

**УТВЕРЖДЕНО**  
**Советом директоров**  
**Открытого акционерного общества**  
**“Санкт-Петербургская Биржа”**  
**(протокол № 15/2014 от "30" октября 2014 года)**

**Методика**  
**расчета текущих цен и цен закрытия ценных бумаг**

**Москва**  
**2014**

## 1. Общие положения.

1.1. Настоящая методика расчёта текущих цен и цен закрытия ценных бумаг Открытого акционерного общества «Санкт-Петербургская биржа» (далее – Методика) разработана в соответствии с нормативными правовыми актами, 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 актами, 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.

1.4. 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:

- договоры с данной ценной бумагой, заключённые 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 договоров, заключённых на основании безадресных заявок в течение 10 (десяти) минут, предшествующих моменту расчета, или
- 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, договоров с данной ценной бумагой, заключённых на основании безадресных заявок.

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 договорам 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 в i-ом договоре, учитываемом при расчете значения текущей цены;

$P_j$  – цена в j-ой заявке, учитываемой при расчете значения текущей цены;

- $Q_i$  – количество ценных бумаг в  $i$ -ом договоре, учитываемом 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 расчёта, договоров с данной ценной бумагой, заключённых на основании безадресных заявок, а также безадресных заявок на покупку (продажу) ценной бумаги, удовлетворяющих условиям, определённым в пункте 2.2 Методики, значение текущей цены принимается равным последней рассчитанной текущей цене данной ценной бумаги.

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

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

2.7. 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 по ценной бумаге рассчитывается на момент окончания основной торговой сессии как средневзвешенная цена данной ценной бумаги за предшествующие моменту расчёта 10 (десять) минут торгов по всем договорам с данной ценной бумагой, заключённым на основании безадресных заявок, по следующей 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;
- $P_i$  – цена в  $i$ -ом договоре, учитываемом при расчёте значения цены закрытия;
- $Q_i$  – количество ценных бумаг в  $i$ -ом договоре, учитываемом при расчёте значения цены закрытия, шт.

3.2. В случае отсутствия договоров, указанных в пункте 3.1. Методики, 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 торговли, в которых участникам торгов предоставляется доступ к информации только о собственных заявках, объявленных в данном режиме торговли.