приводящие к возникновению непокрытой позиции по указанным ценным бумагам. Ставки рассчитываются НКЦ по методике на основе нормативных актов Банка России.

Клиентам стал доступен новый информационный продукт «Репо» с агрегированными данными по торгам инструментами биржевого денежного рынка в режиме реального времени. Он позволяет клиентам получить консолидированную информацию о рынке репо в одном продукте.

Биржа реализовала сервис по предоставлению доступа к историческим данным торгов на рынке облигаций. Это способствует повышению интереса к данному сегменту фондового рынка со стороны новых потенциальных участников и инвесторов, в том числе благодаря возможности более глубокого анализа исторических данных по инструментам с фиксированной доходностью.

## АНАЛИТИЧЕСКИЕ ПРОДУКТЫ

Биржа регулярно предлагает новые аналитические продукты для брокеров, фондов, алгоритмических и высокочастотных трейдеров, позволяющие оценить эффективность данных профессиональных участников рынка, а также оптимизировать их деятельность.

В 2019 году состоялась презентация аналитического отчета «Анализ активности ритейл-клиентов на Московской бирже», из которого банки и брокеры могут получить агрегированную информацию о поведении их клиентов – физических лиц.

Разработан новый аналитический продукт «Портфель частного инвестора», который раскрывает долю наиболее популярных акций российских компаний в инвестиционных портфелях физических лиц. Продукт может быть использован аналитиками и инвестиционными консультантами, брокерскими компаниями и банками

с целью исследования предпочтений и поведения массового инвестора на рынке ценных бумаг.

Биржа продолжила работу по анализу притока и оттока клиентов. С декабря 2019 года публикуется ежемесечный отчет «Индикатор индивидуальных инвестиций» – информация по нетто-притоку/оттоку инвестиций частных лиц в акции.

В 2019 году реализована возможность получения через Web API Биржи исторических значений аналитического продукта «Агрегированный нетто-объем 2», доступ к которому участники получили в ноябре 2018 года. В нем представлен нетто-объем торгов по итогам дня топ-30, топ-70 и топ-100 клиентов по инструментам фондового, валютного и срочного рынков.