

Методика
расчета текущих цен и цен закрытия ценных бумаг

1. Общие положения

1.1. Настоящая методика расчёта текущих цен и цен закрытия ценных бумаг Публичного акционерного общества «СПБ 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 «СПБ 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 купли-продажи ценной бумаги, 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 купли-продажи ценной бумаги, 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_t - значение текущей цены;

P_i - цена, содержащаяся в i-ом Договоре купли-продажи, 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 купли-продажи, 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 купли-продажи, 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 купли-продажи, 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 Биржей.

2.8. Расчет текущей цены производится в валюте цены, установленной Биржей. Для облигаций валюта цены выражается в процентах от непогашенной на момент заключения Договора купли-продажи номинальной стоимости облигации.

2.9. В целях определения границ Динамических лимитов в соответствии с Методикой установления и изменения лимитов цен ценных бумаг, относящихся к Группе инструментов «российские ценные бумаги», за исключением облигаций российских эмитентов, по которым Участником торгов может быть подана заявка или заключен договор, Биржа осуществляет расчет текущей цены по правилам и с учетом данных, описанных в настоящем разделе Методики, за исключением временного интервала, используемого для указанного расчета. Расчет текущей цены в целях настоящего пункта производится за предшествующие моменту расчёта 30 (тридцать) минут Торгов:

– за период с 18:20 до 18:50 мск Торгового дня;

– за период 30 (тридцать) минут до завершения времени проведения Торгов календарного дня, предшествующего календарному дню, из которого состоит текущий Торговый день и в который проводится основная торговая сессия текущего Торгового дня. Указанный расчет используется исключительно для Торгового дня, который состоит из нескольких календарных дней.

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 определяется как последнее значение средневзвешенной цены ценной бумаги, рассчитываемой по указанным ниже правилам, на момент времени, указанный в пункте 3.1 Методики.

Средневзвешенная цена для целей определения цены закрытия рассчитывается в ходе проведения Торгов в течение Торгового дня не реже 1 (одного) раза в минуту и рассчитывается как средневзвешенная цена данной ценной бумаги за предшествующие моменту расчёта 10 (десять) минут Торгов по всем Договорам купли-продажи, соответствующих условиям, указанным в пункте 2.2.1 Методики, по следующей формуле:

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

- P_t - значение средневзвешенной цены для определения цены закрытия;
- P_i - цена, содержащаяся в i -ом Договоре купли-продажи, соответствующем условиям, указанным в пункте 2.2.1;

Q_i - количество ценных бумаг в i -ом Договоре купли-продажи, соответствующем условиям, указанным в пункте 2.2.1, шт.;

В случае отсутствия в ходе Торгов в течение 1 (одной) минуты, предшествующей моменту расчёта значения указанной в настоящем пункте средневзвешенной цены ценной бумаги, Договоров купли-продажи, соответствующих условиям, указанным в пункте 2.2.1 Методики, указанная в настоящем пункте средневзвешенная цена принимается равной последней средневзвешенной цене данной ценной бумаги, рассчитанной по правилам указанным в настоящем пункте.

Расчёт средневзвешенной цены ценной бумаги, указанной в настоящем пункте, осуществляется Биржей по всем ценным бумагам, допущенным к организованным торгам, проводимым Биржей.

3.3. Расчет средневзвешенной цены для целей определения цены закрытия осуществляется в валюте цены, установленной Биржей. Для облигаций валюта цены выражается в процентах от непогашенной на момент заключения Договора купли-продажи номинальной стоимости облигации.

3.4. При определении цены закрытия ценной бумаги не учитываются цены по Договорам купли-продажи, заключённым в Режиме 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».

4. Расчет текущей цены и цены закрытия в случае проведения корпоративных событий эмитента и изменения валюты цены и (или) валюты расчетов

4.1. В случае проведения дробления/консолидации ценных бумаг или изменения валюты цены и (или) валюты расчетов по ценным бумагам, по которым производится расчет текущей цены, Биржа вправе со времени начала расчета текущей цены по такой ценной бумаге в Торговый день, следующий за днем, в котором произошло указанное событие, рассчитывать текущую цену с учетом применения коэффициента дробления/коэффициента консолидации или конвертации валюты по официальному курсу, установленному Банком России на дату расчета текущей цены по такой ценной бумаге.

4.2. В случае проведения дробления или консолидации ценных бумаг Биржа корректирует цену закрытия Торгового дня, предшествующего дню проведения дробления или консолидации ценных бумаг, с учетом применения коэффициента дробления или коэффициента консолидации.

4.3. В случае изменения валюты цены и (или) валюты расчетов по ценной бумаге Биржа корректирует цену закрытия Торгового дня, предшествующего дню изменения валюты цены и (или) валюты расчетов, с учетом конвертации валюты по официальному курсу, установленному Банком России на дату расчета этой цены закрытия.

4.4. В случае отсутствия Торгов ценной бумагой, проводимых в Режиме основных торгов, и при условии, что дата начала проведения Торгов ценной бумагой, проводимых в Режиме основных торгов, совпадает с датой размещения или приходится на дату позже даты размещения указанных ценных бумаг (в том числе дополнительного выпуска указанных ценных бумаг), Биржа вправе сформировать и опубликовать на сайте Биржи в сети Интернет цену закрытия указанной ценной бумаги на дату, предшествующую дате размещения указанных ценных бумаг (в том числе дополнительного выпуска ценных бумаг), равную цене размещения таких ценных бумаг, определенной в соответствии с эмиссионными документами эмитента указанных ценных бумаг.