



Единый портал
Электронной подписи

**«Положение о деятельности по проведению
организованных торгов»**

(утв. Банком России 17.10.2014 № 437-П)

iesp.ru

ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

17 октября 2014 г. № 437-П

ПОЛОЖЕНИЕ О ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ПО ПРОВЕДЕНИЮ ОРГАНИЗОВАННЫХ ТОРГОВ

На основании Федерального закона от 21 ноября 2011 года № 325-ФЗ "Об организованных торгах" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2011, № 48, ст. 6726; 2012, № 53, ст. 7607; 2013, № 30, ст. 4084; № 51, ст. 6699) (далее - Федеральный закон "Об организованных торгах"), Федерального закона от 10 июля 2002 года № 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2002, № 28, ст. 2790; 2003, № 2, ст. 157; № 52, ст. 5032; 2004, № 27, ст. 2711; № 31, ст. 3233; 2005, № 25, ст. 2426; № 30, ст. 3101; 2006, № 19, ст. 2061; № 25, ст. 2648; 2007, № 1, ст. 9, ст. 10; № 10, ст. 1151; № 18, ст. 2117; 2008, № 42, ст. 4696, ст. 4699; № 44, ст. 4982; № 52, ст. 6229, ст. 6231; 2009, № 1, ст. 25; № 29, ст. 3629; № 48, ст. 5731; 2010, № 45, ст. 5756; 2011, № 7, ст. 907; № 27, ст. 3873; № 43, ст. 5973; № 48, ст. 6728; 2012, № 50, ст. 6954; № 53, ст. 7591, ст. 7607; 2013, № 11, ст. 1076; № 14, ст. 1649; № 19, ст. 2329; № 27, ст. 3438, ст. 3476, ст. 3477; № 30, ст. 4084; № 49, ст. 6336; № 51, ст. 6695, ст. 6699; № 52, ст. 6975; 2014, № 19, ст. 2311, ст. 2317; № 27, ст. 3634; № 30, ст. 4219) настоящее Положение устанавливает требования к порядку проведения организованных торгов, а также порядок ведения организаторами торговли реестра участников торгов и их клиентов, порядок ведения организаторами торговли реестра договоров, порядок и сроки расчета цен, индексов и иных показателей, требования к порядку хранения и защиты информации и документов, связанных с проведением организованных торгов, а также к сроку их хранения, правила, состав, порядок и сроки раскрытия (предоставления) информации организаторами торговли.

Глава 1. Требования к порядку проведения организованных торгов

1.1. С целью допуска лиц, указанных в частях 1 - 5 статьи 16 Федерального закона "Об организованных торгах", к участию в организованных торгах, а также с целью предоставления возможности по заключению договоров на организованных торгах в интересах клиентов участников торгов и клиентов, являющихся клиентами брокера или доверительного управляющего, которые, в свою очередь, являются клиентами участника торгов (далее - клиент второго уровня) (далее вместе - регистрируемые лица), организатор торговли осуществляет их регистрацию. При этом при проведении организованных торгов товарами организатор торговли регистрирует клиентов второго уровня в случаях, предусмотренных правилами организованных торгов.

При регистрации организатор торговли присваивает регистрируемым лицам уникальные коды, позволяющие идентифицировать регистрируемых лиц, на основании сведений, предоставленных участниками торгов и (или) клиринговой организацией.

В случае если это предусмотрено правилами организованных торгов, коды, присваиваемые участником торгов самостоятельно, также должны соответствовать требованиям настоящего Положения.

Организатор торговли вправе запрашивать дополнительную информацию от участника торгов, необходимую для регистрации участников торгов, клиентов участника торгов, клиентов второго уровня и предусмотренную правилами организованных торгов.

Организатор торговли информирует участников торгов о присвоенных регистрируемым лицам уникальных кодах в порядке, предусмотренном правилами организованных торгов.

1.2. Код регистрируемого лица - участника торгов должен включать:

для юридического лица - идентификационный номер налогоплательщика (далее - ИНН), а для иностранной организации, не имеющей ИНН, - код иностранной организации (далее - КИО). Для участника торгов, являющегося кредитной организацией, код регистрируемого лица также должен включать банковский идентификационный код кредитной организации (далее - БИК);

для иностранной организации, не имеющей ИНН и КИО, - уникальную последовательность символов, применяемых организатором торговли и (или) клиринговой организацией, осуществляющей клиринг по итогам организованных торгов, для присвоения кодов иностранной организации, не имеющей ИНН и КИО;

для индивидуального предпринимателя - номер и серию основного документа, удостоверяющего личность гражданина соответствующего государства на территории указанного

государства (далее - общегражданский паспорт). В случае если индивидуальный предприниматель является лицом без гражданства - реквизиты документа, удостоверяющего личность лица без гражданства в Российской Федерации;

для управляющего ценными бумагами - данные, предусмотренные [абзацем вторым](#) настоящего пункта, а также уникальную последовательность символов, однозначно указывающих на то, что этот код присвоен лицу, действующему в качестве доверительного управляющего. При этом количество кодов управляющего ценными бумагами определяется по количеству его клиентов (учредителей доверительного управления), в интересах которых он собирается заключать договоры на организованных торгах. Каждый код указанного участника торгов (клиента участника торгов) дополнительно должен содержать код клиента управляющего. Код клиента управляющего присваивается участником торгов самостоятельно в порядке, предусмотренном настоящим Положением;

для управляющей компании паевого инвестиционного фонда данные, предусмотренные [абзацем вторым](#) настоящего пункта, а также уникальную последовательность символов, однозначно указывающих на то, что этот код присвоен лицу, действующему в качестве доверительного управляющего этим паевым инвестиционным фондом. При этом регистрация учредителей управления паевым инвестиционным фондом не производится;

для управляющей компании, осуществляющей доверительное управление средствами пенсионных накоплений, сформированных в Пенсионном фонде Российской Федерации, - данные, предусмотренные [абзацем вторым](#) настоящего пункта, а также уникальную последовательность символов, однозначно указывающих на то, что этот код присвоен управляющей компании, действующей в качестве доверительного управляющего средствами пенсионных накоплений, сформированных в Пенсионном фонде Российской Федерации. Этот код также должен дополнительно включать признак, указывающий на соответствующий инвестиционный портфель;

для управляющей компании, осуществляющей доверительное управление средствами пенсионных накоплений, сформированных в негосударственном пенсионном фонде, средствами пенсионных резервов и имуществом, предназначенным для обеспечения уставной деятельности указанного негосударственного пенсионного фонда, - данные, предусмотренные [абзацем вторым](#) настоящего пункта, а также уникальную последовательность символов, однозначно указывающих на то, что этот код присвоен управляющей компании, действующей в качестве доверительного управляющего средствами негосударственного пенсионного фонда. При этом указанной управляющей компании присваивается три кода: для средств пенсионных накоплений, для средств пенсионных резервов, а также для имущества, предназначенного для обеспечения уставной деятельности, либо собственных средств негосударственного пенсионного фонда. Код учредителя доверительного управления - негосударственного пенсионного фонда включает в себя его ИНН, а также должен дополнительно включать признак, указывающий на то, какие средства являются объектом доверительного управления;

для управляющей компании, осуществляющей доверительное управление накоплениями для жилищного обеспечения военнослужащих, - данные, предусмотренные [абзацем вторым](#) настоящего пункта, а также уникальную последовательность символов, однозначно указывающих на то, что этот код присвоен управляющей компании, действующей в качестве доверительного управляющего накоплениями для жилищного обеспечения военнослужащих.

1.3. Код регистрируемого лица - клиента участника торгов, являющегося физическим лицом, должен включать:

для физического лица, достигшего возраста, с которого выдается общегражданский паспорт, номер и серию общегражданского паспорта;

для физического лица, не достигшего возраста, с которого выдается общегражданский паспорт, номер и серию документа, подтверждающего факт государственной регистрации рождения (свидетельство о рождении) регистрируемого лица;

для физического лица без гражданства реквизиты документа, удостоверяющего личность лица без гражданства в Российской Федерации.

Если регистрируемое лицо является лицом, не достигшим возраста, с которого выдается общегражданский паспорт, недееспособным или ограниченно дееспособным физическим лицом, код такого регистрируемого лица также включает номер и серию общегражданского паспорта лица, являющегося законным представителем такого регистрируемого лица.

1.4. Код регистрируемого лица - клиента участника торгов, являющегося юридическим лицом или индивидуальным предпринимателем (в случае, если в интересах индивидуального предпринимателя планируется заключение договоров на организованных торгах товарами),

формируется в соответствии с [пунктом 1.2](#) настоящего Положения.

В случае если клиентом участника торгов является брокер, лицо, включенное организатором торговли в список участников торгов товаром, действующих в интересах и за счет других лиц, или иностранное юридическое лицо, учрежденное в одном из государств, указанных в подпунктах 1 и 2 пункта 2 статьи 51.1 Федерального закона от 22 апреля 1996 года № 39-ФЗ "О рынке ценных бумаг" (Собрание законодательства Российской Федерации, 1996, № 17, ст. 1918; 2001, № 33, ст. 3424; 2002, № 52, ст. 5141; 2004, № 27, ст. 2711; № 31, ст. 3225; 2005, № 11, ст. 900; № 25, ст. 2426; 2006, № 1, ст. 5; № 2, ст. 172; № 17, ст. 1780; № 31, ст. 3437; № 43, ст. 4412; 2007, № 1, ст. 45; № 18, ст. 2117; № 22, ст. 2563; № 41, ст. 4845; № 50, ст. 6247, ст. 6249; 2008, № 52, ст. 6221; 2009, № 1, ст. 28; № 18, ст. 2154; № 23, ст. 2770; № 29, ст. 3642; № 48, ст. 5731; № 52, ст. 6428; 2010, № 17, ст. 1988; № 31, ст. 4193; № 41, ст. 5193; 2011, № 7, ст. 905; № 23, ст. 3262; № 27, ст. 3880; № 29, ст. 4291; № 48, ст. 6728; № 49, ст. 7040; № 50, ст. 7357; 2012, № 25, ст. 3269; № 31, ст. 4334; № 53, ст. 7607; 2013, № 26, ст. 3207; № 30, ст. 4043, ст. 4082, ст. 4084; № 51, ст. 6699; № 52, ст. 6985; 2014, № 30, ст. 4219) (далее - Федеральный закон "О рынке ценных бумаг"), и имеющее право в соответствии с личным законом осуществлять брокерскую деятельность, то указанному клиенту присваиваются коды по количеству клиентов такого брокера (иностранного юридического лица). При этом код клиента должен присваиваться в соответствии с требованиями [пунктов 1.2 - 1.4](#) настоящего Положения, за исключением требования о включении в код регистрируемого лица БИК и КИО, предусмотренного [абзацем вторым пункта 1.2](#) настоящего Положения.

1.5. Код регистрируемого лица - клиента второго уровня формируется в соответствии с [пунктами 1.2 - 1.4](#) настоящего Положения, за исключением требования о включении в код регистрируемого лица БИК и КИО, предусмотренного [абзацем вторым пункта 1.2](#) настоящего Положения.

1.6. Если регистрируемым лицом является иностранное юридическое или физическое лицо, его код должен также включать трехзначный цифровой код иностранного государства, в котором зарегистрировано юридическое лицо или гражданином которого является это лицо, соответствующий Общероссийскому классификатору стран мира. Если регистрируемое лицо является лицом без гражданства, код такого лица включает в себя трехзначный цифровой код "000".

1.7. Передача клиенту участником торгов технических средств, информации и (или) программного обеспечения, полученных участником торгов от организатора торговли (иного уполномоченного организатором торговли лица), если это предусмотрено соглашением участника торгов с организатором торговли (иным уполномоченным организатором торговли лицом), и подключение организатором торговли (иным уполномоченным организатором торговли лицом) клиента к программно-техническим средствам, предназначенным для осуществления деятельности по проведению организованных торгов, при наличии согласия на такое подключение участника торгов, который будет заключать на организованных торгах договоры в интересах этого клиента, допускаются после регистрации организатором торговли клиента участника торгов.

1.8. Организатор торговли вправе присваивать дополнительные коды, идентифицирующие участников торгов (клиентов участника торгов, клиентов второго уровня). При этом организатор торговли должен обеспечить возможность идентификации участника торгов (клиента участника торгов, клиента второго уровня) по такому коду в реестре участников торгов и их клиентов.

1.9. Организатор торговли вправе использовать информацию об участниках торгов, клиентах участников торгов, клиентах второго уровня, полученную от клиринговой организации, осуществляющей клиринг по итогам организованных торгов указанного организатора торговли, в целях их регистрации.

1.10. Организатор торговли проводит организованные торги в соответствии с требованиями, установленными настоящим Положением, правилами организованных торгов, а также иными внутренними документами организатора торговли, регламентирующими проведение организованных торгов.

1.11. Организатор торговли оказывает услуги по проведению организованных торгов в определенные правилами торгов дни (далее - торговые дни), при этом правилами торгов может быть предусмотрен порядок определения торговых дней.

В случае если организатор торговли планирует оказывать услуги по проведению организованных торгов в день, не определенный правилами организованных торгов, то организатор торговли обязан не позднее чем за три месяца до соответствующего дня уведомить Банк России о дате проведения организованных торгов, а также раскрыть информацию об этом на своем официальном сайте в информационно-телекоммуникационной сети "Интернет" (далее - сайт).

Организатор торговли обязан обеспечить наличие в течение календарного года хотя бы одного периода, включающего не менее трех календарных дней подряд, в которые организованные торги



данным организатором торговли не проводятся.

1.12. Организатор торговли определяет в течение торгового дня период (периоды) времени проведения организованных торгов (далее - торговая сессия).

При проведении нескольких торговых сессий в течение одного торгового дня правилами организованных торгов должно быть определено, какая из торговых сессий торгового дня является основной.

1.13. Организатор торговли определяет порядок и условия подачи заявок, а также порядок установления их соответствия друг другу с учетом следующих требований:

1.13.1. Договоры на организованных торгах заключаются на основании адресных или безадресных заявок, поданных участниками торгов. При этом безадресной заявкой признается заявка, которая адресована (информация о которой раскрывается) неограниченному кругу участников торгов (всем участникам торгов), в том числе в случае, когда в соответствии с правилами организованных торгов на основании такой заявки договор заключается с участием центрального контрагента. Все иные заявки признаются адресными.

Организатор торговли вправе дополнительно устанавливать иную классификацию заявок, подаваемых участниками торгов.

1.13.2. Поданные заявки проверяются на соответствие требованиям правил организованных торгов.

1.13.3. Организатор торговли устанавливает в правилах организованных торгов порядок определения цены, по которой будет заключаться договор на организованных торгах (определения иного условия заключаемого на организованных торгах договора).

1.13.4. Заявки, поданные за счет одного и того же лица (в соответствии с кодом этого лица, определяемым в соответствии с [пунктами 1.2 - 1.6](#) настоящего Положения), не являются основанием для заключения договора, за исключением договоров, заключаемых с участием центрального контрагента.

1.13.5. В течение первого дня обращения ценной бумаги на организованных торгах не допускается регистрация заявок (кроме заявок на заключение договоров репо), цена по которым превышает установленный организатором торговли размер предельных отклонений цен заявок на покупку/продажу ценной бумаги по сравнению с начальной ценой данной ценной бумаги.

1.13.6. При размещении ценных бумаг на организованных торгах заключение договоров на основании заявок, поданных участниками торгов до даты начала размещения ценных бумаг, осуществляется не ранее даты начала размещения таких ценных бумаг.

1.13.7. Организатор торговли вправе в рамках одной торговой сессии проводить торги в разном порядке и с различными условиями, определенными правилами организованных торгов (далее - режимы торгов).

Организатор торговли может установить несколько режимов торгов, действующих в рамках одной торговой сессии.

1.14. Организатор торговли обеспечивает с использованием средств проведения торгов фиксацию всех поступивших заявок. При фиксации заявки должна быть отражена следующая информация:

уникальный код заявки, присвоенный организатором торговли в момент ее поступления;

дата и время фиксации заявки;

статус заявки (зарегистрирована, не зарегистрирована);

причина отказа в регистрации заявки в реестре заявок. Перечень причин отказа в регистрации определяется в правилах организованных торгов.

Организатор торговли обязан по заявлению участника торгов предоставить сведения о заявках, поданных этим участником торгов и не прошедших регистрацию в реестре заявок, в течение одного месяца с даты получения указанного заявления.

1.15. Организатор торговли прекращает или приостанавливает организованные торги в случаях, указанных в настоящем пункте. Требования о прекращении или приостановлении организованных торгов распространяются на основную и дополнительную торговые сессии.

Требования, установленные в настоящем пункте, не применяются при заключении на организованных торгах договоров репо, за исключением случая приостановки торгов, указанного в [подпункте 1.15.3](#) настоящего пункта.

1.15.1. Организатор торговли, оказывающий услуги по проведению организованных торгов ценными бумагами, приостанавливает организованные торги:

акциями определенного выпуска, входящими в расчет индекса, изменение значения которого используется организатором торговли в целях приостановки организованных торгов (далее -

основной индекс), осуществляемые на основании безадресных заявок, при превышении или снижении на 20 процентов - в течение 10 минут подряд текущих цен акций, рассчитанных в течение данной торговой сессии, от цены закрытия акций предыдущего торгового дня;

акциями, осуществляемые на основании безадресных заявок, - при изменении на 15 процентов значения основного индекса в течение 10 минут подряд в ходе данной торговой сессии по сравнению с последним значением указанного индекса, рассчитанного в течение основной торговой сессии предыдущего торгового дня;

ценными бумагами эмитента - в случае опубликования эмитентом сообщения о государственной регистрации решения о выпуске (дополнительном выпуске) ценных бумаг, на основании которого ценные бумаги эмитента, допущенные к организованным торгам, подлежат конвертации (за исключением конвертации ценных бумаг в связи с реорганизацией эмитента);

ценными бумагами эмитента - в случае получения от депозитария, осуществляющего расчеты по результатам клиринга обязательств, возникающих из договоров, заключенных на организованных торгах данного организатора торговли (расчетного депозитария), уведомления о приостановлении (блокировании) операций с соответствующими ценными бумагами эмитента;

биржевыми облигациями в процессе их размещения - в случаях:

выявления нарушения эмитентом в ходе эмиссии биржевых облигаций требований законодательства Российской Федерации;

обнаружения в документах, на основании которых биржевые облигации в процессе их размещения были допущены к организованным торгам, недостоверной информации;

российскими депозитарными расписками - в случаях:

дробления российских депозитарных расписок;

дробления или консолидации представляемых ценных бумаг;

изменения объема и (или) порядка осуществления прав, закрепленных представляемыми ценными бумагами в соответствии с иностранным правом.

1.15.2. Организатор торговли, оказывающий услуги по проведению организованных торгов, на которых заключаются фьючерсные договоры (контракты), в случае, если приостановлены организованные торги, на которых определяется стоимость (значение) базисного актива фьючерсного договора (контракта), приостанавливает организованные торги, на которых заключаются такие договоры.

Данное требование не применяется, если правилами организованных торгов в качестве основания для приостановления торгов фьючерсными договорами (контрактами) установлено отклонение цен фьючерсных контрактов на установленную величину в течение определенного периода времени.

1.15.3. Организатор торговли приостанавливает организованные торги в случае выявления технических сбоев в работе средств проведения торгов, соответствующих критериям, установленным организатором торговли по согласованию с совещательным органом, созданным в соответствии с пунктами 2 - 5 приложения 1 к настоящему Положению. Указанные критерии должны содержаться в правилах организованных торгов.

1.15.4. Организатор торговли приостанавливает организованные торги в следующих случаях:

в случаях, указанных в абзацах втором и третьем подпункта 1.15.1 и подпункте 1.15.2 настоящего пункта, организатор торговли обязан приостановить организованные торги в течение пяти минут с момента выявления соответствующего события;

в случае раскрытия информации в соответствии с абзацем четвертым подпункта 1.15.1 настоящего пункта организованные торги приостанавливаются не позднее начала торговой сессии (первой торговой сессии) даты конвертации;

в случае получения уведомления в соответствии с абзацем пятым подпункта 1.15.1 настоящего пункта, организатор торговли приостанавливает организованные торги не позднее начала торговой сессии (первой торговой сессии) дня наступления события, информация о котором содержится в указанном сообщении (уведомлении). В случае если организатор торговли получил уведомление, указанное в абзаце пятом подпункта 1.15.1 настоящего пункта, в день приостановления (блокирования) операций с соответствующими ценными бумагами эмитента, то организованные торги приостанавливаются в день получения такого уведомления;

в случаях, указанных в абзацах седьмом и восьмом подпункта 1.15.1 настоящего пункта, организатор торговли приостанавливает организованные торги в день выявления соответствующего нарушения;

в случаях, указанных в абзацах десятом - двенадцатом подпункта 1.15.1 настоящего пункта, организатор торговли приостанавливает организованные торги не позднее, чем за три рабочих дня

до предполагаемой даты наступления соответствующего события;

в случае, указанном в подпункте 1.15.3 настоящего пункта, организатор торговли приостанавливает организованные торги в течение пяти минут с момента выявления технического сбоя.

1.15.5. При приостановке организованных торгов по основаниям, указанным в абзацах втором и третьем подпункта 1.15.1 настоящего пункта, последующая приостановка организованных торгов акциями в течение торгового дня осуществляется только в следующих случаях:

изменения на 20 процентов в течение 10 минут подряд текущей цены акции, рассчитанной в течение данной торговой сессии, по сравнению с последней текущей ценой до момента приостановки торгов;

изменения на 15 процентов значения основного индекса в течение десяти минут подряд в ходе данной торговой сессии по сравнению с последним значением указанного индекса, рассчитанным в течение основной торговой сессии до момента приостановки торгов.

При этом в случаях приостановки организованных торгов по основаниям, указанным в абзацах втором и третьем настоящего пункта, последующая приостановка организованных торгов в течение этого торгового дня не осуществляется.

1.15.6. В случае наступления события, предусмотренного в абзаце третьем подпункта 1.15.1 настоящего пункта, организатор торговли, не рассчитывающий основной индекс, приостанавливает организованные торги по каждой акции, допущенной им к организованным торгам.

1.15.7. Приостановка организованных торгов в случаях, указанных в абзацах втором и третьем подпункта 1.15.1, подпункте 1.15.2 и абзацах втором и третьем подпункта 1.15.5 настоящего пункта, осуществляется не позднее, чем за два часа до окончания основной торговой сессии.

1.15.8. Требования, установленные в абзацах втором и третьем подпункта 1.15.1, а также подпунктах 1.15.6 и 1.15.7 настоящего пункта, не применяются в режимах торгов, ценовая информация по итогам которых не используется организатором торговли в расчете рыночных цен, а также при проведении торгов в порядке, предусмотренном подпунктом 1.15.9 настоящего пункта.

1.15.9. Организатор торговли вправе осуществлять организованные торги путем сбора в течение определенного периода времени заявок с последующим заключением договоров по определенной организатором торговли цене (ценам) в порядке, установленном правилами организованных торгов. При этом правилами организованных торгов должны быть определены:

период времени, в течение которого могут быть поданы заявки для участия в таких торгах;

минимальное количество участников торгов, подавших заявки для участия в таких торгах, необходимое для их проведения;

минимальное совокупное количество ценных бумаг в заявках на покупку и в заявках на продажу, поданных для участия в таких торгах, необходимое для их проведения;

порядок определения цены (цен), по которой (которым) заключаются договоры в ходе таких торгов.

1.15.10. В случае приостановления организованных торгов, вызванного техническим сбоем в работе средств проведения торгов, организатор торговли обязан в порядке, предусмотренном правилами организованных торгов, предоставить участникам торгов возможность отозвать поданные ими заявки не менее чем за пятнадцать минут до возобновления организованных торгов.

1.15.11. Организованные торги возобновляются по решению организатора торговли. При этом организованные торги не могут быть возобновлены:

ранее, чем через 30 минут с момента приостановки организованных торгов в случаях, указанных в абзацах втором и третьем подпункта 1.15.1, а также в случае повторной приостановки в соответствии с подпунктом 1.15.5 настоящего пункта;

до устранения выявленного нарушения в пределах срока размещения биржевых облигаций;

ранее торгового дня, следующего за днем вступления в силу зарегистрированных изменений в решение о выпуске российских депозитарных расписок, обусловленных случаями, указанными в абзаце двенадцатым подпункта 1.15.1 настоящего пункта;

до момента возобновления организованных торгов, на которых определяется стоимость (значение) базисного актива фьючерсного договора (контракта), в случае приостановки организованных торгов в соответствии с абзацем первым подпункта 1.15.2 настоящего пункта.

1.15.12. Организатор торговли может предусмотреть дополнительные основания приостановления организованных торгов.

1.15.13. Организованные торги могут быть приостановлены или прекращены по решению Председателя Банка России (его заместителя).

Решение Председателя Банка России (его заместителя) оформляется соответствующим



предписанием Банка России, содержащим в том числе вид (тип) ценной бумаги, валюты, товара или производного финансового инструмента (далее - торгуемые инструменты) (в случае приостановления или прекращения организованных торгов конкретным инструментом - наименование и иные, необходимые для идентификации такого инструмента сведения) и срок действия приостановки.

1.16. Организатор торговли обязан осуществлять мониторинг организованных торгов, а также контроль за участниками торгов и иными лицами в случаях, установленных законодательством Российской Федерации (далее - мониторинг и контроль).

Мониторинг и контроль в процессе организованных торгов осуществляются организатором торговли по критериям нестандартных сделок (за исключением заключения договоров купли-продажи товаров, договоров репо и иных договоров, по которым одна сторона (продавец) обязуется в срок, установленный этими договорами, передать в собственность другой стороне (покупателю) имущество, а покупатель обязуется принять имущество и уплатить за него определенную денежную сумму, а также по которым покупатель обязуется в последующем в срок, установленный этими договорами, передать имущество в собственность продавца, а продавец обязуется принять имущество и уплатить за него определенную денежную сумму), предусмотренным [пунктом 1.19](#) настоящего Положения, а также по сочетаниям таких критериев с учетом установленных параметров. Сочетание критериев и их параметры определяются организатором торговли.

Критерии отнесения договоров купли-продажи товаров, договоров репо и иных договоров, по которым одна сторона (продавец) обязуется в срок, установленный этими договорами, передать в собственность другой стороне (покупателю) имущество, а покупатель обязуется принять имущество и уплатить за него определенную денежную сумму, а также по которым покупатель обязуется в последующем в срок, установленный этими договорами, передать имущество в собственность продавца, а продавец обязуется принять имущество и уплатить за него определенную денежную сумму, к нестандартным договорам организатор торговли устанавливает в соответствующей методике.

1.17. Организатор торговли в правилах организованных торгов устанавливает меры воздействия к участникам торгов, в отношении которых осуществляется контроль.

1.18. Организатор торговли создает автоматизированную систему мониторинга организованных торгов, обеспечивающую непрерывное отслеживание организатором торговли цен, объемов и иных характеристик регистрируемых заявок и договоров.

1.19. Система мониторинга организованных торгов должна технически обеспечивать осуществление мониторинга и контроля по следующим обязательным критериям:

отклонение цены договора (заявки) от цены закрытия предыдущего торгового дня на установленную величину;

отклонение цены договора (заявки) от цены последнего договора (заявки) на установленную величину;

отклонение цены договора от текущей цены на установленную величину;

отклонение основного индекса на установленную величину;

заключение участником торгов в своих интересах либо в интересах одного и того же клиента ряда договоров, ведущих к изменению цены в одном направлении;

заключение между участниками торгов договоров, в которых эти участники торгов попеременно выступают продавцами и покупателями;

превышение доли договоров, заключенных участником торгов, от общего объема организованных торгов торгуемыми инструментами за соответствующую торговую сессию на установленную величину;

отклонение суммы договоров, заключенных участником торгов за соответствующую торговую сессию, от среднего значения такой суммы договоров, заключаемых этим участником торгов соответственно за основную или дополнительную торговую сессию, на установленную величину;

изменение объема организованных торгов за определенный период на установленную величину;

количество поданных участником торгов заявок и заключенных им договоров за установленный период времени;

заключение участником торгов за установленный период времени договоров в своих интересах по лучшим ценам (более низким при покупке и более высоким при продаже), чем по договорам, заключенным в интересах клиентов.

В случае если в соответствии с правилами организованных торгов организованные торги проводятся в двух и более секциях или в разных режимах торгов, то в целях осуществления мониторинга и контроля определение значений цены закрытия, текущей цены, а также объема



торгов и доли заключенных участником торгов договоров в этом объеме осуществляется организатором торговли отдельно по договорам, заключенным в каждой из секций (каждом режиме торгов).

1.20. Параметры критериев, предусмотренных в [пункте 1.19](#) настоящего Положения, устанавливаются в зависимости от периода торгового дня.

Параметры могут устанавливаться организатором торговли также по различным группам ценных бумаг, товаров, валют или производных финансовых инструментов, определенным организатором торговли и включенным в перечень критериев нестандартных сделок.

1.21. Организатор торговли вправе включить в перечень критериев нестандартных сделок дополнительные критерии или сочетания критериев, при которых сделки (заявки) квалифицируются как нестандартные.

1.22. Организатор торговли осуществляет следующие действия:

выявляет нестандартные сделки (заявки), заключенные (поданные) в ходе торгов;

проверяет нестандартные сделки (заявки) на предмет неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком;

проверяет нестандартные сделки (заявки) на предмет нарушения внутренних документов организатора торговли;

контролирует соблюдение участниками торгов - профессиональными участниками рынка ценных бумаг и управляющими компаниями инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов показателей и нормативов, установленных для них нормативными актами Банка России.

1.23. Если в ходе проверки нестандартной сделки (заявки) выявляется, что полномочия организатора торговли для установления правомерности действий сторон по договору недостаточно либо ему оказывается противодействие в проведении проверки, организатор торговли направляет все имеющиеся материалы по нестандартной сделке (заявке) в Банк России.

1.24. При наличии оснований квалифицировать нестандартную сделку (заявку) как нарушение внутренних документов организатора торговли уполномоченное лицо (орган) организатора торговли принимает решение о применении мер к участникам торгов, являющимся сторонами такой сделки или подавшими заявки.

1.25. Торговая система оказывает услуги по проведению организованных торгов, на которых заключаются договоры, являющиеся производными финансовыми инструментами, только в отношении договоров, которые в соответствии с требованиями нормативных актов Банка России подлежат обязательному клирингу с участием центрального контрагента в случае их заключения не на организованных торгах.

1.26. Организатор торговли при заключении договоров с юридическими лицами или индивидуальными предпринимателями на оказание услуг и (или) выполнение работ, обеспечивающих осуществление деятельности, связанной с организацией и проведением торгов (аутсорсинг), должен предусмотреть меры, связанные с рисками заключения таких договоров (далее - договоры аутсорсинга).

1.27. Организатор торговли соблюдает требования к программно-техническим средствам, предназначенным для осуществления деятельности по проведению организованных торгов (далее - средства проведения торгов), в соответствии с [приложением 1](#) к настоящему Положению.

Глава 2. Порядок ведения реестра участников торгов и их клиентов, реестра заявок и реестра договоров, заключенных на организованных торгах, требования к порядку и срокам предоставления выписок из указанных реестров

2.1. Организатор торговли ведет реестр участников торгов и их клиентов, содержащий следующие сведения:

полное наименование участника торгов;

код участника торгов, присвоенный организатором торговли;

код (коды) каждого клиента участника торгов и каждого клиента второго уровня;

место нахождения (адрес), номер телефона и факса, адрес электронной почты участника торгов;

ИНН участника торгов или данные, предусмотренные [пунктом 1.2](#) настоящего Положения;

дата включения участника торгов (клиента участника торгов, клиента второго уровня) в реестр участников торгов и их клиентов;

иные сведения, предусмотренные внутренними документами организатора торговли.

2.2. Реестр участников торгов и их клиентов может состоять из нескольких разделов,

определенных для разных торговых (биржевых) секций организатора торговли и (или) групп (категорий) участников торгов (клиентов участников торгов, клиентов второго уровня).

2.3. Внутренними документами организатора торговли должен быть предусмотрен порядок актуализации кода участника торгов в случае изменения сведений об участнике торгов, его клиенте или клиенте второго уровня.

При этом организатор торговли актуализирует код не позднее следующего рабочего дня со дня получения необходимой информации.

2.4. Организатор торговли осуществляет ведение реестра заявок с учетом следующих требований.

2.4.1. Регистрация поданной заявки в реестре заявок осуществляется только в случае ее соответствия требованиям правил организованных торгов.

2.4.2. Регистрация заявок в реестре заявок осуществляется в порядке очередности их фиксации в соответствии с [пунктом 1.14](#) настоящего Положения.

2.4.3. Реестр заявок должен содержать следующие сведения:

идентификационный номер заявки, присвоенный организатором торговли в момент ее регистрации в реестре заявок;

уникальный код заявки, присвоенный в соответствии с [пунктом 1.14](#) настоящего Положения (может совпадать с идентификационным номером заявки);

код участника торгов, подавшего заявку (в том числе код (коды, если предусмотрена возможность подачи заявки по поручению или в интересах нескольких лиц) клиента (клиентов) участника торгов, по поручению или в интересах которого (которых) подана заявка), дополнительные коды, указанные в [пункте 1.8](#) настоящего Положения;

код клирингового брокера, если заявка подана с указанием клирингового брокера;

указание на то, что заявка подана во исполнение обязательств маркет-мейкера, если заявка подана во исполнение указанных обязательств;

вид заявки;

условия заявки, в том числе количество торгуемого инструмента, в отношении которого подана заявка (количество торгуемого инструмента, в отношении которого подана заявка для каждого клиента, если заявка подана по поручению или в интересах нескольких клиентов);

дата и время регистрации заявки;

дата и время исполнения (отзыва) заявки;

результат подачи заявки (на исполнении, исполнена частично, исполнена, отозвана, аннулирована и тому подобное);

причина аннулирования заявки;

иные сведения, предусмотренные организатором торговли.

2.4.4. Организатор торговли обязан по заявлению участника торгов предоставить выписку из реестра заявок в отношении заявок, поданных этим участником торгов, в течение месяца с даты получения указанного заявления.

2.5. Организатор торговли осуществляет ведение реестра договоров, заключенных на организованных торгах, с учетом следующих требований.

2.5.1. Реестр договоров, заключенных на организованных торгах, должен содержать следующие сведения:

стандартные условия договоров (за исключением цены договора (иного, аналогичного ей, условия договора);

идентификационные номера заявок, на основании которых заключен договор;

идентификационный номер договора;

дату и время регистрации договора;

коды участников торгов, подавших заявки, на основании которых заключается договор (в случае заключения договора с участием центрального контрагента - код участника торгов, заключившего договор, и указание на то, что договор заключен с участием центрального контрагента), включая коды клиентов участников торгов, по поручению или в интересах которых заключен договор (заключены договоры), и коды клиентов второго уровня, по поручению или в интересах которых заключен договор (заключены договоры), дополнительные коды, указанные в [пункте 1.8](#) настоящего Положения;

наименование (код) торгуемого инструмента (вид договора и объект договора). В случае если торгуемым инструментом является ценная бумага, то раскрывается наименование эмитента, вид, категория (тип), серия ценных бумаг, наименование управляющей компании и название паевого инвестиционного фонда, наименование управляющего ипотечным покрытием и индивидуальное



обозначение, идентифицирующее ипотечные сертификаты участия;
цену одного торгуемого инструмента (иное, аналогичное ей, условие договора);
количество торгуемого инструмента, в том числе количество торгуемого инструмента для каждого клиента по договору, заключенному по поручению или в интересах нескольких клиентов;
сумму заключенного договора;
иные сведения, предусмотренные организатором торговли.

2.5.2. Организатор торговли предоставляет каждому из участников торгов выписку из реестра договоров о договорах, заключенных участником торгов (клиентами участника торгов) до 19 часов местного времени в течение текущего торгового дня, не позднее 20 часов местного времени текущего торгового дня, а о договорах, заключенных участником торгов (клиентами участника торгов) после 19 часов местного времени в течение текущего торгового дня, не позднее 20 часов местного времени следующего торгового дня.

При этом организатор торговли в правилах организованных торгов должен предусмотреть порядок выдачи выписок из реестра договоров в случаях, когда в течение торгового дня происходили технические сбои, приведшие к изменению времени окончания торгов.

2.6. Организатор торговли вправе взимать с участников торгов плату за предоставление выписок из реестра заявок и реестра договоров в случае, если участник торгов требует предоставить указанные выписки на бумажном носителе либо при одновременном соблюдении следующих условий:

в соответствии с запросом участника торгов выписка предоставляется о заявках или договорах, поданных или заключенных им в течение более чем одного месяца;

в течение одного месяца, предшествующего дню получения запроса от участника торгов, организатор торговли предоставлял такому участнику торгов выписки из реестра договоров или реестра заявок.

2.7. Реестры организатора торговли ведутся в электронной форме или в бумажной и электронной формах, при этом реестры должны позволять составлять выписки из них на любую дату и за любой период.

Глава 3. Показатели, рассчитываемые организатором торговли

3.1. При проведении организованных торгов организатор торговли рассчитывает цены, индексы, а также иные показатели (коэффициенты, количественные и ценовые показатели), устанавливаемые на основании информации о договорах, заключенных на организованных им торгах, и иной информации.

3.1.1. К количественным показателям относятся:

общее количество заключенных на организованных торгах договоров;

общий объем заключенных договоров в стоимостном выражении;

общее количество в единицах измерения, применяемых для определения количества данного вида торгуемого инструмента, являющегося объектом заключенных договоров.

3.1.2. К ценовым показателям относятся:

на организованных торгах ценными бумагами - цена закрытия, признаваемая котировка, рыночная цена, текущая цена, средневзвешенная цена;

на организованных торгах валютой - курс валюты, определенный в порядке, установленном правилами организованных торгов;

на организованных торгах товарами - рыночная цена, средневзвешенная цена;

на организованных торгах, на которых заключаются договоры, являющиеся производными финансовыми инструментами, - текущая цена (расчетная цена) договора или иное, аналогичное ей, условие договора;

на организованных торгах, на которых заключаются договоры репо - текущее (актуальное) значение ставки репо, средневзвешенное значение ставки репо.

3.1.3. Биржа дополнительно к показателям, установленным в подпункте 3.1.2 настоящего пункта, рассчитывает на основании информации о заключенных внебиржевых договорах купли-продажи ценных бумаг, полученной в соответствии с нормативными актами Банка России, устанавливающими предоставление указанной информации, следующие ценовые показатели:

расчетную цену каждой ценной бумаги, являющейся предметом внебиржевых договоров, на основании которых приобретено менее пяти процентов от общего количества находящихся в обращении соответствующих ценных бумаг;

расчетную цену каждой ценной бумаги, являющейся предметом внебиржевых договоров, на



основании которых приобретено пять процентов и более от общего количества находящихся в обращении соответствующих ценных бумаг.

3.2. Организатор торговли, оказывающий услуги по заключению договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых являются ценные бумаги или индекс на ценные бумаги, дополнительно к показателям, установленным в подпунктах 3.1.1 и 3.1.2 пункта 3.1 настоящего Положения, рассчитывает следующие коэффициенты:

коэффициенты корреляции;

коэффициенты зависимости изменений цены каждой ценной бумаги, допущенной к организованным торгам (индекса на ценные бумаги, являющегося базисным активом производного финансового инструмента, договоры в отношении которого заключаются на организованных торгах), от изменений цены каждой ценной бумаги (значения каждого индекса), являющейся базисным активом производного финансового инструмента, договоры в отношении которого заключаются на организованных торгах (далее - коэффициенты "бета");

коэффициент, рассчитываемый в соответствии с пунктом 8.4 приложения 2 к настоящему Положению (далее - коэффициент "дельта"), и теоретическую цену опциона (в случае, если организатор торговли оказывает услуги по проведению организованных торгов, на которых заключаются опционные договоры).

3.3. Показатели, установленные в подпунктах 3.1.1 и 3.1.2 пункта 3.1, а также пункте 3.2 настоящего Положения, рассчитываются в соответствии с [приложением 2](#) к настоящему Положению.

3.4. Организатор торговли вправе предоставлять информацию о рассчитываемых им показателях заинтересованным лицам, если такая информация не является служебной и не содержит коммерческую тайну.

3.5. Расчет индексов осуществляется организатором торговли в соответствии с установленными им методиками. При этом методики расчета индексов должны соответствовать требованиям, установленным в [приложении 3](#) к настоящему Положению.

Методика расчета основного индекса и вносимые в нее изменения подлежат регистрации в Банке России.

Глава 4. Требования к порядку хранения и защиты информации

4.1. Организатор торговли утверждает внутренний документ, устанавливающий требования к порядку хранения и защиты информации и документов, связанных с проведением организованных торгов, а также к сроку их хранения, с учетом следующих положений.

4.1.1. Организатор торговли принимает меры по защите информации по следующим направлениям:

обеспечение защиты информации при управлении доступом и регистрацией;

обеспечение защиты информации на этапах жизненного цикла автоматизированных систем;

обеспечение защиты информации средствами антивирусной защиты;

обеспечение защиты информации при использовании ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет";

обеспечение защиты информации с использованием средств криптографической защиты информации;

обеспечение защиты информации при назначении и распределении ролей;

организация деятельности службы информационной безопасности;

управление рисками нарушения защиты информации;

регламентация и документирование деятельности по обеспечению защиты информации;

повышение осведомленности работников в области обеспечения защиты информации;

обнаружение инцидентов информационной безопасности и реагирование на них;

мониторинг и анализ обеспечения защиты информации;

своевременное совершенствование обеспечения защиты информации.

4.1.2. Организатор торговли устанавливает перечень лиц, имеющих доступ к информации и сведениям.

4.1.3. Организатор торговли предусматривает меры, направленные на защиту баз данных от ошибок и несанкционированного доступа, в том числе:

определяет порядок доступа к базам данных и обеспечивает защиту от несанкционированного доступа к базам данных;

определяет порядок использования паролей и других средств, ограничивающих доступ к базам данных;



устанавливает принимаемые организатором торговли и участниками торгов меры, направленные на предотвращение сбоев и ошибок в работе средств проведения торгов;

осуществляет ежедневное резервное копирование информации, содержащейся в реестрах, которые ведет организатор торговли.

4.2. Биржа обязана обеспечить хранение и защиту всей информации о внебиржевых договорах купли-продажи товаров и ценных бумаг, предоставленной ей в соответствии с нормативными правовыми актами Правительства Российской Федерации и нормативными актами Банка России, устанавливающими обязанность по предоставлению указанной информации.

4.3. Если иной срок хранения соответствующей информации не установлен федеральными законами и принятыми в соответствии с ними нормативными актами, организатор торговли хранит информацию и документы, связанные с осуществлением им деятельности по проведению организованных торгов в течение пяти лет.

Глава 5. Раскрытие информации и предоставление документов организатором торговли

5.1. Перечень информации, подлежащей раскрытию на сайте, предоставлению в Банк России и участникам торгов, а также сроки ее предоставления и раскрытия определены в [приложении 4](#) к настоящему Положению.

5.2. Организатор торговли предоставляет документы и информацию, указанные в пунктах 18 - 31 приложения 4 к настоящему Положению, в Банк России в виде электронных документов, подписанных усиленной квалифицированной электронной подписью в соответствии с Федеральным законом от 6 апреля 2011 года № 63-ФЗ "Об электронной подписи" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2011, № 15, ст. 2036; № 27, ст. 3880; 2012, № 29, ст. 3988; 2013, № 14, ст. 1668; № 27, ст. 3463, ст. 3477; 2014, № 26, ст. 3390), без представления на бумажном носителе.

5.3. Организатор торговли уведомляет участников торгов о технических сбоях в работе средств проведения торгов в течение торгового дня в порядке, предусматривающем использование основного и (или) резервного способа направления соответствующих уведомлений.

5.4. Организатор торговли раскрывает информацию с учетом следующих требований.

5.4.1. Основная страница сайта должна содержать ссылку на раздел сайта с информацией, раскрываемой организатором торговли в соответствии с настоящим Положением, или ссылки на иные разделы сайта, содержащие такую информацию. Ссылка с основной страницы сайта должна однозначным образом свидетельствовать о содержании соответствующей информации, опубликованной на указанной странице.

5.4.2. Организатор торговли обеспечивает свободный круглосуточный доступ к информации, которая подлежит раскрытию в соответствии с настоящим Положением и иными нормативными актами Банка России в информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", всем заинтересованным лицам для ознакомления без взимания платы.

5.4.3. Структура сайта должна предусматривать раскрытие информации, связанной с техническими сбоями и приостановкой торгов, на основной странице сайта.

5.5. Организатор торговли вправе раскрывать иную информацию, за исключением информации, составляющей коммерческую и иную охраняемую законом тайну.

Глава 6. Заключительные положения

6.1. Настоящее Положение вступает в силу по истечении 10 дней после дня его официального опубликования в "Вестнике Банка России".

6.2. Со дня вступления в силу настоящего Положения не применять:

приказ Федеральной службы по финансовым рынкам от 28 декабря 2010 года № 10-78/пз-н "Об утверждении Положения о деятельности по организации торговли на рынке ценных бумаг", зарегистрированный Министерством юстиции Российской Федерации 25 марта 2011 года № 20295 (Бюллетень нормативных актов федеральных органов исполнительной власти от 2 мая 2011 года № 18);

пункт 1 приказа ФСФР России от 17 ноября 2011 года № 11-60/пз-н "О внесении изменений в некоторые нормативные правовые акты Федеральной службы по финансовым рынкам", зарегистрированного Министерством юстиции Российской Федерации 9 декабря 2011 года № 22527 (Российская газета от 14 декабря 2011 года);

пункт 25 приказа ФСФР России от 24 апреля 2012 года № 12-27/пз-н "О внесении изменений в некоторые нормативные правовые акты Федеральной службы по финансовым рынкам",



зарегистрированного Министерством юстиции Российской Федерации 1 июня 2012 года № 24428 (Российская газета от 6 июля 2012 года);

пункт 1 приказа ФСФР России от 20 ноября 2012 года № 12-96/пз-н "О внесении изменений в некоторые нормативные правовые акты Федеральной службы по финансовым рынкам", зарегистрированного Министерством юстиции Российской Федерации 18 декабря 2012 года № 26176 (Российская газета от 24 декабря 2012 года).

6.3. Организаторы торговли должны привести свою деятельность в соответствие с настоящим Положением в течение шести месяцев после дня его вступления в силу, за исключением деятельности по проведению организованных торгов на товарном рынке.

Деятельность по проведению организованных торгов на товарном рынке должна быть приведена организатором торговли в соответствие с настоящим Положением в течение девяти месяцев после дня его вступления в силу.

Председатель Центрального банка
Российской Федерации
Э.С.НАБИУЛЛИНА

**ТРЕБОВАНИЯ
К РАБОТЕ С ПРОГРАММНО-ТЕХНИЧЕСКИМИ СРЕДСТВАМИ,
ПРЕДНАЗНАЧЕННЫМИ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ
ПО ПРОВЕДЕНИЮ ОРГАНИЗОВАННЫХ ТОРГОВ**

1. Организатор торговли в отношении средств проведения торгов соблюдает следующие требования:

использует основной и резервный комплексы средств проведения торгов, расположенные на территории Российской Федерации;

осуществляет контроль (аудит) основных процессов создания и эксплуатации автоматизированных систем, входящих в состав средств проведения торгов, включая контроль обеспечения информационной безопасности, на соответствие требованиям документов, разрабатываемых в рамках законодательства Российской Федерации о техническом регулировании с учетом положений международных стандартов (далее - операционный аудит), не реже одного раза в два года с привлечением независимых консультантов;

составляет календарный план внедрения средства проведения торгов;

осуществляет испытательные работы (тестирование) средств проведения торгов. Испытательные работы (тестирование) средств проведения торгов осуществляются путем имитации технических условий проведения реальных организованных торгов, а при необходимости - путем проведения пробной эксплуатации;

при введении в эксплуатацию средств проведения торгов их приведение в рабочее состояние осуществляется не менее чем за два часа до начала проведения организованных торгов. По согласованию с Банком России указанный срок может быть уменьшен.

2. Организатор торговли формирует совещательный орган (далее - технический комитет), в компетенцию которого входит:

согласование сроков (дат, календарного плана) внедрения (обновления) средств проведения торгов;

участие в испытательных работах (тестировании) внедряемых (обновляемых) средств проведения торгов;

рассмотрение отчетов организатора торговли, составленных по итогам технических сбоев, и подготовка рекомендаций по итогам рассмотрения;

подготовка рекомендаций по возможному усовершенствованию средств проведения торгов;

согласование критериев приостановки организованных торгов в связи с выявлением технических сбоев. В случае если технический комитет не согласовал предложенные организатором торговли критерии приостановки организованных торгов, то организатор торговли вправе принять мотивированное решение об утверждении таких критериев приостановки организованных торгов.

3. Технический комитет формируется из представителей (экспертов) участников торгов, организатора торговли и иных заинтересованных организаций. При этом не менее восьмидесяти процентов от состава технического комитета должны составлять лица, предложенные участниками торгов.

4. Организатор торговли разрабатывает положение о техническом комитете, в том числе устанавливающее порядок формирования технического комитета, его работы, а также требования к членам технического комитета.

5. Организатор торговли должен сформировать технический комитет в течение шести месяцев с даты получения лицензии биржи или лицензии торговой системы. Организатор торговли может не формировать технический комитет, если он входит в группу лиц (организаций) вместе с другим организатором торговли, сформировавшим технический комитет, который состоит не менее чем на тридцать процентов из лиц, предложенных участниками торгов организатора торговли, не формирующего технический комитет.

В случае если в указанную группу лиц (организаций) входит более двух организаторов торговли, то состав сформированного одним из таких организаторов торговли технического комитета должен не менее чем на десять процентов состоять из лиц, предложенных участниками торгов каждого



организатора торговли, не формирующего технический комитет.

6. Заседание технического комитета признается состоявшимся, если в нем участвовали более половины его членов.

7. В случае если технический комитет не согласовал предложенную организатором торговли дату (сроки) внедрения (обновления) средств проведения торгов, то такие внедрения (обновления) средств проведения торгов вводятся не ранее чем через месяц после даты, предложенной организатором торговли. При этом организатор торговли может принять мотивированное решение о внедрении (обновлении) средств проведения торгов до истечения месячного срока от вышеуказанной даты (срока).

Приложение 2
к Положению Банка России
от 17 октября 2014 г. № 437-П
"О деятельности по проведению
организованных торгов"

**ТРЕБОВАНИЯ
К ПОРЯДКУ РАСЧЕТА ПОКАЗАТЕЛЕЙ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ
ОРГАНИЗОВАННЫЕ ТОРГИ**

1. Расчет показателей, указанных в главе 3 настоящего Положения (за исключением значения основного индекса), осуществляется по каждой ценной бумаге (валюте, товару (группе товаров), допущенной к организованным торгам, по договорам репо (по каждой ценной бумаге) и по каждой спецификации договоров, являющихся производными финансовыми инструментами.

Указанные показатели рассчитываются с учетом сроков исполнения обязательств по договорам (раздельно по договорам, заключенным в основную и дополнительную торговые сессии), а также цен исполнения (для опционных договоров).

2. Средневзвешенная цена одной ценной бумаги за установленный период времени определяется путем деления суммы произведений цен каждой из сделок на количество ценных бумаг в соответствующей сделке, заключенной в данный период времени с указанной ценной бумагой (за исключением договоров репо), на сумму количества ценных бумаг в указанных сделках за тот же период времени.

Средневзвешенная цена товара рассчитывается путем деления общей суммы всех договоров, заключенных в течение основной торговой сессии на основании хотя бы одной безадресной заявки на стандартных условиях, установленных организатором торгов, с таким товаром в одном месте поставки и на одних условиях поставки (далее - рыночные сделки), на общее количество этого товара по указанным договорам.

3. Рыночная цена ценной бумаги (товара), а также признаваемая котировка ценных бумаг рассчитываются за торговый день по рыночным сделкам, заключенным в течение основной торговой сессии. Организатор торговли рассчитывает рыночную цену товара отдельно по договорам, предусматривающим разные места и условия поставки.

4. Организатор торговли, оказывающий услуги по проведению организованных торгов ценными бумагами, рассчитывает показатели, установленные в главе 3 настоящего Положения, с учетом следующих положений.

4.1. Текущая цена ценной бумаги рассчитывается в соответствии с методикой организатора торговли по расчету текущих цен ценных бумаг с учетом следующих требований:

расчет текущей цены ценной бумаги осуществляется организатором торговли по ценным бумагам, включенным в список ценных бумаг, по которым рассчитывается основной индекс (далее - индексный список);

текущая цена ценной бумаги рассчитывается не реже одного раза в минуту в течение торгового дня как средневзвешенная цена данной ценной бумаги за предшествующие моменту расчета десять минут торгов по всем договорам, заключенным на основании безадресных заявок.

В случае если расчет основного индекса не осуществляется, текущие цены ценных бумаг рассчитываются:

биржей - по всем ценным бумагам, включенным в котировальный список первого (высшего) уровня, а в случае, если указанный котировальный список не сформирован, то по всем ценным бумагам, допущенным биржей к организованным торгам;

торговой системой - по всем ценным бумагам, допущенным ею к организованным торгам.

Для расчета текущей цены ценной бумаги могут использоваться цены, указанные в безадресных заявках на покупку или продажу соответствующей ценной бумаги, если лучшая цена, указанная в заявке на покупку (продажу) соответствующих ценных бумаг, выше (ниже) средневзвешенной цены данной ценной бумаги за предшествующие моменту расчета 10 минут торгов по всем договорам, заключенным на основании безадресных заявок, или последнего рассчитанного значения текущей цены ценной бумаги, в случае отсутствия в течение последних 10 минут торгов договоров, заключенных на основании безадресных заявок.

В случае отсутствия в течение последней минуты организованных торгов сделок по заключению договоров на основании хотя бы одной безадресной заявки, а также заявок, удовлетворяющих условиям, предусмотренным абзацем седьмым настоящего подпункта, при условии, что методика



расчета текущих цен ценных бумаг организатора торговли предусматривает их использование, текущая цена ценной бумаги принимается равной последней рассчитанной текущей цене данной ценной бумаги.

4.2. Цена закрытия ценных бумаг рассчитывается в соответствии с методикой определения цен закрытия ценных бумаг, утвержденной организатором торговли, с учетом следующих требований:

цена закрытия ценной бумаги определяется по состоянию на момент окончания основной торговой сессии один раз в течение торгового дня;

при определении цены закрытия ценной бумаги могут учитываться только договоры, заключенные на основании безадресных заявок.

4.3. При расчете средневзвешенной цены и рыночной цены ценной бумаги (товара), а также текущей цены, цены закрытия и признаваемой котировки ценной бумаги не учитываются:

цены по договорам, заключенным в режимах торгов, в которых участникам торгов предоставляется доступ к информации только о собственных заявках, поданных в данном режиме торгов;

цены, содержащиеся в договорах репо;

цены по договорам, заключенным в иных режимах торгов, определенных организатором торговли.

4.4. Расчетная цена каждой ценной бумаги по внебиржевым договорам купли-продажи ценных бумаг, отчеты по которым были представлены организатору торговли, определяется как результат от деления общей суммы цен таких внебиржевых договоров на общее количество ценных бумаг по этим договорам.

4.5. Основной индекс должен соответствовать следующим требованиям:

в индексный список включаются ценные бумаги, включенные в котировальный список, а в случаях, предусмотренных методикой, - ценные бумаги, включенные в некотировальную часть списка;

в индексный список входят ценные бумаги не менее 10 эмитентов;

в индексный список включены только акции или только акции, депозитарные расписки на акции, обращающиеся на этом организаторе торговли;

индекс рассчитывается как отношение суммарной стоимости ценных бумаг, включенных в индексный список, определенной на текущее время, к суммарной стоимости ценных бумаг, включенных в индексный список, на дату первого произведенного расчета индекса или иную дату, определенную в методике расчета индекса, умноженное на значение индекса на дату первого произведенного расчета индекса или иную дату, определенную в методике расчета индекса. В расчете индекса могут участвовать коэффициенты, предусмотренные методикой расчета индекса, информация о значениях которых раскрывается ежедневно;

стоимость ценных бумаг, по которым рассчитывается индекс, определяется как произведение цены каждой ценной бумаги, включенной в индексный список, и количества этих ценных бумаг;

определение цены каждой ценной бумаги осуществляется исходя из цен договоров, заключенных с указанными ценными бумагами на организованных торгах в соответствии с правилами организованных торгов этого организатора торговли;

количество ценных бумаг, по которым рассчитывается индекс, определяется исходя из количества данных ценных бумаг, находящихся в обращении;

индекс рассчитывается не реже одного раза в минуту в течение торгового дня.

5. Коэффициенты корреляции рассчитываются между изменениями цены каждой ценной бумаги (значения каждого индекса), являющейся базисным активом производных финансовых инструментов, договоры с которыми заключаются на организованных торгах этого организатора торговли, и изменениями цены каждой ценной бумаги (значения индекса, являющегося базисным активом производных финансовых инструментов, договоры с которыми заключаются на организованных торгах этого организатора торговли).

5.1. Коэффициент корреляции рассчитывается по формуле:

$$K_{corr} = \frac{\sum_{i=1}^{30} \left[\left(\delta_{eq;i} - \frac{\sum_{i=1}^{30} \delta_{eq;i}}{30} \right) \left(\delta_{der;i} - \frac{\sum_{i=1}^{30} \delta_{der;i}}{30} \right) \right]}{\sqrt{\sum_{i=1}^{30} \left[\left(\delta_{eq;i} - \frac{\sum_{i=1}^{30} \delta_{eq;i}}{30} \right)^2 \right] \sum_{i=1}^{30} \left[\left(\delta_{der;i} - \frac{\sum_{i=1}^{30} \delta_{der;i}}{30} \right)^2 \right]}}$$

где:

$\delta_{eq;i}$ - i -ая величина изменения цены ценной бумаги, допущенной к организованным торгам (значения индекса, который является базисным активом договоров, являющихся производными финансовыми инструментами и заключаемых на организованных торгах данного организатора торговли), из сгруппированных в хронологической последовательности величин изменения цены этой ценной бумаги (значения этого индекса);

$\delta_{der;i}$ - i -ая величина изменения цены ценной бумаги (значения индекса), являющейся базисным активом договора, являющегося производным финансовым инструментом, из сгруппированных в хронологической последовательности величин изменения цены этой ценной бумаги (значения этого индекса).

5.2. Изменение цены ценной бумаги определяется как отношение цены закрытия этой ценной бумаги к ее предыдущей цене закрытия.

5.3. Величина изменения значения индекса определяется как отношение последнего значения индекса, рассчитанного в течение основной торговой сессии текущего торгового дня, к последнему значению индекса, рассчитанному в течение основной торговой сессии предыдущего торгового дня.

5.4. Для расчета коэффициента корреляции используются тридцать величин изменений цен ценной бумаги (значений индекса), являющейся базисным активом договоров, являющихся производными финансовыми инструментами и заключаемых на организованных торгах, и тридцать величин изменений цен ценной бумаги, допущенной к организованным торгам, (значений индекса), рассчитанных за текущий и предыдущие торговые дни и сгруппированных в хронологической последовательности до текущего торгового дня.

5.5. Величина изменения цены ценной бумаги (значения индекса), являющейся базисным активом договоров, являющихся производными финансовыми инструментами и заключаемых на данном организаторе торговли, и величина изменения цены ценной бумаги, допущенной к организованным торгам, (значения индекса) включаются в расчет коэффициента корреляции при условии, что указанные величины рассчитаны по одним и тем же торговым дням.

5.6. Коэффициент корреляции рассчитывается не более чем за сорок пять торговых дней.

6. Коэффициент "бета" рассчитывается по следующей формуле:

$$K_{hedge} = \frac{\sum_{i=1}^{30} \left[\left(\delta_{eq;i} - \frac{\sum_{i=1}^{30} \delta_{eq;i}}{30} \right) \left(\delta_{der;i} - \frac{\sum_{i=1}^{30} \delta_{der;i}}{30} \right) \right]}{\sum_{i=1}^{30} \left[\left(\delta_{der;i} - \frac{\sum_{i=1}^{30} \delta_{der;i}}{30} \right)^2 \right]}$$

где $\delta_{eq;i}$ и $\delta_{der;i}$ - величины, определяемые в соответствии с пунктом 5.1 настоящего

приложения.

7. Коэффициенты корреляции и коэффициенты "бета" рассчитываются каждый торговый день по окончании основной торговой сессии.

Если в течение торгового дня осуществляемые на основании безадресных заявок организованные торги базисными активами производного финансового инструмента, по которым рассчитывается величина изменения цен, не проводились, коэффициенты корреляции и коэффициенты "бета" не рассчитываются.

8. Организатор торговли, оказывающий услуги по проведению организованных торгов, на которых заключаются опционные договоры (контракты), ежедневно определяет теоретические цены опционных договоров (контрактов), заключаемых на организованных торгах этого организатора торговли (далее - теоретическая цена опциона), и коэффициенты "дельта" по указанным опционным договорам (контрактам) на момент окончания основной торговой сессии.

8.1. Теоретическая цена опциона и коэффициент "дельта" определяются отдельно для опционных договоров (контрактов), условия которых определены в одной спецификации, цена исполнения которых одинакова и обязательства по которым подлежат исполнению в один и тот же срок, а в случае, когда указанные обязательства предусматривают заключение договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, обязательства по таким договорам также подлежат исполнению в один и тот же срок.

8.2. Теоретическая цена опциона рассчитывается исходя из:

количества дней до последнего торгового дня, на которых могут быть заключены опционные договоры (контракты), в отношении которых рассчитывается теоретическая цена опциона;

рассчитанного отклонения относительных изменений цены базисного актива опционного договора (контракта) или, если базисным активом опционного договора (контракта) является фьючерсный договор (контракт), изменений цены одного лота такого фьючерсного договора (контракта) от среднего значения относительных изменений цен на указанный базисный актив (цен одного лота фьючерсного договора (контракта) (далее - значение волатильности базисного актива);

последней цены базисного актива или, если базисным активом опционного договора (контракта) является фьючерсный договор (контракт), цены одного лота такого фьючерсного договора (контракта) (далее - расчетная цена базисного актива);

процентных ставок доходности (далее - процентная ставка);

цены исполнения опционного договора (контракта).

8.3. При определении теоретической цены опциона должны соблюдаться следующие требования:

для опционных договоров (контрактов), базисным активом которых являются фьючерсные договоры (контракты), используется процентная ставка, равная нулю;

для опционных договоров (контрактов), базисным активом которых являются ценные бумаги, используется процентная ставка, не превышающая ключевую процентную ставку Банка России;

расчетная цена базисного актива опционного договора (контракта) определяется исходя из цен базисного актива или, если базисным активом опционного договора (контракта) является фьючерсный договор (контракт), цен одного лота такого фьючерсного договора (контракта) по договорам или фьючерсным договорам (контрактам), заключенным на организованных торгах организатора торговли, определяющего расчетную цену, и (или) другого организатора торговли, и (или) показателей, рассчитанных на основе указанных цен. При этом также могут использоваться цены базисного актива (цены одного лота фьючерсного договора (контракта), указанные в безадресных заявках на покупку или продажу базисного актива (на заключение фьючерсных договоров (контрактов), которые на момент расчета теоретической цены опциона не были исполнены в полном объеме и не были отозваны подавшими их участниками торгов;

для опционных договоров (контрактов), заключаемых на условиях спецификации, в соответствии с которой ранее не было заключено ни одного опционного договора (контракта), значение волатильности базисного актива рассчитывается как среднее квадратическое отклонение изменений цен базисного актива или, если базисным активом опционного договора (контракта) является фьючерсный договор (контракт), цен одного лота фьючерсного договора (контракта) по договорам или фьючерсным договорам (контрактам), заключенным на организованных торгах организатора торговли, рассчитывающего значение волатильности базисного актива, и (или) другого организатора торговли, за период, определенный в соответствии с методикой, предусмотренной в пункте 8.5 настоящего приложения;

для опционных договоров (контрактов), заключаемых на условиях спецификации, в соответствии с которой ранее был заключен хотя бы один опционный договор (контракт), значение



волатильности базисного актива рассчитывается исходя из:

показателей, предусмотренных абзацами вторым, пятым и шестым пункта 8.2 настоящего приложения;

цен базисного актива или, если базисным активом опционного договора (контракта) является фьючерсный договор (контракт), цен одного лота такого фьючерсного договора (контракта) по договорам (фьючерсным договорам (контрактам), заключенным на организованных торгах организатора торговли, рассчитывающего значение волатильности базисного актива, и (или) другого организатора торговли, и (или) показателей, рассчитанных на основе указанных цен;

цен одного лота опционного договора (контракта) по опционным договорам (контрактам), заключенным на организованных торгах организатора торговли, рассчитывающего значение волатильности базисного актива.

При этом также могут использоваться:

цены базисного актива или, если базисным активом опционного договора (контракта) является фьючерсный договор (контракт), цены одного лота такого фьючерсного договора (контракта), цены одного лота опционного договора (контракта), указанные в безадресных заявках, которые на момент расчета теоретической цены опциона не были исполнены в полном объеме и не были отозваны подавшими их участниками торгов;

цены базисного актива или, если базисным активом опционного договора (контракта) является фьючерсный договор (контракт), цены одного лота такого фьючерсного договора (контракта), указанные в безадресных заявках на покупку или продажу базисного актива (на заключение фьючерсных договоров (контрактов), - для расчета значения волатильности базисного актива и определения значения расчетной цены базисного актива, только если указанные цены лучше цены последней заключенной с базисным активом договора или, если базисным активом опционного договора (контракта) является фьючерсный договор (контракт), цены одного лота последнего заключенного фьючерсного договора (контракта);

цены одного лота опционного договора (контракта), указанные в безадресных заявках, - для расчета значения волатильности базисного актива, только если цены, указанные в заявках на заключение опционных договоров (контрактов) в качестве лица, уполномоченного по опционному договору (контракту), выше последней рассчитанной теоретической цены этого опционного договора (контракта), а в заявках на заключение опционных договоров (контрактов) в качестве лица, обязанного по опционному договору (контракту), ниже последней рассчитанной теоретической цены этого опционного договора (контракта).

8.4. Коэффициент "дельта" рассчитывается для опционного договора (контракта) по следующей формуле:

$$D = \int_{-\infty}^{d_1} \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \times e^{\frac{-x^2}{2}} dx,$$

где:

D - коэффициент "дельта";

x - переменная величина;

d_1 - коэффициент, рассчитываемый по следующей формуле:

$$d_1 = \frac{\ln\left(\frac{p}{p_{ex}}\right) + \left(r + \frac{\sigma^2}{2}\right) \times \frac{t}{365}}{\sigma \times \sqrt{\frac{1}{365}}},$$

где:

p - расчетная цена базисного актива;

p_{ex} - цена исполнения опционного договора (контракта), выраженная в тех же единицах измерения, что и расчетная цена базисного актива;

r - процентная ставка (в долях единицы);

t - количество календарных дней с даты расчета коэффициента "дельта" до последнего дня



периода исполнения (даты исполнения) опционного договора (контракта), в отношении которого рассчитывается коэффициент "дельта", включительно;

σ - значение волатильности базисного актива.

8.5. Теоретическая цена опциона и коэффициент "дельта" определяются на один и тот же момент времени в соответствии с утвержденной организатором торговли методикой расчета теоретической цены опциона и коэффициента "дельта".

ТРЕБОВАНИЯ К МЕТОДИКАМ РАСЧЕТА РАСКРЫВАЕМЫХ ОРГАНИЗАТОРОМ ТОРГОВЛИ ЦЕН, ИНДЕКСОВ И ИНЫХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ

1. Методика расчета индекса организатора торговли должна содержать:
 - порядок расчета индекса;
 - значение индекса на дату первого произведенного расчета индекса;
 - критерии, которым должны соответствовать торгуемые инструменты, или информация, на основании которой рассчитывается индекс (например, вид товара, отраслевая принадлежность эмитента ценных бумаг, ликвидность и так далее);
 - перечень обстоятельств, которые учитываются при осуществляемом на основании субъективной (экспертной) оценки изменении показателей, используемых в расчете индекса;
 - периодичность внесения изменений в показатели, используемые в расчете индекса, на основании субъективной (экспертной) оценки, а также даты внесения указанных изменений;
 - источники информации, на основании которой рассчитывается индекс;
 - сроки расчета индекса и его раскрытия.
2. Методика расчета основного индекса дополнительно к требованиям пункта 1 настоящего приложения должна содержать:
 - критерии, которым должны соответствовать ценные бумаги для включения их в индексный список;
 - порядок определения цены каждой ценной бумаги, включенной в индексный список;
 - порядок определения количества ценных бумаг, учитываемых при расчете индекса, по каждой ценной бумаге из индексного списка;
 - порядок расчета доли стоимости ценных бумаг, определенной по каждой ценной бумаге из индексного списка, в суммарной стоимости ценных бумаг, по которым рассчитывается индекс.
3. Изменения в индексный список, в методику расчета индекса, а также в показатели, используемые в расчете индекса на основании субъективной (экспертной) оценки, вносятся не чаще одного раза в квартал.

Требования по внесению изменений в индексный список не применяются в случае исключения ценных бумаг из списка ценных бумаг, допущенных к торгам, а также из котировальных списков, в случае реорганизации или ликвидации эмитента ценных бумаг, размещения дополнительного выпуска ценных бумаг, аннулирования (погашения) ценных бумаг, в том числе в результате их конвертации, выкупа (приобретения) ценных бумаг их эмитентом, приостановки организованных торгов ценными бумагами, а также в иных случаях, которые могут оказать существенное влияние на расчет индекса. В этих случаях сообщение об изменениях в индексный список, в методику расчета индекса, а также в показатели, используемые в расчете индекса на основании субъективной (экспертной) оценки, раскрывается не позднее даты их вступления в силу.
4. Методика расчета теоретической цены опциона и коэффициента "дельта" должна содержать:
 - указание на источник информации о ценах базисного актива или, если базисным активом опционного договора (контракта) является фьючерсный договор (контракт), ценах одного лота фьючерсного договора (контракта), которые используются при расчете значений волатильности базисного актива и определении расчетной цены базисного актива;
 - порядок определения периода времени, в течение которого заключены договоры с базисным активом или, если базисным активом опционного договора (контракта) является фьючерсный договор (контракт), такие фьючерсные договоры (контракты) либо поданы заявки на их заключение, цены которых (рассчитанные на их основе показатели) используются при расчете значений волатильности базисного актива и определении расчетной цены базисного актива;
 - условия использования цен базисного актива или, если базисным активом опционного договора (контракта) является фьючерсный договор (контракт), цен одного лота фьючерсного договора (контракта), указанных в безадресных заявках на покупку или продажу базисного актива (на заключение фьючерсных договоров (контрактов), поданных участниками торгов (в случае использования цен, указанных в безадресных заявках), при расчете значений волатильности

базисного актива и теоретической цены опциона;
порядок определения расчетной цены базисного актива;
значение и (или) порядок определения значений процентных ставок, используемых для расчета теоретической цены опциона и коэффициента "дельта";
порядок расчета значений волатильности базисного актива;
условия использования при расчете значений волатильности базисного актива цен одного лота опционного договора (контракта), указанных в безадресных заявках на заключение соответствующих опционных договоров (контрактов), поданных участниками торгов (в случае использования цен одного лота опционного договора (контракта), указанных в безадресных заявках);
порядок и сроки определения теоретической цены опциона и коэффициента "дельта";
порядок пересчета цены исполнения опционного договора (контракта) в единицы измерения расчетной цены базисного актива;
порядок внесения изменений в методику расчета теоретической цены опциона и коэффициента "дельта" и вступления их в силу.

ПОРЯДОК, СОСТАВ И СРОКИ
РАСКРЫТИЯ И ПРЕДОСТАВЛЕНИЯ ИНФОРМАЦИИ И ДОКУМЕНТОВ
ОРГАНИЗАТОРОМ ТОРГОВЛИ

1. Организатор торговли обязан в течение торгового дня предоставлять участникам торгов следующую информацию о ходе и об итогах организованных торгов (далее - биржевая информация).

1.1. Текущую информацию о двадцати лучших безадресных заявках (десять на продажу и десять на покупку), поданных участниками торгов, за исключением заявок, поданных в ходе размещения или выкупа ценных бумаг.

Информация о безадресных заявках, поданных в ходе проведения аукционных торгов на основании безадресных заявок на стандартных условиях, не должна содержать сведений об участнике торгов, подавшем заявку, и клиенте, по поручению которого она подана (в том числе сведений о присвоенных им кодах).

1.2. Текущую информацию о договорах, заключенных на торгах у организатора торговли в течение данного торгового дня, в том числе:

- наименование, вид, категорию (тип) и иные релевантные параметры торгуемого инструмента;
- общее количество договоров;
- общий объем договоров;
- общее количество торгуемых инструментов, являющихся предметом договоров;
- наибольшую цену торгуемого инструмента;
- наименьшую цену торгуемого инструмента.

1.3. Текущую информацию о последних договорах, заключенных на организованных торгах у организатора торговли в течение данного торгового дня, в том числе:

- наименование, вид, категорию (тип) и иные релевантные параметры торгуемого инструмента;
- общее количество торгуемых инструментов, являющихся предметом последнего заключенного договора;

- время заключения последнего заключенного договора;
- цену торгуемого инструмента по последнему заключенному договору.

1.4. Текущее значение основного индекса и индекса, являющегося базисным активом производного финансового инструмента, и значения закрытия таких индексов.

1.5. Цену закрытия торгуемого инструмента (если применимо).

1.6. Текущую цену торгуемого инструмента (если применимо).

1.7. Значение коэффициента "дельта", коэффициента "бета", коэффициента корреляции, рассчитанных в соответствии с приложением 3 к настоящему Положению.

1.8. Расчетную цену инвестиционного пая биржевого паевого инвестиционного фонда с периодичностью не реже, чем осуществляется определение и раскрытие индикатора доходности, которому обязуется следовать управляющая компания биржевого паевого инвестиционного фонда.

1.9. Иную информацию, предусмотренную внутренними документами организатора торговли.

2. Организатор торговли предоставляет управляющей компании биржевого паевого инвестиционного фонда, инвестиционные паи которого допущены к торгам указанным организатором торговли, информацию о фактах, которые могут стать основанием прекращения существования такого фонда, в том числе о факте неисполнения маркет-мейкером обязательств по договору с организатором торговли, в течение трех рабочих дней с даты выявления такого факта.

3. Организатор торговли раскрывает на сайте следующие сведения и документы:

устав организатора торговли. В случае внесения изменений в устав (принятия в новой редакции) измененный устав (устав в новой редакции) должен быть раскрыт не позднее пяти рабочих дней с даты государственной регистрации изменений;

иные документы, регулирующие деятельность органов управления организатора торговли. В случае внесения изменений в указанные документы (принятия в новой редакции), измененные документы (документы в новой редакции) должны быть раскрыты не позднее пяти рабочих дней с момента принятия уполномоченным органом организатора торговли соответствующего решения;

положение о биржевом совете (совете секции). В случае внесения изменений в положение о

биржевом совете (совете секции) (принятия в новой редакции), измененное положение о биржевом совете (совете секции) должно быть раскрыто не позднее пяти рабочих дней с даты принятия советом директоров (наблюдательным советом) соответствующего решения;

решения биржевого совета (совета секции). Указанные решения должны раскрываться не позднее двух рабочих дней с даты составления протокола. Положением о биржевом совете (совете секции) или решением биржевого совета (совета секции) может быть предусмотрено, что отдельные решения биржевого совета (совета секции) не раскрываются до даты принятия биржей решения по рассмотренному биржевым советом (советом секции) вопросу;

годовые отчеты организатора торговли с приложением аудиторских заключений в отношении содержащейся в годовых отчетах годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности, а также в отношении содержащейся в указанных годовых отчетах консолидированной финансовой отчетности. Указанная информация подлежит раскрытию в течение трех рабочих дней с даты принятия указанного отчета на годовом общем собрании акционеров (участников) организатора торговли;

регистраруемые документы, за исключением документа, определяющего порядок организации мониторинга организованных торгов. Указанные документы подлежат раскрытию в течение пяти рабочих дней с даты получения организатором торговли официального решения Банка России (или его копии) о регистрации документов, но не позднее, чем за три рабочих дня до даты вступления его в силу;

размер платы, взимаемой организатором торговли за оказание услуг по организации торговли. В случае изменения размера платы информация об этом должна быть раскрыта не позднее, чем за три рабочих дня до вступления указанных изменений в силу;

сведения о порядке, условиях и размере платы, взимаемой организатором торговли за предоставление организатором торговли заинтересованным лицам биржевой информации. Изменения размера платы должны быть раскрыты не позднее, чем за три рабочих дня до вступления указанных изменений в силу;

документ организатора торговли, регламентирующий деятельность технического комитета, предусмотренного настоящим Положением, порядок его формирования, а также список членов сформированного технического комитета. Указанная информация подлежит раскрытию в течение трех рабочих дней с даты утверждения указанного документа или списка членов технического комитета уполномоченным органом организатора торговли;

методику расчета текущих цен ценных бумаг. Указанный документ подлежит раскрытию не позднее, чем за три рабочих дня до введения ее в действие;

методики расчета основного индекса и индекса, являющегося базисным активом производного финансового инструмента, которые подлежат раскрытию не позднее, чем за три рабочих дня до введения их в действие. Указанные методики должны быть доступны на сайте любому заинтересованному лицу для ознакомления за последние два года, а если индекс рассчитывается менее двух лет - за все время, в течение которого он рассчитывается;

информацию о количестве ценных бумаг, учитываемом при расчете индексов, по каждой ценной бумаге из индексного списка за последние два года, а если индекс рассчитывается менее двух лет - за все время, в течение которого он рассчитывается;

информацию о доле стоимости ценных бумаг из индексного списка в суммарной стоимости ценных бумаг, по которым рассчитывается индекс. Указанная информация раскрывается не позднее следующего торгового дня со дня перерасчета соответствующего значения;

внутренний документ (документы) организатора торговли, устанавливающий принципы корпоративного управления. Указанный документ подлежит раскрытию в течение трех рабочих дней с даты утверждения указанного документа уполномоченным органом организатора торговли;

документ (документы), которым утверждено описание допущенного к организованным торгам товара и отдельные условия заключения на организованных торгах договоров с таким товаром (спецификация товаров). Указанный документ подлежит раскрытию не позднее, чем за три рабочих дня до введения его в действие;

информацию о нарушениях, совершенных участниками торгов, и принятых к ним мерах. Информация о выявленном нарушении должна быть раскрыта в срок не позднее двух рабочих дней с даты выявления нарушения (за исключением нарушений, которые были в указанный срок устранены). В случае применения мер воздействия к участнику торгов, совершившему нарушение, информация о таких мерах раскрывается не позднее двух рабочих дней с даты принятия уполномоченным органом организатора торговли таких мер в отношении участника торгов;

информацию о судебных спорах организатора торговли, связанных с деятельностью по организации торговли, или судебных спорах организатора торговли, а также его дочерних и



зависимых обществ, решения по которым могут существенным образом повлиять на финансовое положение или хозяйственную деятельность организатора торговли. Указанная информация подлежит раскрытию на всех этапах рассмотрения дела в срок не позднее двух рабочих дней с даты получения соответствующего определения или решения суда и не позднее двух рабочих дней с даты подачи организатором торговли иска или получения организатором торговли информации о предъявлении к нему иска;

расписание проведения организованных торгов (торговых сессий) или порядок его определения;

перечень товаров, валют, производных финансовых инструментов, доступных для совершения сделок на организованных торгах у этого организатора торговли. Указанный перечень подлежит раскрытию не позднее торгового дня, следующего за днем принятия уполномоченным органом организатора торговли решения о допуске или исключении указанных торгуемых инструментов из перечня инструментов, допущенных к торгам;

информацию о соответствии (несоответствии) рассчитываемых организатором торговли индексов требованиям, предъявляемым нормативными актами Банка России к составу и структуре активов акционерных инвестиционных фондов и активов паевых инвестиционных фондов.

4. Организатор торговли обязан раскрывать информацию о следующих существенных фактах.

4.1. Реорганизация организатора торговли, его дочерних и зависимых обществ.

4.2. Государственная регистрация выпуска организатором торговли ценных бумаг, а также отчета об итогах их выпуска.

4.3. Решения совета директоров (наблюдательного совета) организатора торговли:

о созыве годового или внеочередного общих собраний акционеров (членов) организатора торговли, включая утверждение повестки дня общего собрания акционеров (членов) организатора торговли;

об избрании единоличного и/или коллегиального исполнительных органов организатора торговли;

о досрочном прекращении полномочий единоличного и/или коллегиального исполнительных органов организатора торговли;

о приостановлении полномочий единоличного исполнительного органа организатора торговли;

о вынесении на общее собрание акционеров (членов) вопроса о реорганизации организатора торговли и о порядке и об условиях такой реорганизации;

о создании филиалов и/или открытии представительств организатора торговли.

4.4. Изменение размера доли участия лиц, являющихся членами совета директоров (наблюдательного совета) организатора торговли, членами коллегиального исполнительного органа организатора торговли, а также лица, занимающего должность (осуществляющего функции) единоличного исполнительного органа организатора торговли, в уставном капитале (размере голосов на общем собрании членов) организатора торговли, а также в уставном капитале дочерних и зависимых обществ организатора торговли, и (или) изменение размера доли принадлежащих указанным лицам обыкновенных акций (голосов на общем собрании членов) организатора торговли и его дочерних и зависимых обществ.

4.5. Изменение в составе акционеров (членов) организатора торговли, владеющих пятью процентами и более обыкновенных акций (обладающих не менее чем пятью процентами голосов на общем собрании акционеров (членов) организатора торговли).

4.6. Ликвидация дочернего и/или зависимого общества организатора торговли.

4.7. Приостановление или аннулирование у организатора торговли лицензии биржи или торговой системы, получение, приостановление или аннулирование иных лицензий на осуществление лицензируемых видов деятельности, получение, приостановление или аннулирование которых могут оказать существенное влияние на деятельность организатора торговли.

4.8. Изменение адреса официального сайта.

4.9. Приобретение организатором торговли права распоряжаться определенным количеством голосов, приходящихся на голосующие акции (доли), составляющие уставный капитал коммерческой организации, если указанное количество голосов составляет пять процентов либо стало больше или меньше 5, 10, 15, 20, 25, 30, 50, 75 или 95 процентов общего количества голосов, приходящихся на голосующие акции (доли), составляющие уставный капитал коммерческой организации.

4.10. Организатор торговли, являющийся акционерным обществом, обязанным осуществлять раскрытие информации в соответствии со статьей 30 Федерального закона "О рынке ценных бумаг", осуществляет раскрытие информации, предусмотренной настоящим пунктом, в части, не раскрытой в сообщениях о существенных фактах.



5. Биржа обязана с даты начала торгов ценными бумагами, включенными в ее котировальные списки, ежеквартально раскрывать на сайте информацию о соответствии (несоответствии) этих ценных бумаг требованиям, предусмотренным нормативными актами Банка России, для нахождения ценных бумаг в соответствующем котировальном списке.

Указанная информация подлежит раскрытию на сайте в течение 10 рабочих дней с даты истечения отчетного квартала, а в отношении соблюдения (несоблюдения) эмитентами требований к корпоративному управлению эмитента, установленных нормативными актами Банка России, - 35 рабочих дней, и должна быть доступна на сайте в течение не менее шести месяцев с даты ее опубликования.

6. Биржа, осуществляющая допуск биржевых облигаций к торгам, обязана обеспечить на сайте доступ к информации, содержащейся в проспекте биржевых облигаций.

Не позднее следующего дня после даты завершения размещения биржевых облигаций или даты окончания срока размещения биржевых облигаций биржа обязана раскрыть на сайте информацию об итогах размещения биржевых облигаций и уведомить об этом Банк России. Раскрываемая информация и уведомление об итогах размещения биржевых облигаций должны содержать:

- даты начала и окончания размещения биржевых облигаций;
- фактическую цену (цены) размещения биржевых облигаций;
- количество размещенных биржевых облигаций;
- долю размещенных и не размещенных биржевых облигаций в выпуске;
- номинальную стоимость, объем по номинальной стоимости;
- общую стоимость имущества, внесенного в оплату за размещенные биржевые облигации, в том числе:

- денежные средства в валюте Российской Федерации;
- денежные средства в иностранной валюте, выраженные в валюте Российской Федерации по курсу Банка России на момент внесения;

- стоимость иного имущества, выраженную в валюте Российской Федерации;

7. Организатор торговли обязан раскрывать на сайте следующую биржевую информацию:

- по ценным бумагам - цену закрытия, признаваемую котировку, рыночную цену, текущую цену, средневзвешенную цену, наибольшую и наименьшую цены одной ценной бумаги по заключенным договорам;

- по договорам, являющимся производными финансовыми инструментами, - текущую цену (расчетную цену);

- по валюте - курс валюты, определенный в порядке, установленном правилами организованных торгов;

- по товарам - информацию о заключенных в течение торгового дня договорах по каждому товару, с указанием наименования товара, базиса (условий) поставки, общего количества заключенных договоров по товару, общего объема заключенных договоров в рублях, общего объема торгов в абсолютном выражении (согласно соответствующей спецификации), рыночной цене, лучшей заявке на покупку и лучшей заявке на продажу, наибольшей и наименьшей ценах заключенного договора;

- текущее значение всех рассчитываемых индексов и индексов, являющихся базисными активами договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, торгуемыми на данном организаторе торговли, а также значения закрытия таких индексов.

В случае заключения договоров с участием центрального контрагента, организатор торговли осуществляет раскрытие информации о заключенных в течение торгового дня таких договорах, а также расчет цен и объемов только по договорам (на основании договоров), в которых центральный контрагент выступает в качестве покупателя.

Информация, предусмотренная в настоящем пункте (за исключением информации о текущем значении индекса, а также о средневзвешенной цене каждого торгуемого инструмента по итогам основной торговой сессии и информации, касающейся дополнительной торговой сессии), должна быть раскрыта организатором торговли на сайте не позднее одного часа после окончания основной торговой сессии.

Информация о средневзвешенной цене каждого торгуемого инструмента по итогам основной торговой сессии и информация, касающаяся дополнительной торговой сессии, должна быть раскрыта организатором торговли на сайте не позднее начала основной торговой сессии следующего торгового дня. Организатор торговли обеспечивает свободный доступ к указанной информации на сайте для ознакомления в течение шести месяцев с даты ее раскрытия.



8. Организатор торговли, оказывающий услуги, способствующие заключению договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, не позднее чем через три часа по окончании основной торговой сессии обязан раскрывать на сайте коэффициенты корреляции и коэффициенты "бета", рассчитанные в соответствии с настоящим Положением, с указанием базисных активов таких производных финансовых инструментов, изменение цен (значений) которых принималось в расчет указанных коэффициентов.

Организатор торговли обеспечивает свободный доступ к указанной информации на сайте для ознакомления в течение двух лет со дня ее раскрытия.

9. Организатор торговли вправе раскрывать на сайте коэффициенты корреляции и коэффициенты "бета", рассчитанные с использованием публично раскрываемой информации о результатах торгов иными организаторами торговли, в порядке, установленном настоящим Положением. При этом раскрываемая информация должна содержать также указание на источник информации о ценах ценных бумаг (значений индексов), использованных для расчета коэффициентов корреляции и коэффициентов "бета".

10. Организатор торговли вправе раскрывать информацию о стоимостном объеме договоров, заключенных каждым участником торгов в интересах клиентов или в своих интересах, а также о количестве клиентов участников торгов, кроме случаев, когда участником торгов является Банк России.

11. Организатор торговли, оказывающий услуги, способствующие заключению опционных договоров (контрактов), обязан раскрывать на сайте следующую информацию.

11.1. Методику расчета теоретической цены опциона и коэффициента "дельта", разработанную в соответствии с требованиями настоящего Положения;

11.2. Информацию об опционных договорах (контрактах), заключенных на организаторе торговли, с обязательным указанием следующих данных:

код (обозначение) опционных договоров (контрактов);

право по опционному договору (контракту) колл/пут;

последний торговый день, в который может быть заключен опционный договор (контракт) (день, месяц, год);

цена исполнения опционного договора (контракта) (в рублях);

количество подлежащих исполнению опционных договоров (контрактов);

сумма подлежащих исполнению опционных договоров (контрактов) (в рублях);

коэффициент "дельта";

теоретическая цена опциона (в рублях) - по окончании клирингового сеанса после основной торговой сессии.

Организатор торговли обеспечивает свободный доступ к указанной информации на сайте для ознакомления в течение двух лет со дня ее раскрытия.

12. Организатор торговли, оказывающий услуги, способствующие заключению договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, еженедельно обязан раскрывать на сайте следующую информацию:

в отношении физических и юридических лиц по длинным позициям (позициям покупателя) и коротким позициям (позициям продавца) - количество договоров (контрактов), изменение количества договоров (контрактов) по отношению к предыдущей неделе, относительное изменение количества договоров (контрактов) по отношению к предыдущей неделе (в процентном соотношении);

количество лиц, имеющих открытые позиции, а также совокупный объем открытых позиций по каждому из указанных параметров.

Соответствующая информация раскрывается отдельно по каждому базисному активу, по срокам экспирации и с разбивкой по каждому производному финансовому инструменту.

Организатор торговли обязан раскрывать указанную информацию не позднее первого торгового дня, следующего за отчетной неделей, и обеспечивать свободный доступ к ней для ознакомления на сайте в течение двух лет со дня ее раскрытия.

13. Организатор торговли обязан ежемесячно раскрывать на сайте следующую информацию:

об общем количестве договоров с ценными бумагами и общем стоимостном объеме договоров с ценными бумагами (суммарно, а также отдельно по видам ценных бумаг и по каждой отдельной ценной бумаге), заключенных в порядке вторичного обращения (суммарно, а также отдельно по режимам торговли);

об общем количестве договоров с ценными бумагами и общем стоимостном объеме договоров с ценными бумагами, заключенных в порядке первичного размещения (суммарно, а также отдельно



по видам ценных бумаг и по каждой отдельной ценной бумаге);

об общем количестве заключенных договоров и общем стоимостном объеме заключенных договоров (суммарно по производным финансовым инструментам, валюте, товарам, а также отдельно по видам производных финансовых инструментов, валюты, товаров);

о стоимостном объеме договоров, заключенных каждым участником торгов (суммарно и отдельно по видам торгуемых инструментов). Организатор торговли вправе раскрывать указанную информацию отдельно по режимам торговли;

о стоимостном объеме договоров с торгуемыми инструментами (суммарно по производным финансовым инструментам, валюте, товарам, а также отдельно по видам торгуемых инструментов), заключенных в интересах клиентов участников торговли, являющихся резидентами (отдельно по физическим и юридическим лицам);

о стоимостном объеме договоров с торгуемыми инструментами (суммарно по производным финансовым инструментам, валюте, товарам, а также отдельно по видам торгуемых инструментов), заключенных в интересах клиентов участников торговли, являющихся нерезидентами (отдельно по физическим и юридическим лицам).

В случае заключения договоров с участием центрального контрагента, организатор торговли осуществляет раскрытие информации по договорам, в которых центральный контрагент выступает в качестве покупателя.

Информация, предусмотренная настоящим пунктом, должна быть раскрыта организатором торговли не позднее трех рабочих дней после окончания календарного месяца. Организатор торговли обеспечивает свободный доступ к указанной информации на сайте для ознакомления в течение шести месяцев с даты ее раскрытия.

14. Организатор торговли обязан раскрывать на сайте актуальные сведения об участниках торгов по каждой торговой (биржевой) секции с указанием полного наименования и ИНН участника торгов, даты допуска участника торгов к торгам через организатора торговли, даты и основания приостановления (прекращения) и возобновления допуска к участию в торгах.

Сведения об участнике, допуск которого прекращен в соответствующей торговой секции, исключаются из сведений, опубликованных на сайте, не ранее, чем через три месяца с даты прекращения допуска такого участника к торгам в этой секции.

15. Информация о случаях неисполнения участниками торгов обязательств по сделкам, совершенным на торгах у организатора торговли, должна быть раскрыта организатором торговли на сайте в следующем объеме.

наименование участника торгов (клирингового брокера), не исполнившего обязательства;

наименование, вид, категория (тип) торгуемого инструмента, в отношении которого участником торгов (клиринговым брокером) не исполнены обязательства;

размер неисполненных обязательств;

дата истечения срока надлежащего исполнения обязательств;

дата предполагаемого исполнения обязательств;

меры, предпринятые организатором торговли в связи с неисполнением обязательств.

Указанная информация должна быть раскрыта на сайте в срок не позднее двух рабочих дней с даты выявления события неисполнения или с даты получения организатором торговли уведомления об этом от клиринговой организации.

Требования данного пункта не применяются, если участник торгов на момент раскрытия информации исполнил соответствующие обязательства.

16. Организатор торговли обязан раскрывать на сайте:

решение организатора торговли о введении или о перенесении сроков введения в эксплуатацию средств проведения торгов - не позднее торгового дня, следующего за днем его принятия;

дату введения в эксплуатацию средств проведения торгов - не позднее, чем за два торговых дня, предшествующих дате введения в эксплуатацию указанных средств проведения торгов.

17. При возникновении технических сбоев в работе средств проведения торгов, которые влияют или могут повлиять на ход их проведения в отношении большинства участников торгов, в период проведения торгов организатор торговли обязан раскрыть информацию об этом на сайте не позднее чем через пятнадцать минут после их обнаружения организатором торговли.

При приведении в рабочее состояние средств проведения торгов и обнаружении технических сбоев в работе средств проведения торгов организатор торговли обязан раскрыть информацию об этом на сайте или иным доступным способом не менее чем за пятнадцать минут до начала проведения торгов.

18. В случаях приостановки организованных торгов по причинам, предусмотренным



подпунктами 1.15.1 и 1.15.2 пункта 1.15 настоящего Положения, организатор торговли обязан не позднее следующего торгового дня после приостановления организованных торгов представить в Банк России сообщение о факте приостановления организованных торгов, содержащее информацию об основаниях приостановления организованных торгов.

19. В случае если приостановка организованных торгов связана с техническим сбоем, организатор торговли представляет в Банк России в течение одного часа с момента приостановления торгов соответствующее уведомление с указанием имеющейся на момент направления уведомления информации о характере и причинах технического сбоя.

В течение двух часов с момента возобновления торгов организатор торговли обязан представить в Банк России справку, содержащую информацию в хронологическом порядке (с указанием времени) о действиях организатора торговли с момента выявления технического сбоя и до момента возобновления торгов.

20. В случаях выявления технических сбоев, которые привели к нарушению порядка проведения торгов, доступа участника или группы участников к торгам, а также раскрытия и предоставления информации организатором торговли, но следствием которых не стала приостановка торгов, организатор торговли не позднее следующего торгового дня с момента выявления данного события представляет в Банк России уведомление, с указанием имеющейся на момент направления уведомления информации о характере и причинах технического сбоя.

21. В течение десяти рабочих дней со дня наступления технического сбоя, как приведшего, так и не приведшего к приостановке торгов, организатор торговли обязан представить в Банк России подробный отчет о техническом сбое, содержащий сведения о причинах и последствиях технического сбоя, в том числе для участников торгов, мерах, принятых организатором торговли в связи с техническим сбоем, способах устранения технического сбоя, мерах, принятых организатором торговли для предотвращения повторного возникновения подобных технических сбоев, или копию внутреннего отчета организатора торговли о проведенном расследовании причин технического сбоя, содержащего вышеуказанные сведения (при наличии такого отчета).

22. Копия отчета организации, проводящей операционный аудит средств проведения торгов, представляется организатором торговли в Банк России не позднее трех рабочих дней с даты его получения организатором торговли.

23. Организатор торговли обязан ежедневно представлять в Банк России сведения обо всех выявленных в ходе предыдущего торгового дня нестандартных сделках (заявках) не позднее рабочего дня, следующего за днем выявления нестандартной сделки (заявки).

24. Организатор торговли обязан представлять в Банк России копии протоколов заседаний технического комитета. Копии протоколов представляются в Банк России не позднее двух рабочих дней с даты их составления.

25. Методика, указанная в пункте 1.16 настоящего Положения, предоставляется в Банк России не позднее, чем за пять рабочих дней до даты введения ее в действие.

26. Организатор торговли обязан сообщить обо всех заключенных и действующих договорах аутсорсинга в течение одного месяца с даты вступления в силу настоящего Положения.

В случае изменения условий заключенных договоров аутсорсинга или заключения нового договора аутсорсинга, организатор торговли обязан представить в Банк России информацию об этом в течение десяти рабочих дней с даты начала действия указанных изменений или договора.

27. В случае если организатору торговли стало известно о нарушениях участниками торгов требований к нормативу достаточности собственных средств, организатор торговли в течение двух рабочих дней с даты выявления нарушения предоставляет сообщение об этом в Банк России.

28. В случае если организатор торговли выявил значительное нарушение участником торгов правил торгов и/или применил меры дисциплинарного воздействия к участнику торгов (приостановление допуска к участию в торгах (в том числе в отдельных режимах торгов) или прекращение допуска к участию в торгах (в том числе в отдельных режимах торгов), организатор торговли обязан сообщить об этом в Банк России не позднее двух рабочих дней с даты выявления нарушения или применения мер дисциплинарного воздействия с указанием наименования участника торгов и причины применения таких мер. Критерии значительности нарушений устанавливаются организатором торговли в правилах организованных торгов.

29. Организатор торговли уведомляет Банк России о проведении заседаний совещательных органов, созданных организатором торговли в целях взаимодействия с участниками торгов (биржевой совет, советы секций, технический комитет и иные), и направляет соответствующие материалы в сроки, установленные соответствующими документами организатора торговли, регламентирующими деятельность указанных совещательных органов организатора торговли.

30. Организатор торговли утверждает внутренний документ, устанавливающий принципы корпоративного управления, а также представляет его в Банк России в течение трех рабочих дней с даты утверждения.

31. Организатор торговли представляет ежеквартально не позднее пяти рабочих дней с даты окончания квартала в Банк России информацию о совокупных объемах заключенных на организованных торгах договоров с разбивкой по следующим торгуемым инструментам: акции, облигации, инвестиционные паи, ипотечные сертификаты участия, фьючерсные договоры (контракты), базисным активом которых являются ценные бумаги и фондовые индексы, опционные договоры (контракты), базисным активом которых являются фьючерсные договоры (контракты), базовым активом которых являются ценные бумаги или фондовые индексы, товары, валюта.

32. Организатор торговли в режиме реального времени предоставляет на удаленный терминал, устанавливаемый в Банке России, информацию о ходе торгов, в том числе о заявках, поданных участниками торгов на заключение сделок, и сделках, совершенных на торгах организатора торговли с возможно точным указанием времени подачи заявок и совершения сделок.

33. На удаленный терминал, устанавливаемый в Банке России, не позднее 12 часов местного времени следующего торгового дня в электронно-цифровой форме должна быть представлена следующая информация.

33.1. О поданных заявках в объеме, предусмотренном подпунктом 2.4.3 пункта 2.4 настоящего Положения, с обязательным указанием кода страны клиента участника торгов. Информация о времени подачи заявок должна указываться возможно точно.

33.2. О заключенных договорах в объеме, предусмотренном подпунктом 2.5.1 пункта 2.5 настоящего Положения, с обязательным указанием кода страны клиента участника торгов. Информация о времени заключения договоров должна указываться возможно точно.

33.3. Об итогах торгов за торговый день (раздельно по рыночным сделкам и сделкам, совершенным на основании двух адресных заявок, и по совершенным в основную и дополнительную торговые сессии) (за исключением договоров репо) по каждому торгуемому инструменту), с обязательным указанием следующих сведений.

33.3.1. По ценным бумагам:

наименование эмитента (управляющей компании и название паевого инвестиционного фонда), индивидуальное обозначение, идентифицирующее ипотечные сертификаты участия;

вид, категория (тип), серия ценных бумаг;

общее количество договоров;

общий объем договоров;

общее количество ценных бумаг, являющихся предметом договоров;

наибольшая цена одной ценной бумаги;

наименьшая цена одной ценной бумаги;

ИНН эмитента/управляющей компании (если имеется);

международный идентификационный код (ISIN), присвоенный ценным бумагам (если имеется);

государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска) данных ценных бумаг (если имеется);

идентификационный номер выпуска (дополнительного выпуска) биржевых облигаций (если имеется);

государственный регистрационный номер правил доверительного управления (если имеется).

33.3.2. По договорам репо:

наименование эмитента (управляющей компании и название паевого инвестиционного фонда);

вид, категория (тип), серия ценных бумаг;

общее количество заключенных договоров;

общий объем заключенных договоров;

общее количество ценных бумаг, являющихся предметом заключенных договоров;

международный идентификационный код (ISIN), присвоенный ценным бумагам (если имеется);

государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска) данных ценных бумаг (если имеется);

идентификационный номер выпуска (дополнительного выпуска) биржевых облигаций (если имеется).

33.3.3. По валютным инструментам (драгоценным металлам):

наименование инструмента;



общее количество сделок;
общий объем сделок (в валюте инструмента, в рублях и (или) в сопряженной валюте);
лучшая заявка на покупку и лучшая заявка на продажу;
наибольшая и наименьшая цена сделки по валютному инструменту.

33.3.4. По товарам:

наименование товара;
базис (условия) поставки;
общее количество заключенных договоров с товаром;
общий объем заключенных договоров в рублях;
общий объем торгов в абсолютном выражении (установленном организатором торговли);
лучшая заявка на покупку и лучшая заявка на продажу;
наибольшая и наименьшая цены заключенного договора по товару.

33.4. Об итогах торгов производными финансовыми инструментами по каждой спецификации договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, в разрезе сроков исполнения обязательств по ним, а также цен исполнения (для опционных договоров). Указанная информация должна включать следующие сведения:

о совершенных договорах по каждой спецификации договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, с учетом сроков исполнения обязательств по ним, а также цен исполнения (для опционных договоров);

название, обозначение вида, указание на срок исполнения обязательств по производному финансовому инструменту, а также указание на цену исполнения опционного договора;

общее количество договоров, являющихся производными финансовыми инструментами;

общий объем договоров, являющихся производными финансовыми инструментами;

наибольшую цену производного финансового инструмента, наименьшую цену производного финансового инструмента;

количество единиц базисного актива договора, являющегося производным финансовым инструментом;

объем открытых позиций в количестве договоров, являющихся производными финансовыми инструментами;

размер начальной маржи по каждому договору, являющемуся производным финансовым инструментом.

33.5. О рассчитанных значениях основного индекса.

34. Организатор торговли обязан раскрывать следующую информацию о внебиржевых сделках, отчеты по которым были ему представлены:

о совершенных внебиржевых сделках по каждой ценной бумаге, в том числе наименование эмитента (наименование управляющей компании и название паевого инвестиционного фонда, наименование управляющего ипотечным покрытием и индивидуальное обозначение, идентифицирующее ипотечные сертификаты участия), вид, категорию (тип) и государственный регистрационный номер ценных бумаг, общее количество сделок, общий объем сделок, общее количество ценных бумаг, являющихся предметом сделок, наибольшую цену одной ценной бумаги, наименьшую цену одной ценной бумаги;

о расчетной цене каждой ценной бумаги по внебиржевым сделкам, на основании которых приобретено менее пяти процентов от общего количества находящихся в обращении соответствующих ценных бумаг, определяемой как результат от деления общей суммы цен по таким внебиржевым сделкам на общее количество ценных бумаг по этим сделкам;

о расчетной цене каждой ценной бумаги по внебиржевым сделкам, на основании которых приобретено пять процентов и более от общего количества находящихся в обращении соответствующих ценных бумаг, определяемой как результат от деления общей суммы цен по таким внебиржевым сделкам на общее количество ценных бумаг по этим сделкам.

В случае если цена ценной бумаги по сделке указана в иностранной валюте, для раскрытия информации организатор торговли использует соответствующую цену, пересчитанную в рубли по официальному курсу Центрального банка Российской Федерации на дату заключения сделки, а в случае отсутствия официального курса - по кросс-курсу соответствующей валюты к рублю.

Информация должна быть раскрыта организатором торговли на сайте:

не позднее 15 минут с момента получения организатором торговли соответствующей информации, если такая информация получена организатором торговли начиная с часа, предшествующего началу торгов текущего торгового дня, до 19 часов текущего торгового дня;

не позднее чем за один час до начала торгов следующего торгового дня, если такая информация



получена организатором торговли в период с 19 часов текущего торгового дня до часа, предшествующего началу торгов следующего торгового дня.

Информация, раскрываемая организатором торговли в период начиная с часа, предшествующего началу торгов текущего торгового дня, до 19 часов текущего торгового дня, должна включать информацию о договорах, полученную организатором торговли в указанный период, в том числе о договорах, отчет о которых предоставлен организатору торговли с нарушением установленных сроков, кроме информации о договорах, заключенных ранее текущего торгового дня.

Информация, раскрываемая организатором торговли начиная с 19 часов текущего торгового дня до часа, предшествующего началу торгов следующего торгового дня, должна включать информацию о договорах, полученную организатором торговли в указанный период, в том числе о договорах, отчет о которых предоставлен организатору торговли с нарушением установленных сроков, кроме информации о договорах, заключенных ранее текущего торгового дня.

В случае раскрытия информации в первый торговый день после выходных или праздничных дней, в которые организатор торговли не проводил торги, организатор торговли обязан раскрыть информацию, предусмотренную в настоящем пункте, отдельно по последнему торговому дню, а также по каждому выходному и (или) праздничному дню.

Раскрытие организатором торговли информации о внебиржевой сделке, на основании которой приобретает пять процентов и более от общего количества находящихся в обращении соответствующих ценных бумаг, осуществляется не ранее последнего дня срока, установленного сделкой для исполнения сторонами обязательств по оплате и поставке ценных бумаг, но не позднее чем за один час до начала первого торгового дня, следующего за указанным днем.

Раскрытие информации осуществляется организатором торговли отдельно по сделкам, предусматривающим исполнение сторонами обязательств по оплате и поставке ценных бумаг, в течение:

- пяти дней с даты заключения сделки;
- от 6 до 30 дней с даты заключения сделки включительно;
- более 30 дней с даты заключения сделки.

Организатор торговли обеспечивает свободный доступ к указанной информации на своем сайте в течение шести месяцев с момента ее раскрытия.