

УТВЕРЖДЕНО
Советом директоров
Публичного акционерного общества
“Санкт-Петербургская Биржа”
(протокол № 8/2015 от 05.08.2015г.)

Методика
расчета текущих цен и цен закрытия ценных бумаг

Москва
2015

1. Общие положения

1.1. Настоящая методика расчёта текущих цен и цен закрытия ценных бумаг Публичного акционерного общества «Санкт-Петербургская биржа» (далее – Методика) разработана в соответствии с нормативными правовыми актами, регулирующими порядок деятельности по проведению организованных торгов.

1.2. Методика устанавливает и регулирует порядок расчета текущих цен и цен закрытия ценных бумаг, требования к которым установлены нормативными правовыми актами, регулирующими порядок деятельности по проведению организованных торгов, и которые применяются Публичным акционерным обществом «Санкт-Петербургская биржа» (далее - Биржа) в целях приостановки торгов отдельными ценными бумагами.

1.3. Термины используются в значениях, определенных законодательством Российской Федерации и внутренними документами Биржи.

2. Расчет текущих цен

2.1. Текущая цена ценной бумаги рассчитывается в ходе проведения Торгов в течение Торгового дня не реже 1 (одного) раза в минуту.

2.2. При расчете текущей цены ценной бумаги учитываются:

2.2.1. договоры купли-продажи, предметом которых является указанная ценная бумага, заключённые на основании хотя бы одной безадресной Заявки, в течение 10 (десяти) минут Торгов, предшествующих моменту расчета значения текущей цены;

2.2.2. безадресные Заявки на покупку ценной бумаги или безадресные Заявки на продажу данной ценной бумаги, находящиеся в момент расчёта в Очереди заявок.

2.3. Безадресные Заявки на покупку ценной бумаги или безадресные Заявки на продажу ценной бумаги, указанные в пункте 2.2.2. Методики, учитываются при расчете текущей цены в следующих случаях:

- если лучшая цена, указанная в безадресных Заявках на покупку ценной бумаги или в безадресных Заявках на продажу ценной бумаги выше (ниже) средневзвешенной цены данной ценной бумаги, рассчитанной на основании Договоров купли-продажи ценных бумаг, заключённых на основании хотя бы одной безадресной Заявки в течение 10 (десяти) минут Торгов, предшествующих моменту расчета, или

- если лучшая цена, указанная в безадресных Заявках на покупку ценной бумаги или в безадресных Заявках на продажу ценной бумаги, выше (ниже) последнего рассчитанного значения текущей цены ценной бумаги, в случае отсутствия в течение 10 (десяти) минут Торгов Договоров купли-продажи ценных бумаг, заключённых на основании хотя бы одной безадресной Заявки.

Для целей расчета текущей цены используются только безадресные Заявки на покупку (на продажу), цены которых не выше (не ниже) лучшей цены, содержащейся в безадресных Заявках на покупку (на продажу), и выше (ниже) средневзвешенной цены данной ценной бумаги, рассчитанной на основании Договоров, заключённых на основании хотя бы одной безадресной Заявки в течение 10 (десяти) минут Торгов, предшествующих моменту расчета, или последнего рассчитанного значения текущей цены ценной бумаги, в случае отсутствия в течение 10 (десяти) минут Торгов Договоров, заключённых на основании хотя бы одной безадресной Заявки.

2.4. Текущая цена ценной бумаги на расчетное время (t) рассчитывается как средневзвешенная цена данной ценной бумаги за предшествующие моменту расчёта 10 (десять) минут Торгов по всем Договорам купли-продажи и Заявкам, перечисленным в пункте 2.2 Методики, по следующей формуле:

$$P_t = \frac{\sum_{i=1}^N (P_i \times Q_i) + \sum_{j=1}^M (P_j \times Q_j)}{\sum_{i=1}^N Q_i + \sum_{j=1}^M Q_j}, \text{ где}$$

P – значение текущей цены;

P_i – Цена, содержащаяся в i-ом Договоре, учитываемом при расчете текущей цены;

P_j – Цена, указанная в j-ой безадресной Заявке, учитываемой при расчете текущей цены;

- Q_i – количество ценных бумаг в i -ом Договоре, учитываемом при расчете текущей цены, шт.;
- Q_j – количество ценных бумаг в j -ой безадресной Заявке, учитываемой при расчете текущей цены, шт.

2.5. В случае отсутствия в ходе Торгов в течение 1 (одной) минуты, предшествующей моменту расчёта значения текущей цены ценной бумаги, Договоров купли-продажи, предметом которых является указанная ценная бумага, заключённых на основании хотя бы одной безадресной Заявки, а также безадресных Заявок, удовлетворяющих условиям определённым в пункте 2.2 Методики, текущая цена принимается равной последней рассчитанной текущей цене данной ценной бумаги.

2.6. При расчёте текущей цены ценной бумаги не учитываются цены по Договорам, заключённым в режимах торгов, в которых участникам торгов предоставляется доступ к информации только о собственных заявках, объявленных в данном режиме торгов, цены, содержащиеся в Договорах репо, а также цены по Договорам, заключённым в Режиме торгов Аукцион по размещению, Режиме торгов Адресное размещение, Режиме торгов Аукцион по выкупу и Режиме торгов Адресный выкуп.

2.7. Расчёт текущей цены ценной бумаги осуществляется Биржей по всем ценным бумагам, допущенным к организованным торгам, проводимым Публичным акционерным обществом «Санкт-Петербургская биржа».

2.8. Расчет текущей цены производится в валюте, в которой выражается цена ценной бумаги в соответствии с внутренними документами Биржи.

3. Расчет цены закрытия.

3.1. Цена закрытия ценной бумаги определяется по состоянию на момент окончания основной торговой сессии один раз в течение Торгового дня.

3.2. Значение цены закрытия принимается равным последней рассчитанной текущей цене данной ценной бумаги.

3.3. Расчет цены закрытия осуществляется в валюте, в которой выражается цена ценной бумаги в соответствии с внутренними документами Биржи.

3.4. При определении цены закрытия ценной бумаги не учитываются цены по договорам, заключённым в режимах торгов, в которых участникам торгов предоставляется доступ к информации только о собственных заявках, объявленных в данном режиме торгов, цены, содержащиеся в Договорах репо, а также цены по Договорам, заключённым в Режиме торгов Аукцион по размещению, Режиме торгов Адресное размещение, Режиме торгов Аукцион по выкупу и Режиме торгов Адресный выкуп.