

УТВЕРЖДЕНО
Советом директоров
Открытого акционерного общества
“Санкт-Петербургская Биржа”
(протокол от 23 декабря 2013 г. № 15/2013)

Методика
расчета текущих цен и цен закрытия ценных бумаг

Москва
2013

1. Общие положения.

1.1. Настоящая методика расчета текущих цен и цен закрытия ценных бумаг Открытого акционерного общества «Санкт-Петербургская биржа» (далее – Методика) разработана в соответствии с нормативными правовыми документами, регулирующими порядок оказания услуг 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 документами, регулирующими порядок оказания услуг по проведению организованных торгов, и которые применяются Открытым акционерным обществом «Санкт-Петербургская биржа» (далее - Биржа) в целях определения случаев приостановки торгов отдельными ценными бумагами.

1.3. Расчет текущей цены и цен закрытия осуществляется Биржей по всем ценным бумагам, включенным в список ценных бумаг, допущенных к торгам на Бирже.

1.4. Термины используются в значениях, определенных законодательством Российской Федерации, нормативными правовыми актами, регулирующими порядок оказания услуг по проведению организованных торгов, и внутренними документами Биржи.

2. Расчёт текущей цены.

2.1. Текущая цена рассчитывается в течение торгового дня не реже 1 (одного) раза в минуту.

2.2. При расчете текущей цены ценной бумаги учитываются:

- сделки с данной ценной бумагой, совершенные на основании безадресных заявок в течение 10 (десяти) минут, предшествующих моменту расчета текущей цены;

- действующие на момент расчета текущей цены безадресные заявки на покупку (продажу) данной ценной бумаги.

Заявки на покупку (продажу) данной ценной бумаги учитываются при расчете текущей цены в следующих случаях:

- если указанная в заявке на покупку (продажу) цена выше (ниже) средневзвешенной цены данной ценной бумаги, рассчитанной на основании цен сделок, совершенных на основании безадресных сделок в течение 10 (десяти) минут предшествующих моменту расчета,

- если указанная в заявке на покупку (продажу) цена выше (ниже) последнего рассчитанного значения текущей цены данной ценной бумаги в случае отсутствия в течение 10 (десяти) минут, предшествующих моменту расчета, совершенных на основании безадресных заявок сделок с данной ценной бумагой.

2.3. 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 сделкам и заявкам, перечисленным в пункте 2.2 Методики, по формуле

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

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

$$\sum_{i=1}^N Q_i + \sum_{j=1}^M Q_j$$

P – значение текущей цены, руб.;

- P_i – цена в i-ой сделке, учитываемой при расчете значения текущей цены, руб.¹;
- P_j – цена в j-ой заявке, учитываемой при расчете значения текущей цены, руб.¹;
- Q_i – количество ценных бумаг в i-ой сделке, учитываемой при расчете значения текущей цены, шт.;
- Q_j – количество ценных бумаг в j-ой заявке, учитываемой при расчете значения текущей цены, шт.;

2.4. При отсутствии в течение 1 (одной) минуты, предшествующей моменту расчета, сделок с данной ценной бумагой, совершенных на основании безадресных заявок, и безадресных заявок на покупку (продажу) ценной бумаги, удовлетворяющих условиям, определенным в пункте 2.2 Методики, значение текущей цены принимается равным последней рассчитанной текущей цене данной ценной бумаги.

2.5. При расчете текущей цены ценной бумаги не учитываются цены по сделкам, совершенным в режимах торговли, в которых участникам торгов предоставляется доступ к информации только о собственных заявках, объявленных в данном режиме торговли.

2.6. Расчет текущей цены ценной бумаги осуществляется Биржей по ценным бумагам, включенным в котировальный список А.

3. Расчет цены закрытия.

3.1. Цена закрытия по ценной бумаге рассчитывается на момент окончания основной торговой сессии как средневзвешенная цена данной ценной бумаги за предшествующие моменту расчета 10 (десять) минут торгов по всем сделкам, указанным в пункте 2.2 Методики, по формуле

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

- P – значение цены закрытия, руб.;
- P_i – цена в i-ой сделке, учитываемой при расчете значения цены закрытия, руб.¹;
- Q_i – количество ценных бумаг в i-ой сделке, учитываемой при расчете значения цены закрытия, шт.;

3.2. В случае отсутствия сделок, указанных в пункте 2.2. Методики, цена закрытия равна цене, рассчитанной в соответствии с пунктом 2.4. Методики.

3.3. При определении цены закрытия ценной бумаги не учитываются цены по сделкам, совершенным в режимах торговли, в которых участникам торгов предоставляется доступ к информации только о собственных заявках, объявленных в данном режиме торговли.

¹ В случае совершения сделок, номинированных в валюте, отличной от российских рублей, в целях расчета показателей цена такой сделки переводится в российские рубли по курсу Банка России, установленному для указанной валюты, отличной от российских рублей на день совершения сделки.

