

Методика расчета ценовых показателей на рынке ценных бумаг ПАО «СПБ Биржа»

1. Общие положения

1.1. Настоящая методика расчета ценовых показателей на рынке ценных бумаг ПАО «СПБ Биржа» (далее – Методика) разработана в соответствии с нормативными правовыми актами, регулирующими порядок деятельности по проведению организованных торгов, а также нормативными правовыми актами регламентирующими порядок определения организаторами торговли ценовых показателей.

1.2. Методика устанавливает и регулирует порядок расчета следующих ценовых показателей, требования к которым установлены нормативными правовыми актами, регулирующими порядок деятельности по проведению организованных торгов:

- рыночная цена (показатели «Рыночная цена 2» и «Рыночная цена 3»);
- средневзвешенная цена (показатель «Средневзвешенная цена»);
- признаваемая котировка (показатель «Признаваемая котировка»);
- текущее (актуальное) значение ставки репо (показатель «Текущее (актуальное) значение Ставки репо»);
- средневзвешенное значение ставки репо (показатель «Средневзвешенное значение Ставки репо»).

1.3. Термины, специально не определенные в настоящей Методике, используются в значениях, определенных законодательством Российской Федерации и внутренними документами ПАО «СПБ Биржа» (далее – Биржа).

1.4. Для расчета в стоимостном выражении объема Договоров, заключенных в иностранной валюте, для целей расчета ценовых показателей: «Рыночная цена 2», «Рыночная цена 3» и «Признаваемая котировка», в качестве курса конвертации используется официальный курс иностранной валюты, установленный Банком России, на дату расчета.

1.5. Ценовые показатели, указанные в настоящей Методике, рассчитываются/определяются по каждой ценной бумаге с учетом Кодов расчетов.

2. Расчет показателя «Рыночная цена 2»/ «Признаваемая котировка»

2.1. Показатель «Рыночная цена 2»/ «Признаваемая котировка» рассчитывается каждый Торговый день по Договорам, заключенным в период основной торговой сессии. Договоры, заключенные в течение дополнительных торговых сессий, не учитываются и не влияют на значение показателя «Рыночная цена 2» / «Признаваемая котировка».

2.2. Расчет показателя «Рыночная цена 2»/ «Признаваемая котировка» осуществляется следующим образом:

2.2.1. Показатель «Рыночная цена 2»/ «Признаваемая котировка» определяется как средневзвешенная цена по Договорам купли-продажи, заключенным в Режиме основных торгов (далее – рыночные сделки), с ценными бумагами того же выпуска в течение одного Торгового дня, если число рыночных сделок составляет не менее 10 (Десяти) и объем этих рыночных сделок составляет не менее суммы, эквивалентной 500 000 рублей.

2.2.2. В случае если в течение основной торговой сессии 1 (Одного) Торгового дня заключено менее десяти рыночных сделок с ценными бумагами того же выпуска или объем этих рыночных сделок составляет менее суммы, эквивалентной 500 000 рублей, то показатель «Рыночная цена 2» / «Признаваемая котировка» в отношении ценной бумаги определяется как средневзвешенная цена по рыночным сделкам с ценными бумагами того же выпуска, заключенным в течение основных торговых сессий последних 2 (Двух) Торговых дней, если число таких рыночных сделок составляет не менее 10 (Десяти) и объем этих рыночных сделок составляет не менее суммы, эквивалентной 500 000 рублей.

2.2.3 В случае если в течение основных торговых сессий последних 2 (двух) Торговых дней заключено менее 10 (Десяти) рыночных сделок с ценными бумагами того же выпуска или объем этих рыночных сделок составляет менее суммы, эквивалентной 500 000 рублей, то показатель «Рыночная цена 2»/ «Признаваемая котировка» ценной бумаги определяется как средневзвешенная цена по рыночным сделкам с ценными бумагами того же выпуска, заключенным в течение основных торговых сессий последних 3 (Трех) Торговых дней, если число таких рыночных сделок составляет не менее 10 (Десяти) и объем этих рыночных сделок составляет не менее суммы, эквивалентной 500 000 рублей.

2.2.4. В случае если в течение последних основных торговых сессий 3 (Трех) Торговых дней заключено менее 10 (Десяти) рыночных сделок с ценными бумагами того же выпуска или объем этих рыночных сделок составляет менее суммы, эквивалентной 500 000 рублей, то показатель

«Рыночная цена 2»/ «Признаваемая котировка» ценной бумаги определяется как средневзвешенная цена по рыночным сделкам с ценными бумагами того же выпуска, заключенным в течение основных торговых сессий последних 5 (Пяти) Торговых дней, если число таких рыночных сделок составляет не менее 10 (Десяти) и объем этих рыночных сделок составляет не менее суммы, эквивалентной 500 000 рублей.

2.2.5. В случае если в течение основных торговых сессий последних 5 (Пяти) Торговых дней заключено менее 10 (Десяти) рыночных сделок с ценными бумагами того же выпуска или объем этих рыночных сделок составляет менее суммы, эквивалентной 500 000 рублей, то показатель «Рыночная цена 2»/ «Признаваемая котировка» ценной бумаги определяется как средневзвешенная цена по рыночным сделкам с ценными бумагами того же выпуска, заключенным в течение основных торговых сессий последних 10 (Десяти) Торговых дней, если число таких рыночных сделок составляет не менее 10 (Десяти) и объем этих рыночных сделок составляет не менее суммы, эквивалентной 500 000 рублей.

2.3. В случае если в течение последних основных торговых сессий 10 (Десяти) Торговых дней заключено менее 10 (Десяти) рыночных сделок с ценными бумагами того же выпуска или объем этих рыночных сделок составляет менее 500 000 рублей, то показатель «Рыночная цена 2»/ «Признаваемая котировка» ценной бумаги не определяется.

2.4. Показатель «Рыночная цена 2»/ «Признаваемая котировка» раскрывается на сайте Биржи в сети Интернет не позднее одного часа после окончания основной торговой сессии.

3. Расчет показателя «Рыночная цена 3»

3.1. Показатель «Рыночная цена 3» рассчитывается по рыночным сделкам, заключенным в течение основной торговой сессии. Рыночные сделки, заключенные в течение дополнительных торговых сессий, не учитываются и не влияют на значение показателя «Рыночная цена 3».

3.2. Расчет показателя «Рыночная цена 3» осуществляется следующим образом:

3.2.1. Показатель «Рыночная цена 3» определяется как средневзвешенная цена по рыночным сделкам, заключенным с ценными бумагами того же выпуска в течение основной торговой сессии Торгового дня, если число указанных рыночных сделок составляет не менее 10 (Десяти) и объем этих рыночных сделок составляет не менее суммы, эквивалентной 500 000 рублей.

3.2.2. В случае если в течение основной торговой сессии Торгового дня, по итогам которой рассчитывается показатель «Рыночная цена 3», заключено менее 10 (Десяти) рыночных сделок с ценными бумагами того же выпуска или объем этих рыночных сделок составляет менее суммы, эквивалентной 500 000 рублей, то показатель «Рыночная цена 3» ценной бумаги определяется как средневзвешенная цена по последним 10 (Десяти) рыночным сделкам с ценными бумагами того же выпуска, заключенным в течение основных торговых сессий последних 90 (Девяноста) Торговых дней, если объем этих рыночных сделок составляет не менее суммы, эквивалентной 500 000 рублей.

3.2.3. В случае если объем последних 10 (Десяти) рыночных сделок с ценными бумагами того же выпуска, заключенных в течение основных торговых сессий последних 90 (Девяноста) Торговых дней, но более чем за 1 (Один) Торговый день, составляет менее суммы, эквивалентной 500 000 рублей, то показатель «Рыночная цена 3» ценной бумаги определяется как средневзвешенная цена по последним рыночным сделкам с ценными бумагами того же выпуска, заключенным в течение основных торговых сессий последних 90 (Девяноста) Торговых дней, если число таких рыночных сделок более 10 (Десяти) и объем этих рыночных сделок составляет не менее суммы, эквивалентной 500 000 рублей.

3.3. В случае если объем рыночных сделок, заключенных в течение последних основных торговых сессий 90 (Девяноста) Торговых дней, составляет менее 500 000 рублей или число рыночных сделок, заключенных в течение последних основных торговых сессий 90 (Девяноста) дней, менее 10 (Десяти), то показатель «Рыночная цена 3» не определяется.

3.4. Показатель «Рыночная цена 3» раскрывается на сайте Биржи в сети Интернет не позднее одного часа после окончания основной торговой сессии.

4. Расчет показателя «Средневзвешенная цена»

4.1. Показатель «Средневзвешенная цена» рассчитывается по рыночным сделкам, заключенным в течение Торгового дня отдельно:

- по рыночным сделкам, заключенным в утреннюю дополнительную торговую сессию;
- по рыночным сделкам, заключенным в основную торговую сессию;
- по рыночным сделкам, заключенным в вечернюю дополнительную торговую сессию;
- по рыночным сделкам, заключенным за весь Торговый день.

4.2. Расчет показателя «Средневзвешенная цена» за установленный период времени осуществляется путем деления суммы произведений цен каждой из рыночных сделок на количество ценных бумаг в соответствующей рыночной сделке, заключенной в соответствующий период времени с указанной ценной бумагой (за исключением договоров репо), на сумму количества ценных бумаг в указанных Договорах за тот же период времени.

4.3. Если по итогам соответствующей торговой сессии Торгового дня показатель «Средневзвешенная цена» не был рассчитан, он не приравнивается к показателю «Средневзвешенная цена» соответствующей торговой сессии предыдущего Торгового дня.

4.4. Показатель «Средневзвешенная цена» раскрывается на сайте Биржи в сети Интернет не позднее начала основной торговой сессии следующего Торгового дня.

5. Определение показателя «Текущее (актуальное) значение Ставки репо»

5.1. Показатель «Текущее (актуальное) значение Ставки репо» определяется по Договорам репо, заключенным в течение Торгового дня отдельно:

- по Договорам репо, заключенным в утреннюю дополнительную торговую сессию;
- по Договорам репо, заключенным в основную торговую сессию;
- по Договорам репо, заключенным в вечернюю дополнительную торговую сессию;
- по Договорам репо, заключенным за весь Торговый день.

5.2. Показатель «Текущее (актуальное) значение Ставки репо» определяется как Ставка репо в последнем, заключенном Договоре репо на момент его заключения.

5.3. Если по итогам соответствующей торговой сессии Торгового дня показатель «Текущее (актуальное) значение Ставки репо» не был определен, он не приравнивается к показателю «Текущее (актуальное) значение Ставки репо» соответствующей торговой сессии предыдущего Торгового дня.

6. Расчет показателя «Средневзвешенное значение Ставки репо»

6.1. Показатель «Средневзвешенное значение Ставки репо» рассчитывается по Договорам репо, заключенным в течение Торгового дня отдельно:

- по Договорам репо, заключенным в утреннюю дополнительную торговую сессию;
- по Договорам репо, заключенным в основную торговую сессию;
- по Договорам репо, заключенным в вечернюю дополнительную торговую сессию;
- по Договорам репо, заключенным за весь Торговый день.

6.2. Расчет показателя «Средневзвешенное значение Ставки репо» осуществляется путем деления суммы произведений Ставок репо каждой из Договоров репо на количество ценных бумаг в соответствующем Договоре репо, заключенной в соответствующий период времени с указанной ценной бумагой, на сумму количества ценных бумаг в указанных Договорах репо за тот же период времени.

6.3. Пересчет показателя «Средневзвешенное значение Ставки репо» осуществляется в течение Торгового дня.

6.4. Если по итогам соответствующей торговой сессии Торгового дня показатель «Средневзвешенное значение Ставки репо» не был рассчитан, он не приравнивается к показателю «Средневзвешенное значение Ставки репо» соответствующей торговой сессии предыдущего Торгового дня.