

**УТВЕРЖДЕНО**  
**Советом директоров**  
**ПАО «СПБ Биржа»**  
**«28» декабря 2024 года**  
**(протокол № 10/2024 от 28.12.2024)**

**ПРАВИЛА**  
**ПРОВЕДЕНИЯ ОРГАНИЗОВАННЫХ ТОРГОВ ПРОИЗВОДНЫМИ ФИНАНСОВЫМИ**  
**ИНСТРУМЕНТАМИ**

**Москва**  
**2024**

## Оглавление

|                                                                                                     |    |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
| Глава I. Общие положения                                                                            | 3  |
| Статья 1. Термины и определения                                                                     | 3  |
| Статья 2. Общие положения                                                                           | 4  |
| Глава II. Допуск к Торгам                                                                           | 5  |
| Статья 3. Основания и порядок начала, приостановления или прекращения заключения Срочных контрактов | 5  |
| Статья 4. Допуск Участников торгов к участию в Торгах                                               | 5  |
| Глава III. Маркет-мейкеры                                                                           | 6  |
| Статья 5. Требования к Маркет-мейкерам                                                              | 6  |
| Статья 6. Порядок осуществления функций и обязанностей Маркет-мейкеров                              | 6  |
| Глава IV. Общие положения о порядке проведения Торгов                                               | 7  |
| Статья 7. Время проведения Торгов                                                                   | 7  |
| Статья 8. Заявки                                                                                    | 7  |
| Статья 9. Условия и порядок подачи Заявок                                                           | 8  |
| Статья 10. Реестр Заявок                                                                            | 10 |
| Статья 11. Порядок заключения и исполнения Договоров                                                | 11 |
| Статья 12. Ведение реестра Договоров                                                                | 13 |
| Статья 13. Порядок взаимодействия Биржи и Клиринговой организации                                   | 14 |
| Глава V. Проведение Торгов в Режиме основных торгов ПФИ                                             | 14 |
| Статья 14. Порядок подачи Заявок в периоде непрерывного аукциона                                    | 14 |
| Статья 15. Порядок заключения Договоров в периоде непрерывного аукциона                             | 18 |
| Глава VI. Проведение Торгов в Режиме безадресных торгов ПФИ                                         | 21 |
| Статья 17. Порядок подачи Заявок в периоде непрерывного аукциона                                    | 21 |
| Статья 18. Порядок заключения Договоров в периоде непрерывного аукциона                             | 24 |
| Статья 19. Аукцион дополнительной ликвидности. Особенности подачи Заявок и заключения Договоров     | 26 |
| Глава VII Проведение Торгов в Режиме торгов RFQ ПФИ                                                 | 28 |
| Статья 20. Запросы на котировку                                                                     | 28 |
| Статья 21. Порядок подачи Заявок                                                                    | 30 |
| Статья 22. Порядок заключения Договоров                                                             | 32 |
| Глава VIII. Проведение Торгов в Режиме переговорных сделок ПФИ                                      | 32 |
| Статья 23. Порядок подачи Заявок                                                                    | 32 |
| Статья 24. Порядок заключения Договоров                                                             | 33 |
| Глава IX. Другие положения                                                                          | 33 |
| Статья 25. Приостановка, возобновление и прекращение Торгов                                         | 33 |
| Статья 26. Биржевая информация                                                                      | 35 |
| Статья 27. Информация о Торгах                                                                      | 35 |
| Статья 28. Определение тарифов Биржи                                                                | 36 |
| Статья 29. Порядок оплаты услуг Биржи                                                               | 36 |
| Статья 30. Порядок осуществления контроля за Участниками торгов и контроля за операциями            | 36 |
| Статья 31. Ответственность                                                                          | 37 |
| Статья 32. Порядок разрешения споров                                                                | 37 |
| Статья 33. Общие правила использования информации                                                   | 38 |
| Приложение № 1                                                                                      | 40 |

## Глава I. Общие положения

### Статья 1. Термины и определения

**Аналог собственноручной подписи/АСП** – реквизит Заявки или иного электронного сообщения, направляемого в Систему проведения торгов, позволяющий идентифицировать Участника торгов, направившего Заявку или иное электронное сообщение, и подтверждающий целостность и неизменность Заявок или иных электронных сообщений за счет использования специализированных программно-технических средств и организационных мероприятий.

**Биржа** – Публичное акционерное общество «СПБ Биржа».

**Группа инструментов** – совокупность Срочных контрактов, формируемая Биржей в соответствии с настоящими Правилами в целях подачи Заявок и заключения Договоров.

**Договор** – один или несколько Срочных контрактов, заключенных на Торгах в соответствии с настоящими Правилами и Правилами клиринга, на основании двух встречных Заявок либо без Заявок в случаях, предусмотренных настоящими Правилами и Правилами клиринга.

**Заявка** – предложение и (или) принятие предложения заключить один или несколько Срочных контрактов на Торгах.

**Заявка на покупку** – Заявка, представляющая собой предложение и (или) принятие предложения заключить один или несколько Срочных контрактов, в которых Участник торгов, объявивший Заявку, является покупателем.

**Заявка на продажу** – Заявка, представляющая собой предложение и (или) принятие предложения заключить один или несколько Срочных контрактов, в которых Участник торгов, объявивший Заявку, является продавцом.

**Идентификатор адресных сделок** – Идентификатор адресных сделок, присвоенный Участнику торгов в соответствии с Правилами допуска и (или) внутренними документами Биржи.

**Идентификатор Участника торгов** – Идентификатор Участника торгов, присвоенный Участнику торгов в соответствии с Правилами допуска и (или) внутренними документами Биржи.

**Имя** – пользовательское имя (логин), представляющее собой уникальное условное обозначение, однозначно определяющее Участника торгов, присвоенное Участнику торгов для доступа к Системе проведения торгов.

**Клиент** – клиент Участника торгов и (или) иное лицо, в интересах которых Участниками торгов заключаются Договоры, и зарегистрированные Биржей в установленном порядке.

**Клиринговая организация** – Небанковская кредитная организация – центральный контрагент «СПБ Клиринг» (акционерное общество).

**Код Клиента** – код, присваиваемый Клиенту в соответствии с Правилами допуска и (или) внутренними документами Биржи.

**Краткий код Клиента** – краткий код Клиента, присваиваемый Клиенту в соответствии с Правилами допуска и (или) внутренними документами Биржи.

**Маркет-мейкер** – Участник торгов, который на основании договора, одной из сторон которого является Биржа, принимает на себя обязательства по поддержанию цен, спроса, предложения и (или) объема торгов Срочными контрактами на Торгах на условиях, установленных таким договором.

**Обрабатываемая Заявка** – Объявленная Заявка до момента ее постановки в Очередь заявок.

**Объявленная Заявка** – Поданная Заявка, зарегистрированная в реестре Заявок.

**Опцион** – Срочный контракт, предусматривающий

- обязанность стороны Срочного контракта на условиях, определенных при его заключении, в случае предъявления требования другой стороной купить или продать ценные бумаги, являющиеся Базисным активом, в том числе путем заключения договора купли-продажи ценных бумаг, или

- обязанность стороны Срочного контракта на условиях, определенных при его заключении, в случае предъявления требования другой стороной периодически и (или) одновременно уплачивать денежные суммы в зависимости от изменения цен на ценные бумаги, являющиеся Базисным активом.

**Очередь заявок** – упорядоченная последовательность Объявленных Заявок одинаковой направленности, формируемая в порядке, определенном настоящими Правилами.

**Пароль** – уникальная последовательность случайных букв, и (или) чисел, и (или) иных символов, используемая для аутентификации Участника торгов, присвоенная Участнику торгов для доступа к Системе проведения торгов.

**Поданная Заявка** – Заявка, зафиксированная с использованием Системы проведения торгов в соответствии с пунктом 9.2. настоящих Правил, но не зарегистрированная в реестре Заявок.

**Правила допуска** – внутренний документ Биржи, определяющий условия и порядок допуска к участию в Торгах, приостановления, возобновления и прекращения допуска к участию в

Торгах, требования к Участникам торгов, требования к способам и периодичности идентификации Участников торгов, порядок ведения Биржей реестра Участников торгов и реестра Клиентов.

**Правила клиринга** – внутренний документ Клиринговой организации, в котором установлен порядок определения, учета и исполнения обязательств по Договорам.

**Режим торгов** – совокупность условий и порядка проведения Торгов, установленная настоящими Правилами.

**Рутинговый агент** – Центральный контрагент, Участник торгов, действующий от своего имени и за свой счет и заключивший с Биржей договор, предметом которого является оказание услуг по подаче указанным лицом Заявок дополнительной ликвидности и заключение Срочных контрактов, и (или) Участник торгов, действующий от своего имени и за счет Клиента, заключившего с Биржей и Участником торгов договор, предметом которого является оказание услуг по подаче за счет указанного Клиента Заявок дополнительной ликвидности и заключение Срочных контрактов.

**Система проведения торгов** – совокупность вычислительных средств, программного обеспечения, баз данных, телекоммуникационных средств и другого оборудования, обеспечивающих возможность поддержания, хранения, обработки и раскрытия информации, необходимой для проведения Торгов.

**Система электронного документооборота** – организационно-техническая система, представляющая собой совокупность программного обеспечения, баз данных и вычислительных средств, обеспечивающая обмен Электронными документами, подписанными Электронной подписью.

**Спецификация** – документ, раскрываемый на сайте Биржи в сети Интернет, совместно с настоящими Правилами и Правилами клиринга определяющий стандартные условия Срочного контракта и порядок его исполнения.

**Срочный контракт** – договор, являющийся производным финансовым инструментом, заключаемый на Торгах в соответствии с настоящими Правилами на условиях, определенных Спецификациями, настоящими Правилами, Правилами клиринга.

**Торги** – организованные торги производными финансовыми инструментами, проводимые Биржей в соответствии с требованиями настоящих Правил и Правил клиринга.

**Торговый день** – период времени, в течение которого в соответствии с настоящими Правилами Биржа проводит Торги.

**Торговый лот** – количество Срочных контрактов, установленное Биржей для каждого Срочного контракта, которому должно быть кратно количество Срочных контрактов, указанное в Заявке.

**Торгово-клиринговый счет** – Торгово-клиринговый счет в значении, установленном Правилами клиринга.

**Участник торгов** – юридическое лицо, допущенное к участию в Торгах в порядке, предусмотренном Правилами допуска.

**Центральный контрагент** – Клиринговая организация, осуществляющая функции центрального контрагента.

**Шаг цены** – значение, которому должна быть кратно цена, указанная в Заявке на покупку/Заявке на продажу.

**Электронный документ** – электронный документ в значении, установленном Федеральным законом «Об информации, информационных технологиях и о защите информации».

**Электронная подпись** – электронная подпись в значении, установленном Федеральным законом «Об электронной подписи».

Термины, специально не определенные в настоящих Правилах, используются в значениях, установленных иными внутренними документами Биржи, Правилами допуска, Правилами клиринга, Спецификациями, а также законодательством Российской Федерации.

## **Статья 2. Общие положения**

2.1. Настоящие Правила приняты в соответствии с требованиями Федерального закона «Об организованных торгах» и принятых в соответствии с ним нормативных актов, а также устава и иных документов Биржи.

2.2. Настоящие Правила устанавливают условия и порядок проведения Торгов.

2.3. Биржа вправе в одностороннем порядке вносить изменения в настоящие Правила. Изменения в настоящие Правила вступают в силу по истечении 5 (пяти) дней после дня раскрытия информации об этом в соответствии со статьей 22 Федерального закона «Об организованных торгах», если иной срок вступления в силу не определен Биржей в соответствии с указанным Федеральным законом. Изменения в настоящие Правила, связанные с исключением из них положений третейского соглашения или изменением третейского суда, вступают в силу не ранее

чем через три месяца после дня раскрытия информации об этом в соответствии со статьей 22 Федерального закона «Об организованных торгах».

2.4. Биржа оказывает услуги по проведению Торгов, которые включают в себя:

- предоставление возможности заключения Срочных контрактов в соответствии с требованиями Федерального закона «Об организованных торгах» и принятыми в соответствии с ним нормативными актами;
- обмен информацией и обеспечение взаимодействия с Клиринговой организацией, необходимые для проведения Торгов и исполнения обязательств по заключенным Договорам;
- контроль за выполнением Участниками торгов требований настоящих Правил и иных внутренних документов Биржи, регулирующих порядок оказания услуг по проведению Торгов.

2.5. Биржа проводит Торги, клиринг по итогам которых осуществляется с участием Центрального контрагента в следующих Режимх торгов:

- 1) Режим основных торгов ПФИ;
- 2) Режим безадресных торгов ПФИ;
- 3) Режим торгов RFQ ПФИ;
- 4) Режим переговорных сделок ПФИ.

2.6. Режим основных торгов ПФИ и Режим безадресных торгов ПФИ могут состоять из периода непрерывного аукциона. При проведении Торгов в рамках непрерывного аукциона возможность подачи Заявок и заключения Срочных контрактов существует в течение всего времени проведения периода непрерывного аукциона, с учетом особенностей, установленных настоящими Правилами.

В рамках одного или нескольких Режимов торгов Биржей могут быть установлены один или несколько периодов проведения Торгов. Биржа вправе устанавливать период (периоды) проведения Торгов по одному или нескольким Срочным контрактам, и (или) по одной или нескольким Группам инструментов. При этом может быть установлен период (периоды), в ходе которого допускается объявление только Заявок определенного вида и/или направленности.

2.7. Для целей заключения Срочных контрактов Биржа вправе устанавливать Шаг цены для отдельных Режимов торгов, и (или) отдельных Срочных контрактов.

2.8. Решением Биржи по одному или нескольким Срочным контрактам и (или) Группе инструментов может быть ограничена (возобновлена) возможность их заключения в одном или нескольких Режимх торгов, одной или нескольких торговых сессиях, и (или) в отдельных периодах проведения Торгов.

2.9. Раскрытие информации в Системе проведения торгов и (или) на сайте Биржи в сети Интернет считаются надлежащими способами информирования Участников торгов.

## **Глава II. Допуск к Торгам**

### **Статья 3. Основания и порядок начала, приостановления или прекращения заключения Срочных контрактов**

3.1. Основанием начала, приостановления или прекращения заключения Срочных контрактов на Торгах является соответствующее решение Биржи.

3.2. Решение Биржи о начале заключения Срочных контрактов на Торгах должно содержать дату и условия заключения соответствующих Срочных контрактов и может вступить в силу не ранее вступления в силу Спецификации соответствующего Срочного контракта.

3.3. Срочные контракты допускаются к Торгам в одном или нескольких Режимх торгов по решению Биржи.

3.4. Решение Биржи о приостановлении и возобновлении, а также о прекращении заключения Срочных контрактов на Торгах должно содержать дату соответственно приостановления, возобновления и прекращения заключения Срочных контрактов.

3.5. Информация о решениях, принятых Биржей в соответствии с пунктами 3.2 - 3.4 настоящих Правил, доводятся до сведения Участников торгов посредством опубликования соответствующего сообщения на сайте Биржи в сети Интернет и (или) в Системе проведения торгов. Размещение информации указанными способами является надлежащим уведомлением Участников торгов.

### **Статья 4. Допуск Участников торгов к участию в Торгах**

4.1. Возможность подавать Заявки на Торгах и заключать Срочные контракты предоставляется Участникам торгов. Центральный контрагент вправе подавать Заявки в случаях, предусмотренных в настоящих Правилах.

4.2. Участники торгов в ходе Торгов обязаны соблюдать требования законодательства Российской Федерации, регулирующего порядок проведения организованных торгов, настоящих Правил и Правил клиринга.

4.3. Участники торгов должны добросовестно осуществлять деятельность на Торгах, при этом воздерживаться от действий, влекущих за собой негативные последствия как для других Участников торгов и их Клиентов, так и для Биржи.

4.4. При возникновении конфликтных ситуаций Участники торгов должны предпринимать все возможные действия для разрешения их путём переговоров, не допуская предвзятости, а также публичного распространения сведений, порочащих деловую репутацию партнёров.

4.5. Участник торгов вправе устанавливать лимит доступных денежных средств (лимит на объем обеспечения в денежном эквиваленте), лимит по Срочным контрактам и (или) лимит по объему обязательств по Срочным контрактам. Указанные лимиты (ограничения) могут быть установлены в отношении:

- Краткого кода Клиента, в том числе в отношении краткого кода Маркет-мейкера;
- группы Кратких кодов Клиента;
- Торгово-клирингового счета.

В случае установления лимитов, указанных в настоящем пункте, Участник торгов передаёт Бирже указанную информацию.

Участник торгов вправе передавать Бирже информацию, необходимую для целей использования предоставляемых Клиринговой организацией сервисов.

Биржа вправе передать полученную от Участника торгов информацию Клиринговой организации.

### **Глава III. Маркет-мейкеры**

#### **Статья 5. Требования к Маркет-мейкерам**

5.1. Участник торгов, желающий выполнять обязанности Маркет-мейкера, обязан заключить с Биржей договор об оказании услуг по поддержанию цен, спроса, предложения и (или) объема торгов Срочными контрактами (далее – «договор об оказании услуг по поддержанию цен, спроса, предложения и (или) объема торгов»).

5.2. Договор об оказании услуг по поддержанию цен, спроса, предложения и (или) объема торгов может быть заключен, если лицо, желающее выполнять указанные обязательства, надлежащим образом зарегистрировано в качестве Участника торгов, а также соблюдает требования, предъявляемые к Участникам торгов в соответствии с Правилами допуска.

5.3. Биржа осуществляет контроль за деятельностью Маркет-мейкеров в соответствии с требованиями законодательства Российской Федерации и внутренних документов Биржи.

5.4. При заключении Участником торгов договора об оказании услуг по поддержанию цен, спроса, предложения и (или) объема торгов в указанном договоре указывается Краткий код Клиента (Краткие коды Клиента), в интересах и за счет которого (которых) Участник торгов выполняет обязательства Маркет-мейкера (в случае если Участник торгов выполняет обязательства Маркет-мейкера в интересах и за счет Клиента (Клиентов)), либо Краткий код Участника торгов (в случае если выполнение обязательств Маркет-мейкера осуществляется за счет данного Участника торгов) (далее совместно именуемые - «краткий код Маркет-мейкера»).

#### **Статья 6. Порядок осуществления функций и обязанностей Маркет-мейкеров**

6.1. Маркет-мейкер при исполнении договора об оказании услуг по поддержанию цен, спроса, предложения и (или) объема торгов может заключать Договоры от своего имени и за свой счет либо от своего имени, в интересах и за счет Клиента (Клиентов) Маркет-мейкера.

6.2. Исполнение договора об оказании услуг по поддержанию цен, спроса, предложения и (или) объема торгов осуществляется в соответствии с требованиями настоящих Правил, договора об оказании услуг по поддержанию цен, спроса, предложения и (или) объема торгов и законодательства Российской Федерации.

6.3. В договоре об оказании услуг по поддержанию цен, спроса, предложения и (или) объема торгов устанавливаются требования, в том числе требования к спреду двусторонней котировки, к минимальному объему подаваемых Маркет-мейкером Заявок на покупку (Заявок на продажу), периоду времени, в течение которого Маркет-мейкер обязан подавать соответствующие Заявки, к порядку определения минимальной цены предложения на продажу и (или) максимальной цены предложения на покупку по подаваемым Маркет-мейкером Заявкам на покупку (Заявкам на продажу) соответственно.

6.4. Биржа вправе освободить Маркет-мейкера от исполнения обязательств по договору об оказании услуг по поддержанию цен, спроса, предложения и (или) объема торгов, в том числе в случае достижения Маркет-мейкером максимального объема Договоров, заключенных на основании Заявок на покупку (Заявок на продажу), поданных указанным Маркет-мейкером, или в случае достижения Маркет-мейкером максимального размера нетто-позиций, которые могут возникать в результате заключения Срочных контрактов на основании Заявок на покупку (Заявок на продажу), поданных указанным Маркет-мейкером.

6.5. Биржа вправе осуществлять ежедневный контроль за деятельностью Маркет-мейкеров в ходе Торгового дня на предмет выполнения Маркет-мейкером обязательств, установленных договором об оказании услуг по поддержанию цен, спроса, предложения и (или) объема торгов, в частности по следующим параметрам:

- спрэд двусторонней котировки;
- объем двусторонней котировки;
- период Торгового дня/торговой сессии, в ходе которого Маркет-мейкер выполняет обязательства;
- прочие параметры, установленные договором об оказании услуг по поддержанию цен, спроса, предложения и (или) объема торгов.

6.6. Биржа вправе посредством Системы проведения торгов информировать Маркет-мейкера о текущих обязательствах по каждому Срочному контракту в отдельности, включая, но не ограничиваясь параметрами, перечисленными в пункте 6.5. настоящих Правил, а также о статусе выполнения обязательств в текущий момент и продолжительности выполнения обязательств за Торговый день/торговую сессию по каждому Срочному контракту в долях от общей продолжительности установленного договором об оказании услуг по поддержанию цен, спроса, предложения и (или) объема торгов периода выполнения обязательств.

## **Глава IV. Общие положения о порядке проведения Торгов**

### **Статья 7. Время проведения Торгов**

7.1. Биржа проводит Торги ежедневно. Биржа вправе принять решение об отмене проведения Торгов в одном или нескольких Режимов торгов, в одной или нескольких торговых сессиях, и (или) в одном или нескольких периодах, и (или) Торгов одним или несколькими Срочными контрактами.

7.2. Торговый день состоит из основной торговой сессии и одной или нескольких дополнительных торговых сессий (в случае их проведения).

Основная торговая сессия проводится с 10.00 до 19.00 по московскому времени. Решением Биржи может быть установлено иное время проведения основной торговой сессии, в том числе для отдельных Режимов торгов, для одного или нескольких Срочных контрактов, и (или) для одной или нескольких Групп инструментов.

Период времени, в течение которого проводится дополнительная торговая сессия, не может приходиться на период времени, в течение которого проводится основная торговая сессия.

Биржа вправе устанавливать Торговые дни в отношении одного или нескольких Срочных контрактов, одной или нескольких Групп инструментов, для одного или нескольких Режимов торгов, для одной или нескольких торговых сессий, и (или) для одного или нескольких периодов проведения Торгов.

7.3. Биржа устанавливает время начала и время окончания проведения Торгов или порядок определения указанного времени для каждого Режимов торгов, каждой торговой сессии и каждого периода проведения Торгов. При этом указанное время может различаться для одного или нескольких Срочных контрактов, одной или нескольких Групп инструментов.

7.4. Информация о времени проведения Торгов, об изменении времени проведения Торгов раскрывается в Системе проведения торгов и (или) на сайте Биржи в сети Интернет не позднее Торгового дня, предшествующего Торговому дню, с которого действует установленное время. Положения настоящего пункта не распространяются на случаи продления основной торговой сессии и досрочного прекращения Торгов в соответствии с пунктами 25.6 и 25.11 настоящих Правил.

### **Статья 8. Заявки**

8.1. В случаях, установленных настоящими Правилами, Срочные контракты могут заключаться:

8.1.1. на основании адресных и безадресных Заявок. Заявки, адресованные (информация о которых раскрывается) всем Участникам торгов, признаются безадресными. Все иные Заявки признаются адресными;

8.1.2. на основании анонимных и неанонимных Заявок. В случае если информация, позволяющая идентифицировать Участника торгов, подавшего Заявку, раскрывается в ходе Торгов Участнику торгов, которому адресована Заявка, такая Заявка признается неанонимной. Все иные Заявки признаются анонимными.

8.2. Настоящими Правилами устанавливаются виды Заявок, на основании которых могут заключаться Срочные контракты в отдельных Режимов торгов.

8.3. Все Заявки, указанные в настоящих Правилах, являются Заявками, цена по которым не может быть изменена.

8.4. Биржа вправе ограничить или запретить подачу Заявок (в том числе установить условия, при которых Заявки могут подаваться, и (или) условия, при которых Заявки не могут подаваться). Указанное решение может быть принято в отношении любых Заявок, в том числе:

- Заявок определенного вида и/или направленности; и (или)
- Заявок, подаваемых в одном или нескольких Режимов торгов; и (или)
- Заявок, подаваемых в одной или нескольких торговых сессиях; и (или)
- Заявок, подаваемых в одном или нескольких периодах; и (или)
- Заявок, подаваемых в отношении одной или нескольких Групп инструментов; и (или)
- Заявок, подаваемых в отношении одного или нескольких Срочных контрактов; и (или)
- Заявок, подаваемых одним или несколькими Участниками торгов (в том числе Заявок, подаваемых за счет одного или нескольких Клиентов).

## **Статья 9. Условия и порядок подачи Заявок**

9.1. Заявки на Торгах вправе подавать Участники торгов.

9.2. Биржа осуществляет фиксацию всех подаваемых Заявок с использованием Системы проведения торгов. При фиксации Заявки отражается следующая информация:

- уникальный код Заявки, присвоенный Биржей при ее фиксации (в случае регистрации Заявки в реестре Заявок указанный код совпадает с идентификационным номером Заявки, присвоенным Биржей при ее регистрации);
- дата и время фиксации Заявки;
- статус Заявки (зарегистрирована в реестре Заявок / не зарегистрирована в реестре Заявок);
- причина отказа в регистрации Заявки в реестре Заявок.

9.3. Исполнением Заявки считается заключение на ее основании одного или нескольких Договоров. При этом если Договоры заключены в отношении всего количества Срочных контрактов, указанного в Заявке, она считается исполненной полностью (в полном объеме), в ином случае она считается исполненной частично.

9.4. Участник торгов вправе отозвать Заявку, объявленную на Торгах, в любое время до момента полного исполнения указанной Заявки в порядке, установленном настоящим пунктом (в случае частичного исполнения указанной Заявки она может быть отозвана в неисполненной части), за исключением Заявки, содержащей Инструкцию, предусмотренную подпунктом 14.11.1. настоящих Правил. При этом Договоры, заключенные на основании такой Заявки до ее отзыва, сохраняют силу.

Заявки, содержащие Инструкцию, предусмотренную подпунктом 14.11.1. настоящих Правил, могут быть отозваны после получения Биржей информации о возможности отзыва таких Заявок в соответствии с пунктом 9.5. настоящих Правил.

Отзыв Заявки осуществляется посредством направления Бирже запроса на отзыв Заявки. Запрос на отзыв Заявки передается Бирже посредством Системы проведения торгов, Системы электронного документооборота, по телефону или в бумажной форме.

В случае направления запроса на отзыв Заявки, подписанного Электронной подписью, посредством Системы электронного документооборота, Биржа извещает Участника торгов об отзыве Заявки посредством Системы электронного документооборота.

Для целей передачи запроса на отзыв Заявки по телефону Биржа присваивает Участнику торгов идентификационные коды. Биржа информирует Участника торгов о присвоенных ему идентификационных кодах посредством Системы электронного документооборота. Участник торгов вправе предоставить Бирже заявления об изменении идентификационных кодов. Биржа осуществляет обработку запроса на отзыв Заявки, переданного по телефону, только в том случае если лицо, подавшее указанный запрос, правильно назовет одновременно следующие реквизиты:

- наименование Участника торгов;
- номер договора об оказании услуг по проведению организованных торгов производными финансовыми инструментами;
- Код Участника торгов;
- идентификационный код, присвоенный Участнику торгов, предусмотренный настоящим пунктом.

Биржа вправе осуществлять запись телефонных переговоров Биржи и лица, подавшего запрос на отзыв Заявки, на цифровом носителе. Биржа и Участники торгов подтверждают, что признают указанную запись в качестве доказательства при разрешении спорных ситуаций.

В течение 3 (трех) рабочих дней после передачи Бирже по телефону запроса на отзыв Заявки, Участник торгов обязан представить Бирже указанный запрос посредством Системы электронного документооборота. В случае непредставления Участником торгов запроса на отзыв Заявки, Биржа вправе приостановить Участнику торгов допуск к участию в Торгах до момента предоставления запроса на отзыв Заявки.

Биржа не несет ответственности за убытки, которые могут возникнуть у Участника торгов в случае исполнения Биржей запроса на отзыв Заявок или неисполнения указанного запроса, поданного по телефону, в случае если идентификационные номера Заявок, указанные в запросе на отзыв Заявки, не совпадают с находящимися в Системе проведения торгов, или реквизиты запроса на отзыв Заявки некорректны.

Участник торгов самостоятельно обеспечивает защиту от несанкционированного доступа к информации об идентификационных кодах и несет ответственность в случае ее разглашения.

9.5. Биржа в порядке, установленном договором с Клиринговой организацией и Правилами клиринга, уведомляет Клиринговую организацию о подаче Заявки.

При подаче Заявки Биржа направляет в Клиринговую организацию информацию о поданной Заявке. Клиринговая организация в порядке и в сроки, определённые договором с Биржей и Правилами клиринга, осуществляет проверку возможности объявления Заявки, о подаче которой она была уведомлена Биржей.

Клиринговая организация по результатам проведения процедуры проверки возможности объявления Заявки в соответствии с Правилами клиринга извещает Биржу о возможности объявления Заявки или о невозможности объявления Заявки. В случае получения Биржей информации о невозможности объявления Заявки данная Заявка не подлежит регистрации в реестре Заявок.

В случае отзыва Объявленной Заявки, за исключением Заявок, содержащих Инструкцию, предусмотренную подпунктом 14.11.1. настоящих Правил, или аннулирования Объявленной Заявки в соответствии с пунктом 9.13. настоящих Правил, Биржа уведомляет Клиринговую организацию о факте отзыва Объявленной Заявки или аннулирования Объявленной Заявки в порядке, установленном договором с Клиринговой организацией и Правилами клиринга.

Биржа уведомляет Рутингового агента о подаче запроса на отзыв Заявок, содержащих Инструкцию, предусмотренную подпунктом 14.11.1. настоящих Правил, в порядке, установленном договором с Клиринговой организацией, Правилами клиринга и (или) договором с Рутинговым агентом.

Рутинговый агент в порядке и в сроки, определённые Правилами клиринга и (или) договором с Биржей, осуществляет проверку возможности отзыва Заявок, содержащих Инструкцию, предусмотренную подпунктом 14.11.1. настоящих Правил.

Рутинговый агент по результатам проведения процедуры проверки возможности отзыва Заявок, содержащих Инструкцию, предусмотренную подпунктом 14.11.1. настоящих Правил, в соответствии с Правилами клиринга и (или) договором с Биржей извещает Биржу о возможности отзыва Заявок, содержащих Инструкцию, предусмотренную подпунктом 14.11.1. настоящих Правил, или о невозможности отзыва таких Заявок. В случае получения Биржей информации о невозможности отзыва Заявок, содержащих Инструкцию, предусмотренную подпунктом 14.11.1. настоящих Правил, указанные Заявки не могут быть отозваны. В случае получения Биржей информации о возможности отзыва Заявок, содержащих Инструкцию, предусмотренную подпунктом 14.11.1. настоящих Правил, Биржа информирует Рутингового агента о факте отзыва Заявок, содержащих Инструкцию, предусмотренную подпунктом 14.11.1. настоящих Правил.

9.6. Биржа вправе отказать в регистрации Заявок в реестре Заявок, если Клиенту или Участнику торгов запрещено совершение операций со Срочными контрактами, которые указаны в Поданных Заявках.

В случаях, установленных законодательством Российской Федерации и настоящими Правилами Биржей может быть установлено ограничение на возможность заключения Срочных контрактов определёнными категориями Участников торгов и (или) за счет определенных категорий Клиентов, а также на возможность заключения Участниками торгов Срочных контрактов за счет своих Клиентов и (или) за счет средств, находящихся в доверительном управлении.

9.7. Заявка не регистрируется в реестре Заявок в случае, если:

- Заявка не соответствует требованиям настоящих Правил; и (или)
- Клиринговой организацией не подтверждена возможность регистрации указанной Заявки в реестре Заявок в соответствии с Правилами клиринга; и (или)
- Клиринговая организация уведомила Биржу о нарушении Участником торгов, являющимся Участником клиринга, Маржинального требования (как оно определено Правилами клиринга) и Биржей не получено уведомление Клиринговой организации об исполнении указанного Маржинального требования; и (или)
- подача Заявок нарушает установленные Биржей ограничение или запрет на подачу Заявок; и (или)
- Заявка подана с нарушением документов технического центра, определенного Биржей, информация о котором раскрыта на сайте Биржи в сети Интернет; и (или)
- Заявка, подана Участником торгов от своего имени и за счет Клиента, который не был зарегистрирован Биржей в порядке, установленном Правилами допуска; и (или)

- Заявка, подана с нарушением настоящих Правил и (или) решений Биржи, принятых в соответствии с настоящими Правилами.

9.8. Заявка считается объявленной с момента ее регистрации в реестре Заявок.

9.9. В Режиме основных торгов ПФИ, в Режиме безадресных торгов ПФИ Объявленные Заявки образуют Очередь заявок. При постановке Заявки в Очередь заявок ее место в Очереди заявок определяется ценой, указанной в Заявке.

Первой в Очереди заявок находится лучшая Заявка. Под лучшей Заявкой на покупку понимается Заявка с наибольшей ценой, под лучшей Заявкой на продажу понимается Заявка с наименьшей ценой.

Если иное не установлено положениями настоящих Правил место Заявок с равной ценой в Очереди заявок определяется временем регистрации в реестре Заявок (первыми в Очереди заявок находятся Заявки, раньше зарегистрированные в реестре Заявок).

В Режиме основных торгов ПФИ Заявки с одинаковыми ценами распределяются в Очереди заявок с учётом особенностей, установленных статьей 15 настоящих Правил.

В Режиме безадресных торгов ПФИ Заявки с одинаковыми ценами распределяются в Очереди заявок с учётом особенностей, установленных статьей 18 настоящих Правил.

9.10. Подача Заявок в Систему проведения торгов осуществляется путем направления в Систему проведения торгов электронных сообщений, подписанных АСП. Заявки, подписанные АСП, полученным Участником торгов на основании договора (соглашения), заключенного между Участником торгов и техническим центром, определенным Биржей, информация о котором раскрыта на сайте Биржи в сети Интернет, считаются поданными данным Участником торгов. Порядок использования АСП предусмотрен в Приложении № 1 к настоящим Правилам.

Подача Заявок в Систему проведения торгов может также осуществляться путем направления Электронного документа, подписанного Электронной подписью, посредством Системы электронного документооборота. Заявки, подписанные Электронной подписью уполномоченного лица Участника торгов, считаются поданными от имени Участника торгов. В этом случае Биржа извещает Участника торгов о регистрации Заявки посредством Системы электронного документооборота.

Доступ к Системе электронного документооборота может быть предоставлен на основании договора, заключенного с Биржей и (или) техническим центром, определенным Биржей, информация о котором раскрыта на сайте Биржи в сети Интернет. Порядок использования Электронной подписи определяется договором (соглашением), заключённым, в том числе Участником торгов, Биржей с техническим центром, определённым Биржей, информация о котором раскрыта на сайте Бирже в сети Интернет.

9.11. Заявки, поданные с нарушением настоящих Правил, в том числе в результате сбоев и (или) ошибок программно-технических средств, сбоев в работе информационно-коммуникационных средств связи, с помощью которых обеспечивается проведение организованных торгов, могут быть зарегистрированы в реестре Заявок. Указанные Заявки и заключённые на их основании Договоры сохраняют силу, если иное не предусмотрено решением Биржи.

9.12. Безадресные Заявки, поданные Участником торгов за счет одного и того же лица (в соответствии с кодом этого лица), не являются основанием для заключения Договоров.

9.13. Биржа вправе аннулировать Заявки, зарегистрированные в реестре Заявок. Аннулирование Биржей Заявок осуществляется в случаях, указанных в настоящих Правилах.

Аннулирование Биржей Заявки осуществляется путем исключения информации об указанной Заявке из Системы проведения торгов. Аннулирование Биржей Заявки не влечёт удаление информации об аннулированной Заявке из реестра Заявок.

Биржа аннулирует Заявки в случае получения уведомления от Клирингового центра о нарушении Участником торгов, являющимся Участником клиринга, Маржинального требования (как оно определено Правилами клиринга).

9.14. Биржа вправе устанавливать ограничения цен (ценовой коридор) или порядок их определения в ходе Торгов, по которым Участником торгов может быть подана Заявка и (или) заключен Срочный контракт. В соответствии с решением Биржи Заявка, в которой указана цена, выходящая за пределы ценового коридора, не может быть объявлена, и (или) на основании такой Заявки не может быть заключен Срочный контракт, условием которого является цена, выходящая за пределы ценового коридора.

## **Статья 10. Реестр Заявок**

10.1. Биржа осуществляет ведение реестра Заявок.

10.2. Реестр Заявок включает в себя следующие сведения:

- идентификационный номер Заявки, присвоенный Биржей при ее регистрации в реестре Заявок;

- уникальный код Заявки, присвоенный Биржей при ее фиксации (совпадает с ее идентификационным номером);
- Режим торгов, в котором подана Заявка;
- Код Участника торгов, подавшего Заявку;
- Краткий код Участника торгов, подавшего Заявку;
- Идентификатор Участника торгов, подавшего Заявку;
- Идентификатор адресных сделок, присвоенный Участнику торгов, которому адресована Заявка (для Заявок, подаваемых в Режиме переговорных сделок ПФИ);
- Идентификатор адресных сделок, присвоенный Участнику торгов, подавшему Заявку (для Заявок, подаваемых в Режиме переговорных сделок ПФИ);
- указание на то, что Заявка подана во исполнение обязательств Маркет-мейкера, если такая Заявка подана во исполнение указанных обязательств;
- Код (Коды) Клиента (Клиентов), за счет которого (которых) подана Заявка;
- Краткий код Клиента (в случае если Участник торгов действует за счет Клиента);
- Идентификационный код Срочного контракта;
- код (обозначение) Срочного контракта;
- вид Заявки;
- направленность Заявки (Заявка на покупку или Заявка на продажу – для Заявок на покупку/Заявок на продажу);
- указанную в Заявке цену одного Срочного контракта (в отношении Заявки на покупку/Заявки на продажу);
- указание на валюту, в которой выражается цена Срочного контракта (далее – валюта цены);
- указание на валюту, в которой производятся денежные расчеты по Срочному контракту (далее – валюта расчетов);
- количество Срочных контрактов, выраженное в Торговых лотах, в отношении которого подана Заявка, а в случае если Заявка исполнена частично, дополнительно указывается количество Срочных контрактов, выраженное в Торговых лотах, составляющее неисполненную часть Заявки (количество Срочных контрактов, в отношении которых подана Заявка для каждого Клиента, если Заявка подана за счет нескольких Клиентов);
- количество Срочных контрактов, содержащееся в Торговых лотах, в отношении которого подана Заявка, выраженное в штуках, а в случае если Заявка исполнена частично, указывается количество Срочных контрактов, выраженное в штуках, составляющее неисполненную часть Заявки (количество Срочных контрактов, в отношении которых подана Заявка для каждого Клиента, если Заявка подана за счет нескольких Клиентов);
- дату и время регистрации Заявки в реестре Заявок;
- дату и время исполнения (отзыва, аннулирования) Заявки;
- результат подачи Заявки (на исполнении, исполнена частично, исполнена, отозвана, аннулирована и тому подобное);
- причина аннулирования Заявки.

10.3. Реестр Заявок может содержать иные сведения, предусмотренные Биржей.

10.4. Биржа ведет реестр Поданных Заявок и реестр Заявок в электронной форме.

10.5. Биржа представляет Участникам торгов выписки из реестра Заявок и данные о поданных Заявках, информация о которых зафиксирована в соответствии с пунктом 9.2. настоящих Правил, на основании заявления Участника Торгов, в срок не позднее одного месяца с даты получения соответствующего заявления. Биржа вправе взимать плату за предоставление указанных выписок в случаях, предусмотренных законодательством Российской Федерации.

## **Статья 11. Порядок заключения и исполнения Договоров**

11.1. Договор на Торгах заключается на основании двух Объявленных разнонаправленных Заявок, полное или частичное соответствие которых друг другу установлено и зафиксировано в реестре Договоров Биржей в порядке, определенном настоящими Правилами, за исключением случаев, предусмотренных пунктом 11.4 настоящих Правил.

При этом разнонаправленными Заявками являются Заявки, содержащие встречные по отношению друг к другу волеизъявления на заключение Договора, а именно разнонаправленными Заявками являются Заявка на покупку и Заявка на продажу.

Договор на Торгах может заключаться на основании Заявки, содержащей Инструкцию, предусмотренную подпунктом 14.11.1. настоящих Правил, и на основании являющейся встречной по отношению к такой Заявке - Заявки дополнительной ликвидности. Такой Договор считается заключенным в момент объявления встречной Заявки дополнительной ликвидности.

11.2. Соответствие Объявленных Заявок друг другу устанавливается по следующим признакам: две разнонаправленные Заявки соответствуют друг другу в случае, если они являются встречными. Если иное не предусмотрено настоящими Правилами, в целях заключения Договоров

две разнонаправленные Заявки считаются встречными при условии совпадения следующих сведений, содержащихся в указанных Заявках:

11.2.1. Идентификационного кода Срочного контракта;

11.2.2. Режима торгов, в котором поданы Заявки.

Настоящими Правилами могут быть предусмотрены иные и (или) дополнительные условия, при которых Заявки являются встречными.

11.3. Договоры заключаются между Центральным контрагентом и каждым из Участников торгов, соответствие объявленных которыми друг другу разнонаправленных Заявок установлено Биржей, за исключением случаев, предусмотренных пунктом 11.4 настоящих Правил. При этом подача Заявки Центральным контрагентом не требуется, а каждый из указанных Договоров считается заключенным в момент фиксации Биржей соответствия Заявок, поданных Участниками торгов, путем внесения в реестр Договоров записи о заключении Договоров с Центральным контрагентом.

Центральный контрагент вправе заключать Договоры на Торгах на основании Заявок, подаваемых Центральным контрагентом. В этом случае Договор считается заключенным в момент фиксации Биржей соответствия разнонаправленных Заявок друг другу путем внесения в реестр Договоров записи о заключении соответствующего Договора.

В случаях, предусмотренных настоящим пунктом, составление одного документа, подписанного сторонами, не осуществляется, и простая письменная форма Договора считается соблюденной.

11.4. В Режиме переговорных сделок ПФИ Договоры с участием Центрального контрагента могут заключаться без подачи Заявок.

Без подачи Заявок в соответствии с Правилами клиринга могут заключаться Договоры в момент получения Биржей от Центрального контрагента информации о необходимости в соответствии с Правилами клиринга заключения указанных Договоров без подачи Заявок и информации об условиях таких Договоров, путем внесения в реестр Договоров записей о заключении указанных Договоров. При этом составление одного документа, подписанного сторонами, не осуществляется, и простая письменная форма Договора считается соблюденной.

В Режиме основных торгов Договоры между Центральным контрагентом и Участниками торгов, если Центральный контрагент или один из Участников торгов является Рутинговым агентом, могут заключаться на основании одной Заявки, поданной Участником торгов, не являющимся Рутинговым агентом. Указанные Договоры считаются заключенными в момент внесения в реестр Договоров записи об их заключении. При этом составление одного документа, подписанного сторонами, не осуществляется, и простая письменная форма Договора считается соблюденной.

11.5. Условия Срочных контрактов и порядок их заключения и исполнения содержатся в Заявках, Спецификациях, настоящих Правилах и (или) Правилах клиринга либо определяются в соответствии с указанными документами.

11.6. В случае если Договоры, заключенные с нарушением настоящих Правил, в том числе в результате сбоев и (или) ошибок программно-технических средств, сбоев в работе информационно-коммуникационных средств связи, с помощью которых обеспечивается проведение Торгов, зарегистрированы в реестре Договоров, такие Договоры сохраняют силу, если иное не предусмотрено решением Биржи.

11.7. Заключение Договора подтверждается выпиской из реестра Договоров.

11.8. Центральный контрагент в случаях, указанных в Правилах клиринга, вправе заключать Договоры от имени Участника клиринга в отношении себя лично без специального полномочия (доверенности), а также без согласия данного Участника торгов.

11.9. Для целей заключения Договоров решением Биржи могут быть сформированы Группы инструментов. Соответствующее решение раскрывается на сайте Биржи в сети Интернет не позднее Торгового дня, предшествующего Торговому дню, с которого действуют сформированные Группы инструментов.

11.10. Валюта цены Срочных контрактов, выражается в российских рублях или иностранной валюте.

Для целей заключения Срочных контрактов Биржа вправе устанавливать:

- перечни допустимых валют цены;
- перечни допустимых валют расчетов.

Биржа раскрывает информацию об установленных Биржей перечнях допустимых валют цены и допустимых валют расчетов на сайте Биржи в сети Интернет не позднее Торгового дня, предшествующего Торговому дню, с которого действуют установленные перечни.

В случае если Биржей установлены разные валюта цены и валюта расчетов в отношении одного Срочного контракта и (или) одной Группы инструментов, порядок определения курсов валют, используемых для определения и исполнения обязательств, возникших из Договоров, устанавливается Биржей.

## **Статья 12. Ведение реестра Договоров**

12.1. Биржа осуществляет ведение реестра Договоров.

12.2. Реестр Договоров включает в себя следующие сведения:

- стандартные условия Договоров (за исключением цены);
- идентификационные номера Заявок, на основании которых заключен Договор;
- идентификационный номер Договора;
- Режим торгов, в котором заключён Договор;
- Код Участника торгов, подавшего Заявку, на основании которой заключен Договор (в случае заключения Договора с участием Центрального контрагента - Код Участника торгов, заключившего Договор, и указание на то, что Договор заключен с участием Центрального контрагента);
- Краткий код Участника торгов, подавшего Заявку, на основании которой заключен Договор;
- Идентификатор Участника торгов, подавшего Заявку, на основании которой заключен Договор;
- Идентификатор адресных сделок Участника торгов, которому адресована Заявка (для Режимы переговорных сделок ПФИ);
- Идентификатор адресных сделок Участника торгов, подавшего Заявку (для Режимы переговорных сделок ПФИ);
- указание на то, что Договор заключен на основании Заявки, поданной во исполнение обязательств Маркет-мейкера, если Договор заключен на основании такой Заявки;
- Код (Коды) Клиента (Клиентов), за счет которого (которых) подана Заявка;
- Краткий код Клиента (в случае если Участник торгов действует за счет Клиента);
- дату и время регистрации Договора в реестре Договоров;
- Идентификационный код Срочного контракта;
- код (обозначение) Срочного контракта;
- цену Срочного контракта;
- Дату экспирации;
- валюту цены;
- валюту расчетов;
- количество Срочных контрактов, выраженное в Торговых лотах, в том числе количество Срочных контрактов для каждого Клиента, если Договор заключен за счет нескольких Клиентов;
- количество Срочных контрактов, содержащееся в Торговых лотах, в отношении которого подана Заявка, выраженное в штуках, в том числе количество Срочных контрактов для каждого Клиента, если Договор заключен за счет нескольких Клиентов;
- указание на Торгово-клиринговый счет;
- сумму Договора (указывается в валюте расчетов).

12.3. Реестр Договоров может содержать иные сведения, предусмотренные Биржей.

12.4. Биржа ведет реестр Договоров в электронной форме.

12.5. Биржа предоставляет Участникам торгов выписки из реестра Договоров.

Выписки из реестра Договоров, содержащие информацию о Договорах, заключённых Участником торгов на Торгах в течение текущего Торгового дня, предоставляются указанному Участнику торгов в порядке, указанном в статье 27 настоящих Правил, и в сроки, установленные законодательством Российской Федерации и нормативными актами Банка России.

Выписки из реестра Договоров, содержащие информацию о Договорах, заключённых Участниками торгов в течение иного периода времени, предоставляются Биржей в порядке и сроки, предусмотренные законодательством Российской Федерации и нормативными актами Банка России.

В случаях аннулирования (отзыва) всех имеющихся у Участника торгов лицензий на осуществление деятельности на финансовом рынке и (или) введения в отношении такого Участника торгов одной из процедур банкротства Биржа в течение месяца с даты получения заявления от физического или юридического лица, являющегося (являвшегося) Клиентом такого Участника торгов, предоставляет выписку из реестра Договоров о Договорах, заключённых в интересах этого лица за период, не превышающий пяти лет со дня получения указанного заявления, при условии, что такое заявление подано не позднее пяти лет со дня аннулирования (отзыва) всех имеющихся у такого Участника торгов лицензий на осуществление деятельности на финансовом рынке и (или) введения в отношении такого Участника торгов одной из процедур банкротства, и предоставления документов в соответствии с определенным Биржей перечнем, раскрываемым на сайте Биржи в сети Интернет.

Биржа вправе взимать плату за предоставление выписок из реестра Договоров в случаях, предусмотренных законодательством Российской Федерации и нормативными актами Банка России. Плата за предоставление выписок из реестра Договоров, указанных в четвертом абзаце

настоящего пункта, взимается Биржей при условии раскрытия сведений о порядке, условиях и размере такой платы на сайте Биржи в сети Интернет.

### **Статья 13. Порядок взаимодействия Биржи и Клиринговой организации**

13.1. Исполнение обязательств из Срочных контрактов, заключенных на Торгах, осуществляется на основании информации, передаваемой Биржей Клиринговой организации. Дополнительного оформления, подтверждения или сверки заключенных Срочных контрактов Участниками торгов или Клиентами не требуется.

13.2. Взаимодействие между Биржей и Клиринговой организацией осуществляется на основании заключенного между ними договора, а также в соответствии с настоящими Правилами и Правилами клиринга.

13.3. Клиринговая организация передает Бирже информацию, предусмотренную Правилами клиринга и договором, заключенным между Биржей и Клиринговой организацией.

13.4. Клиринговая организация в случаях, установленных Правилами клиринга, вправе направить Бирже уведомление о необходимости приостановления / прекращения допуска Участника торгов к участию в Торгах.

13.5. В случаях приостановки или прекращения Торгов, предусмотренных настоящими Правилами, Биржа обязана уведомить об этом Клиринговую организацию.

13.6. В случае неисполнения Договора Участником клиринга Клиринговая организация уведомляет об этом Биржу путем направления уведомления о неисполнении обязательств по Договору.

13.7. Клиринговая организация для целей подачи Заявок, заключения и обеспечения исполнения Договоров рассчитывает риск-параметры, в соответствии с порядком, установленным Правилами клиринга. Клиринговая организация с использованием Системы проведения торгов каждый Торговый день до начала Торгов передает Бирже информацию об установленных риск-параметрах, включая, но не ограничиваясь этим, информацию о расчетной цене Срочного контракта, а также о верхнем и нижнем лимитах колебаний цены ценной бумаги, являющейся Базисным активом Срочного контракта, или Срочного контракта (если применимо).

## **Глава V. Проведение Торгов в Режиме основных торгов ПФИ**

### **Статья 14. Порядок подачи Заявок в периоде непрерывного аукциона**

14.1. В Режиме основных торгов ПФИ в периоде непрерывного аукциона могут подаваться Заявки на покупку и Заявки на продажу.

14.2. В Режиме основных торгов ПФИ в периоде непрерывного аукциона могут быть поданы следующие виды Заявок:

- 14.2.1. Лимитные Заявки;
- 14.2.2. Рыночные Заявки;
- 14.2.3. Заявки дополнительной ликвидности.

14.3. Под Лимитной Заявкой понимается Заявка на покупку или Заявка на продажу, обладающая в совокупности следующими признаками:

- Заявка является безадресной;
- Заявка является анонимной;
- Заявка содержит цену за один Срочный контракт;
- Заявка предусматривает заключение Договора по цене, указанной в Заявке, или по лучшей цене.

Лимитные Заявки вправе подавать все Участники торгов.

Виды Лимитных Заявок, которые могут подаваться в Режиме основных торгов ПФИ, указаны в пункте 14.6. настоящих Правил.

14.4. Под Рыночной Заявкой понимается Заявка на покупку или Заявка на продажу, обладающая в совокупности следующими признаками:

- Заявка является безадресной;
- Заявка является анонимной;
- Заявка не содержит цену за один Срочный контракт;
- Заявка предусматривает заключение Договора по лучшей цене, доступной в момент объявления Заявки, и (или) по цене, указанной во встречной по отношению к ней Заявке дополнительной ликвидности;
- Заявка допускает частичное исполнение;
- Заявка действует до момента ее полного или частичного исполнения или до момента ее аннулирования Биржей, в том числе в связи с получением Биржей уведомления о неподаче Заявки дополнительной ликвидности в соответствии с пунктом 14.15. настоящих Правил.

Рыночные Заявки вправе подавать все Участники торгов.

14.5. Под Заявкой дополнительной ликвидности понимается Заявка на покупку или Заявка на продажу, обладающая в совокупности следующими признаками:

- Заявка является адресной. При этом информация о ней не раскрывается Участникам торгов в Очереди заявок;
- Заявка является анонимной;
- Заявка содержит указание на идентификационный номер встречной Лимитной заявки или Рыночной заявки;
- Заявка содержит цену за один Срочный контракт;
- Заявка допускает частичное исполнение;
- Заявка подлежит немедленному исполнению в момент ее объявления, а в случае полного или частичного неисполнения в указанный момент времени немедленно аннулируется Биржей.

Заявки дополнительной ликвидности вправе подавать только Рутинговый агент.

14.6. В Режиме основных торгов ПФИ в периоде непрерывного аукциона допускается подача следующих видов Лимитных Заявок:

14.6.1. Лимитная Заявка, действующая до конца Торгового дня:

- действует до момента, определенного Биржей в течение Торгового дня, в рамках которого объявлена указанная Лимитная Заявка, и по факту наступления которого подлежит аннулированию Биржей;
- может быть аннулирована Биржей в любой момент времени до окончания Торгового дня, в течение которого объявлена указанная Заявка, в связи с получением Биржей уведомления о неподаче Заявки дополнительной ликвидности в соответствии с пунктом 14.15. настоящих Правил;

- допускает частичное исполнение. В случае полного или частичного неисполнения Обрабатываемой Лимитной Заявки она подлежит выставлению в Очередь заявок в неисполненной части.

14.6.2. Лимитная Заявка, действующая до определённого времени в течение Торгового дня:

- действует до момента аннулирования Биржей, производимого в течение периода времени, начало и окончание которого устанавливается решением Биржи, в рамках Торгового дня, в течение которого объявлена указанная Лимитная Заявка.

- может быть аннулирована Биржей в любой момент времени в связи с получением Биржей уведомления о неподаче Заявки дополнительной ликвидности в соответствии с пунктом 14.15. настоящих Правил;

- допускает частичное исполнение. В случае полного или частичного неисполнения Обрабатываемой Лимитной Заявки она подлежит выставлению в Очередь заявок в неисполненной части.

14.6.3. Лимитная Заявка, не допускающая частичного исполнения:

- не допускает частичного исполнения. В случае неисполнения Обрабатываемой Лимитной Заявки в полном объеме она подлежит выставлению в Очередь заявок в полном объеме или немедленному аннулированию Биржей;

- действует до момента ее исполнения в полном объеме или до момента ее аннулирования Биржей, в том числе в связи с получением Биржей уведомления о неподаче Заявки дополнительной ликвидности в соответствии с пунктом 14.15. настоящих Правил.

14.6.4. Лимитная Заявка, допускающая частичное исполнение:

- допускает частичное исполнение. В случае полного или частичного неисполнения Обрабатываемой Лимитной Заявки она подлежит выставлению в Очередь заявок или немедленному аннулированию Биржей в неисполненной части;

- действует до момента ее полного или частичного исполнения или до момента ее аннулирования Биржей, в том числе в связи с получением Биржей уведомления о неподаче Заявки дополнительной ликвидности в соответствии с пунктом 14.15. настоящих Правил.

14.7. Для целей исполнения Заявок, указанных в пункте 14.2. настоящих Правил, лучшей ценой, содержащейся в Заявках на продажу, считается наименьшая цена, а лучшей ценой, содержащейся в Заявках на покупку – наибольшая цена.

14.8. При подаче Заявки в Систему проведения торгов Заявка на покупку и Заявка на продажу должны содержать:

- указание на Код Участника торгов, подавшего Заявку;
- указание на Краткий код (коды) Клиента (Клиентов), за счет которого (которых) подана Заявка (в случае если Участник торгов действует за счет Клиентов);
- указание на Идентификатор Участника торгов, подавшего Заявку;
- указание на вид Заявки;
- указание на направленность Заявки (Заявка на покупку или Заявка на продажу);
- указание на Идентификационный код Срочного контракта;
- количество Срочных контрактов, выраженное в Торговых лотах;

- указание на Торгово-клиринговый счет;
- цену за один Срочный контракт (указывается, если видом Заявки предусмотрено указание цены);

- указание на Режим торгов, в котором подается Заявка;
- указание на валюту цены;
- указание на валюту расчетов;
- иные сведения в случаях, предусмотренных настоящими Правилами.

14.9. Лимитная Заявка и Рыночная Заявка могут содержать признак, указывающий на то, что она подана Участником торгов при исполнении им обязательств Маркет-мейкера. Указание данного признака возможно только при условии, что Участником торгов, подающим Заявку, заключен договор об исполнении обязательств Маркет-мейкера, и только при условии указания в данной Заявке краткого кода Маркет-мейкера и признака, предусмотренного подпунктом 14.11.2. настоящих Правил.

14.10. Заявка может содержать признак, указывающий на то, что встречными по отношению к ней не могут являться Заявки, поданные при исполнении обязательств Маркет-мейкера.

Предусмотренный настоящим пунктом признак может содержаться:

- в Лимитной Заявке, если она содержит признак, предусмотренный подпунктом 14.11.2. настоящих Правил, и указание на краткий код Маркет-мейкера;
- в Рыночной Заявке, если она содержит признак, предусмотренный подпунктом 14.11.2. настоящих Правил, и указание на краткий код Маркет-мейкера.

14.11. Лимитная Заявка и Рыночная заявка должны содержать один из следующих признаков, определяющих то, какая Заявка может являться встречной по отношению к указанной Лимитной Заявке и Рыночной Заявке (далее - Инструкция):

14.11.1. Сводить только с Заявками дополнительной ликвидности.

Данная Инструкция означает, что встречными по отношению к содержащей такую Инструкцию Лимитной Заявке или Рыночной Заявке могут являться только Заявки дополнительной ликвидности.

14.11.2. Не сводить с Заявками дополнительной ликвидности.

Данная Инструкция означает, что встречными по отношению к содержащей такую Инструкцию Лимитной Заявке или Рыночной Заявке не могут являться Заявки дополнительной ликвидности.

14.12. Биржа вправе запретить указание в Заявках определенных Инструкций. Такое решение может распространяться на один или несколько Режимов торгов, на один или несколько периодов проведения Торгов, на одну или несколько торговых сессий, на один или несколько Срочных контрактов и (или) на одну или нескольких Групп инструментов.

14.13. В рамках Режима основных торгов ПФИ могут быть установлены следующие периоды проведения Торгов:

14.13.1. Период стандартной дополнительной ликвидности.

В течение указанного периода могут подаваться Заявки, указанные в пункте 14.2. настоящих Правил.

14.13.2. Период без дополнительной ликвидности.

В течение указанного периода могут подаваться Заявки, указанные в подпунктах 14.2.1. – 14.2.2.

14.13.3. Период с дополнительной ликвидностью.

В течение указанного периода могут подаваться только Заявки дополнительной ликвидности.

14.13.4. В отношении одного или нескольких периодов проведения Торгов, указанных в подпунктах 14.13.1 - 14.13.3 настоящих Правил, или части соответствующего периода, по одному или нескольким Срочным контрактам и (или) по одной или нескольким Группам инструментов Биржа вправе дополнительно установить одно или несколько из указанных правил:

1) не допускается подача Лимитной Заявки на продажу или Рыночной Заявки на продажу, если сумма учитываемых на Торгово-клиринговом счете, указанном в такой Заявке, количества Срочных контрактов и объема обязательств по Срочным контрактам (с учетом знака), выраженного в штуках, за вычетом, если иное не установлено решением Биржи, количества Срочных контрактов, содержащегося суммарно в Заявках на продажу, находящихся в Очереди заявок, меньше количества Срочных контрактов, указанного в такой Заявке;

2) Лимитная заявка, в которой количество Срочных контрактов, умноженное на цену Срочного контракта, указанных в такой Заявке, больше размера, установленного решением Биржи, считается соответственно Лимитной Заявкой, содержащей Инструкцию, предусмотренную подпунктом 14.11.1 настоящих Правил;

3) Рыночная заявка, содержащая одну из Инструкций, предусмотренную пунктом 14.11. настоящих Правил, считается соответственно Рыночной Заявкой, содержащей Инструкцию, предусмотренную подпунктом 14.11.1 настоящих Правил.

14.13.5. Правила, предусмотренные подпунктом 14.13.4 настоящих Правил, могут различаться по различным Срочным контрактам.

14.13.6. В случае установления правила, предусмотренного подпунктом 14.13.4 настоящих Правил, Биржа вправе установить период его действия.

14.14. Ни один период проведения торгов, предусмотренный подпунктами 14.13.1. - 14.13.3. настоящих Правил, не может приходиться на другой период проведения Торгов, предусмотренный указанными подпунктами.

14.15. В случае если в Обрабатываемой Рыночной Заявке или Обрабатываемой Лимитной Заявке, указанной в подпункте 14.6.4. настоящих Правил, содержится Инструкция, предусмотренная подпунктом 14.11.2. настоящих Правил, и встречными по отношению к полному объему или части объема указанной Заявки являются Лимитные Заявки, то данная Обрабатываемая Заявка, в случае ее полного или частичного неисполнения, подлежит аннулированию Биржей. Указанная Обрабатываемая Заявка не подлежит выставлению в Очередь заявок.

В случае если в Обрабатываемой Лимитной Заявке, указанной в подпункте 14.6.3. настоящих Правил, содержится Инструкция, предусмотренная подпунктом 14.11.2. настоящих Правил, и встречными по отношению к указанной Заявке являются Лимитные Заявки, то данная Обрабатываемая Заявка, в случае ее неисполнения в полном объеме, подлежит аннулированию Биржей. Указанная Обрабатываемая Заявка не подлежит выставлению в Очередь заявок.

При наличии в Очереди заявок Рыночных Заявок или Лимитных Заявок, которые указаны в подпункте 14.6.4. настоящих Правил, содержат Инструкцию, предусмотренную подпунктом 14.11.1. настоящих Правил, являются встречными по отношению к Заявкам дополнительной ликвидности, Рутинговый агент обязуется подать встречные Заявки дополнительной ликвидности и/или предоставить Бирже уведомление о неподаче Заявок дополнительной ликвидности в отношении неисполненной части указанных Заявок. В случае получения Биржей уведомления о неподаче Заявок дополнительной ликвидности, вышеуказанные Рыночные Заявки или Лимитные Заявки немедленно аннулируются Биржей в полном объеме или в неисполненной части после получения Биржей указанного уведомления.

При наличии в Очереди заявок Лимитной Заявки, которая указана в подпункте 14.6.3. настоящих Правил и содержит Инструкцию, предусмотренную подпунктом 14.11.1. настоящих Правил, и является встречной по отношению к Заявкам дополнительной ликвидности, Рутинговый агент обязуется подать встречные Заявки дополнительной ликвидности с суммарным количеством Срочных контрактов, которое не меньше количества Срочных контрактов, указанного в Лимитной заявке, или предоставить Бирже уведомление о неподаче Заявок дополнительной ликвидности в полном объеме Лимитной Заявки. В случае получения Биржей уведомления о неподаче Заявок дополнительной ликвидности, вышеуказанная Лимитная Заявка немедленно аннулируется Биржей в полном объеме после получения Биржей указанного уведомления.

При наличии в Очереди Заявок Лимитной Заявки, которая указана в подпункте 14.6.1. или подпункте 14.6.2. настоящих Правил, содержит Инструкцию, предусмотренную подпунктом 14.11.1. настоящих Правил, и является встречной по отношению к Заявкам дополнительной ликвидности, Рутинговый агент вправе уведомить Биржу о неподаче Заявок дополнительной ликвидности в отношении неисполненной части указанной Лимитной Заявки. В случае получения Биржей уведомления о неподаче Заявок дополнительной ликвидности, вышеуказанная Лимитная Заявка немедленно аннулируется Биржей в полном объеме или в неисполненной части после получения Биржей указанного уведомления.

Уведомление о неподаче Заявки дополнительной ликвидности передаётся Бирже посредством Системы проведения торгов.

Уведомление о неподаче Заявки дополнительной ликвидности должно содержать идентификационный номер Заявки, в отношении которой оно составлено.

14.16. Две разнонаправленные Заявки являются встречными при наличии оснований для определения встречности Заявок, предусмотренных пунктами 14.11., 14.13., 14.15. настоящих Правил, а также при соблюдении следующих условий:

14.16.1. Лимитная Заявка одной направленности и Лимитная Заявка противоположной направленности являются встречными при условии, что:

- у таких разнонаправленных Заявок совпадают признаки, указанные в пункте 11.2. настоящих Правил;

- цена, указанная в Заявке на покупку, не меньше, чем цена, указанная в Заявке на продажу.

14.16.2. Лимитная Заявка одной направленности и Рыночная Заявка противоположной направленности являются встречными при условии, что у таких разнонаправленных Заявок совпадают признаки, указанные в пункте 11.2. настоящих Правил.

14.16.3. Заявка, содержащая указание на краткий код Маркет-мейкера и содержащая признак, указанный в пункте 14.10. настоящих Правил, одной направленности и Заявка противоположной направленности являются встречными при условии, что:

- у таких разнонаправленных Заявок совпадают признаки, указанные в пункте 11.2. настоящих Правил;

- Заявка противоположной направленности:

- не содержит указание на краткий код Маркет-мейкера; или
- содержит указание на краткий код Маркет-мейкера, но не содержит признака, указывающего на то, что Заявка подана при исполнении обязательств Маркет-мейкера, и не содержит, признак, указанный в пункте 14.10. настоящих Правил;

- цена, указанная в Заявке на покупку, не меньше, чем цена, указанная в Заявке на продажу (только для Лимитной Заявки).

14.16.4. Лимитная Заявка одной направленности и Заявка дополнительной ликвидности противоположной направленности являются встречными при условии, что:

- у таких разнонаправленных Заявок совпадают признаки, указанные в пункте 11.2. настоящих Правил;

- цена, указанная в Заявке на покупку, не меньше, чем цена, указанная в Заявке на продажу;

- Заявка дополнительной ликвидности содержит указание на идентификационный номер Лимитной заявки.

14.16.5. Рыночная Заявка одной направленности и Заявка дополнительной ликвидности противоположной направленности являются встречными при условии, что:

- у таких разнонаправленных Заявок совпадают признаки, указанные в пункте 11.2. настоящих Правил;

- Заявка дополнительной ликвидности содержит указание на идентификационный номер Рыночной заявки.

14.17. При наличии Обрабатываемой Заявки одной направленности, а также Заявки, находящейся в Очереди заявок, противоположной направленности (далее в настоящем пункте - «Заявка 1»), которые не являются встречными, при условии, что:

- обе Заявки содержат краткие коды Маркет-мейкера;

- цена, указанная в Заявке на покупку, не меньше, чем цена, указанная в Заявке на продажу;

- хотя бы одна из указанных Заявок не содержит признак, указанный в пункте 14.10. настоящих Правил,

на основании данной Обрабатываемой Заявки и иных встречных Заявок, находящихся в Очереди заявок, может быть заключен один или несколько Договоров при условии, что цены, указанные в этих Заявках, находящихся в Очереди заявок, хуже цены, указанной в Заявке 1. Неисполненная часть Обрабатываемой Заявки подлежит аннулированию Биржей.

14.18. При наличии Обрабатываемой Заявки и Заявки, находящейся в Очереди заявок, поданных за счет одного и того же лица (в соответствии с кодом этого лица), если в соответствии с пунктом 9.12. настоящих Правил указанные Заявки не являются основанием для заключения Договоров, и при условии, что цена, указанная в Заявке на покупку, не меньше, чем цена, указанная в Заявке на продажу, то Обрабатываемая Заявка в случае ее неисполнения или частичного исполнения аннулируется Биржей полностью или в части соответственно.

## **Статья 15. Порядок заключения Договоров в периоде непрерывного аукциона**

15.1. Договоры в Режиме основных торгов ПФИ в периоде непрерывного аукциона заключаются в порядке, установленном в статье 11 настоящих Правил и в настоящей статье.

15.2. Договоры на основании Заявок на покупку (Заявок на продажу) заключаются по правилам двойного встречного аукциона при условии наличия для Обрабатываемой Заявки встречных Заявок, находящихся в Очереди заявок, определенных по правилам, указанным в статье 14 настоящих Правил.

15.3. Цена одного Срочного контракта, заключенного на основании Рыночной Заявки, равна цене, указанной во встречной по отношению к ней Заявке.

15.4. Цена одного Срочного контракта, заключенного на основании Лимитной Заявки, равна:

- цене, указанной во встречной по отношению к ней Заявке, находящейся в Очереди заявок (если Договор ПФИ заключен на основании Обрабатываемой Лимитной Заявки);

- цене, указанной во встречной по отношению к ней Обрабатываемой Заявке дополнительной ликвидности, или, в случае наличия иных встречных Заявок, цене, указанной в данной Лимитной Заявке (если Договор заключен на основании Лимитной Заявки, находящейся в Очереди Заявок).

15.5. Цена одного Срочного контракта, заключенного на основании Обрабатываемой Заявки дополнительной ликвидности, равна цене, указанной в этой Заявке.

15.6. На основании Обрабатываемой Заявки и Заявки, находящейся в Очереди заявок, являющихся встречными, по одной цене всегда заключается один Договор.

15.7. Договоры на основании Рыночной Заявки и встречной Заявки заключается в отношении количества Срочных контрактов, меньшего из указанного в этих Заявках.

15.8. Договоры на основании Обрабатываемой Лимитной Заявки, действующей до конца Торгового дня, Обрабатываемой Лимитной Заявки, допускающей частичное исполнение, Обрабатываемой Лимитной Заявки, действующей до определённого времени в течение Торгового дня, и встречной Заявки, находящейся в Очереди заявок, заключается в отношении количества Срочных контрактов, меньшего из указанного в этих Заявках.

Договоры на основании Обрабатываемой Лимитной Заявки, не допускающей частичного исполнения, и встречной Заявки, находящейся в Очереди заявок, заключается в отношении количества Срочных контрактов, указанного в Обрабатываемой Лимитной Заявке, если оно меньше или равно количеству Срочных контрактов, указанному во встречной Заявке, или в отношении количества Срочных контрактов, указанного во встречной Заявке, если количество Срочных контрактов, указанное в Обрабатываемой Лимитной Заявке, превышает количество Срочных контрактов, указанное во встречной Заявке, и при этом количество Срочных контрактов, указанное во встречных Заявках, не меньше количества Срочных контрактов, указанного в Обрабатываемой Лимитной Заявке.

15.9. Договоры на основании Обрабатываемой Заявки дополнительной ликвидности и Лимитной Заявки, действующей до конца Торгового дня, Лимитной Заявки, допускающей частичное исполнение, Лимитной Заявки, действующей до определённого времени в течение Торгового дня, находящихся в Очереди заявок, заключается в отношении количества Срочных контрактов, меньшего из указанного в этих Заявках.

15.10. Договоры на основании Обрабатываемой Заявки дополнительной ликвидности и Лимитной Заявки, не допускающей частичного исполнения, находящейся в Очереди заявок, заключаются в отношении количества Срочных контрактов, меньшего из указанного в этих Заявках.

15.11. При наличии в Очереди заявок нескольких Заявок, являющихся встречными по отношению к Обрабатываемой Заявке, Договор заключается на основании указанной Обрабатываемой Заявки и встречной Заявки, находящейся в Очереди заявок, содержащей лучшую цену.

15.12. Если количество Срочных контрактов, указанное в Обрабатываемой Заявке меньше, чем количество Срочных контрактов, указанное во всех встречных Заявках, находящихся в Очереди заявок, то встречные Заявки исполняются по принципу пропорционального или паритетного заключения Договоров в порядке, предусмотренном пунктами 15.15. – 15.16. настоящих Правил.

15.13. Заключение Договоров на основании Заявок в соответствии с пунктом 15.12. настоящих Правил осуществляется с учетом пунктов 15.6. - 15.10. настоящих Правил.

15.14. Договоры на основании Обрабатываемой Заявки и встречных Заявок, находящихся в Очереди заявок, заключаются в порядке, определенном пунктом 15.15 или пунктом 15.16 настоящих Правил. Соответствующий порядок заключения Договоров устанавливается решением Биржи по одному или нескольким Срочным контрактам, или по одной или нескольким Группам инструментов. Указанное решение подлежит раскрытию на сайте Биржи в сети Интернет не позднее 1 (одного) дня до даты его вступления в силу.

15.15. Договоры на основании Обрабатываемой Заявки и встречных Заявок заключаются **по принципу пропорционального заключения Договоров** в следующем порядке:

1) при наличии встречных Заявок с одинаковыми ценами первой в Очереди заявок находится Заявка, содержащая большее количество Срочных контрактов. Если несколько Заявок содержат одинаковое количество Срочных контрактов, первой в Очереди заявок находится Заявка, объявленная ранее;

2) количество Срочных контрактов, заключаемых на основании Обрабатываемой Заявки и встречных по отношению к ней Заявок, объявленных ранее и распределённых в Очереди заявок в соответствии с подпунктом 1 настоящего пункта (далее – «встречные Заявки»), рассчитывается в следующем порядке:

$$Vi_{исп} = floor(\frac{Vi}{\sum_1^I Vi} * V_{акт})$$

, где:

*floor* – округление в меньшую сторону до целого;

*I* – количество встречных Заявок с одинаковой ценой;

*i* – порядковый номер встречной Заявки;

*Vi* – количество Срочных контрактов, выраженное в Торговых лотах, указанное в *i*-ой встречной Заявке;

*Vi<sub>исп</sub>* – часть количества Срочных контрактов, выраженного в Торговых лотах, указанного в *i*-ой встречной Заявке;

*V<sub>акт</sub>* – количество Срочных контрактов, выраженное в Торговых лотах, указанное в Обрабатываемой Заявке, на основании которой могут быть заключены Договоры путем исполнения встречных Заявок по цене, определённой в соответствии с пунктом 15.11 настоящих Правил;

3) если в результате расчёта количества Срочных контрактов в соответствии с подпунктом 2 настоящего пункта Обрабатываемая Заявка исполняется не в полном объёме, то в отношении оставшегося количества Срочных контрактов такая Заявка исполняется путем исполнения встречной Заявки, находящейся первой в Очереди заявок в соответствии с подпунктом 1 настоящего пункта.

В случае если количество Срочных контрактов, указанное во встречной Заявке, меньше количества Срочных контрактов, оставшегося после частичного исполнения Обрабатываемой Заявки, то Договоры заключаются в отношении количества Срочных контрактов, равного количеству Срочных контрактов, указанному во встречной Заявке. Договоры заключаются в отношении оставшегося количества Срочных контрактов на основании Обрабатываемой Заявки и каждой последующей встречной Заявки до полного исполнения указанной Обрабатываемой Заявки.

**15.16. Договоры на основании Обрабатываемой Заявки и встречных Заявок заключаются по принципу паритетного заключения Договоров в следующем порядке:**

1) при наличии встречных Заявок, находящихся в Очереди заявок, содержащих одинаковые цены, отбираются Заявки, содержащие указание на один и тот же Код Клиента, если Участник торгов действует за счет Клиента, или на один и тот же Код Участника торгов, если Участник торгов действует в своих интересах и за свой счет (далее в настоящей статье – «уникальный код»), и рассчитывается сумма объёмов Заявок (*Vi*), содержащих один и тот же уникальный код, выраженная в Торговых лотах. Для целей настоящего пункта под объёмом Заявки понимается количество Срочных контрактов, указанное в Заявке.

2) встречные Заявки, отобранные в соответствии с подпунктом 1 настоящего пункта, содержащие один и тот же уникальный код, сортируются по убыванию рассчитанного суммарного объёма (*Vi*) от большего значения к меньшему. В случае совпадения суммарных объёмов (*Vi*) Заявок, содержащих один и тот же уникальный код, все Заявки, содержащие один и тот же уникальный код, становятся первыми в Очереди заявок, если хотя бы одна из них объявлена ранее Заявок, содержащих другие уникальные коды;

3) при наличии нескольких встречных Заявок, находящихся в Очереди заявок, на основании которых рассчитывается суммарный объём (*Vi*) Заявок, содержащих один и тот же уникальный код, указанные Заявки сортируются в Очереди заявок по времени регистрации - первой из указанных Заявок в Очереди заявок находится встречная Заявка, зарегистрированная ранее;

4) суммарное количество Срочных контрактов, указанных в Заявках, в отношении которых могут быть заключены Договоры (далее – «объём Договоров»), на основании Обрабатываемой Заявки и встречных Заявок, содержащих один и тот же уникальный код и находящихся в Очереди заявок, исходя из сортировки Заявок, указанной в подпунктах 1 - 3 настоящего пункта, рассчитывается в следующем порядке:

$$V_{икк} = \min(floor(\frac{V_{акт}}{I}); Vi)$$

, где:

*floor* – округление в меньшую сторону до целого;

*min* – функция, возвращающая минимальное из двух значений;

*I* – количество уникальных кодов, по которым просуммированы Заявки, являющиеся встречными по отношению к Обрабатываемой Заявке и находящиеся в Очереди заявок;

$V_i$  – выраженный в Торговых лотах суммарный объем Заявок, являющихся встречными по отношению к Обрабатываемой Заявке, находящихся в Очереди заявок и содержащих один и тот же уникальный код;

$i$  – порядковый номер уникального кода, указанного в Заявках, находящихся в Очереди заявок;

$V_{ikk}$  – часть суммарного объема, выраженного в Торговых лотах, Заявок, являющихся встречными по отношению к Обрабатываемой Заявке, находящихся в Очереди заявок и содержащих один и тот же уникальный код;

$V_{акт}$  – выраженный в Торговых лотах объем Обрабатываемой Заявки;

5) для каждой последующей встречной Заявки из Очереди заявок, содержащей один и тот же уникальный код, объем заключаемых Договоров рассчитывается до тех пор, пока суммарный объем Договоров, подлежащих заключению на основании Заявок, содержащих этот уникальный код (с учетом объема указанной встречной Заявки), не превышает значение  $V_{ikk}$ ;

6) если суммарный объем подлежащих заключению Договоров с учетом объема встречной Заявки, указанной в подпункте 5 настоящего пункта, превышает значение  $V_{ikk}$ , то объем Договоров, подлежащих заключению путем исполнения указанной встречной Заявки, равен разности между значением  $V_{ikk}$  и суммарным объемом встречных Заявок, содержащих один и тот же уникальный код, предшествующих в Очереди заявок текущей встречной Заявке;

7) если в результате расчета объемов Договоров, подлежащих заключению в соответствии с подпунктами 4 - 6 настоящего пункта, Обрабатываемая Заявка исполняется не в полном объеме, то оставшийся неисполненный объем Обрабатываемой Заявки последовательно увеличивает объем заключаемых на основании Заявок, содержащих один и тот же уникальный код, Договоров, определённый в соответствии с подпунктами 4 - 6 настоящего пункта; при этом последовательность Заявок, полученная в результате сортировки, указанной в подпунктах 2 - 3 настоящего пункта, сохраняется. Каждое такое последовательное увеличение осуществляется в объеме, равном 1 (одному) Срочному контракту.

15.17. В целях расчета объема Заявок и объема Договоров в соответствии с пунктами 15.15. и 15.16. настоящих Правил, не учитываются Заявки, не являющиеся встречными, за исключением случая, указанного в настоящем пункте.

Заявка, указанная в пункте 14.18. настоящих Правил, находящаяся в Очереди заявок, учитывается в целях расчета объема Заявок и объема Договоров в соответствии с пунктами 15.15. и 15.16. настоящих Правил, однако Договоры на основании данной Заявки, находящейся в Очереди заявок, не подлежат заключению в соответствии с настоящими Правилами, а Обрабатываемая Заявка, указанная в пункте 14.18. настоящих Правил, не исполненная в полном объеме или частично, подлежит аннулированию Биржей.

## **Глава VI. Проведение Торгов в Режиме безадресных торгов ПФИ**

### **Статья 17. Порядок подачи Заявок в периоде непрерывного аукциона**

17.1. В Режиме безадресных торгов ПФИ в периоде непрерывного аукциона могут подаваться Заявки на покупку и Заявки на продажу с соблюдением требований настоящих Правил.

17.2. В Режиме безадресных торгов ПФИ в периоде непрерывного аукциона могут быть поданы следующие виды Заявок:

17.2.1. Лимитные Заявки;

17.2.2. Рыночные Заявки;

17.3. Под Лимитной Заявкой понимается Заявка на покупку или Заявка на продажу, обладающая в совокупности следующими признаками:

- Заявка является безадресной;

- Заявка является анонимной;

- Заявка может содержать цену за один Срочный контракт;

- Заявка предусматривает заключение Договора по цене, указанной в Заявке, или по лучшей цене.

Лимитные Заявки вправе подавать все Участники торгов.

Виды Лимитных Заявок, которые могут подаваться в Режиме безадресных торгов ПФИ, указаны в пункте 17.8. настоящих Правил.

17.4. Под Рыночной Заявкой понимается Заявка на покупку или Заявка на продажу, обладающая в совокупности следующими признаками:

- Заявка является безадресной;

- Заявка является анонимной;

- Заявка не содержит цену за один Срочный контракт;

- Заявка предусматривает заключение Договора по лучшей цене, доступной в момент объявления Заявки;

- Заявка допускает частичное исполнение;
- Заявка действует до момента заключения Договора на основании указанной Заявки или до момента аннулирования указанной Заявки Биржей.

Рыночные Заявки вправе подавать все Участники торгов.

17.5. В Режиме безадресных торгов ПФИ в периоде непрерывного аукциона допускается подача следующих видов Лимитных Заявок:

17.5.1. Лимитная Заявка, действующая до конца Торгового дня:

- действует до момента, определенного Биржей в течение Торгового дня, в рамках которого объявлена указанная Лимитная Заявка, и по факту наступления которого подлежит аннулированию Биржей;

- допускает частичное исполнение. В случае полного или частичного неисполнения Обрабатываемой Лимитной Заявки она подлежит выставлению в Очередь заявок в неисполненной части.

17.5.2. Лимитная Заявка, действующая до определённого времени в течение Торгового дня:

- действует до момента аннулирования указанной Лимитной Заявки Биржей, производимого в течение периода времени, начало и окончание которого устанавливается решением Биржи, в рамках Торгового дня, в течение которого объявлена указанная Лимитная Заявка;

- допускает частичное исполнение. В случае полного или частичного неисполнения Обрабатываемой Лимитной Заявки она подлежит выставлению в Очередь заявок в неисполненной части.

17.5.3. Лимитная Заявка, не допускающая частичного исполнения:

- не допускает частичного исполнения. В случае неисполнения Обрабатываемой Лимитной Заявки в полном объеме она подлежит аннулированию Биржей;

- Обрабатываемая Лимитная Заявка исполняется в полном объеме в момент объявления или немедленно аннулируется Биржей.

17.5.4. Лимитная Заявка, допускающая частичное исполнение:

- допускает частичное исполнение. В случае полного или частичного неисполнения Обрабатываемой Лимитной Заявки она подлежит немедленному аннулированию Биржей в неисполненной части;

- Обрабатываемая Лимитная Заявка исполняется в полном объеме или частично либо немедленно аннулируется Биржей.

17.6. Для целей исполнения Заявок, указанных в пункте 17.2. настоящих Правил, лучшей ценой, содержащейся в Заявках на продажу, считается наименьшая цена, а лучшей ценой, содержащейся в Заявках на покупку – наибольшая цена.

17.7. Заявка, подаваемая в Режиме безадресных торгов ПФИ, должна содержать:

- указание на Код Участника торгов, подавшего Заявку;
- указание на Краткий код (коды) Клиента (Клиентов), за счет которого (которых) подана Заявка (в случае если Участник торгов действует за счет Клиентов);
- указание на Идентификатор Участника торгов, подавшего Заявку;
- указание на вид Заявки;
- указание на направленность Заявки (Заявка на покупку или Заявка на продажу);
- указание на Идентификационный код Срочного контракта;
- количество Срочных контрактов, выраженное в Торговых лотах;
- указание на Торгово-клиринговый счет;
- цену за один Срочный контракт (указывается, если видом Заявки предусмотрено указание цены);
- указание на Режим торгов, в котором подается Заявка;
- указание на валюту цены;
- указание на валюту расчетов;
- иные сведения в случаях, предусмотренных настоящими Правилами.

17.8. Лимитная Заявка и Рыночная Заявка могут содержать признак, указывающий на то, что она подана Участником торгов при исполнении им обязательств Маркет-мейкера. Указание данного признака возможно только при условии, что Участником торгов, подающим Заявку, заключен договор об исполнении обязательств Маркет-мейкера, и только при условии указания в данной Заявке краткого кода Маркет-мейкера.

17.9. Заявка может содержать признак, указывающий на то, что встречными по отношению к ней не могут являться:

- Заявка, поданная при исполнении обязательств Маркет-мейкера;
- Заявка, в которой не содержится указание на Краткий код Клиента, входящий в Группу Клиентов, определенную Биржей.

Предусмотренный настоящим пунктом признак может содержаться в Лимитной Заявке, Рыночной Заявке, при условии, что данные Заявки содержат указание на краткий код Маркет-мейкера.

17.10. Лимитная Заявка или Рыночная заявка, содержащая признак, указывающий на то, что она подана при исполнении обязательств Маркет-мейкера, могут содержать указание на Группу Клиентов (далее – Заявки с признаком). Указание на Группу Клиентов означает, что встречными по отношению к Заявке с признаком могут являться, Заявки, в которой указан Краткий код Клиента, отнесенный к Группе Клиентов, которая указана в Заявках с признаком, или Заявки, в которых указан Краткий код Клиента, соответствующий коду Клиента, отнесённому к Группе Клиентов, указанной в Заявках с признаком.

17.11. Две разнонаправленные Заявки являются встречными при соблюдении следующих условий:

17.11.1. Лимитная Заявка и Лимитная Заявка противоположной направленности являются встречными при условии, что:

- у таких разнонаправленных Заявок совпадают признаки, указанные в пункте 11.2. настоящих Правил;
- цена, указанная в Заявке на покупку, не меньше, чем цена, указанная в Заявке на продажу.

17.11.2. Лимитная Заявка и Рыночная Заявка противоположной направленности являются встречными при условии, что у таких разнонаправленных Заявок совпадают признаки, указанные в пункте 11.2. настоящих Правил.

17.11.3. Обрабатываемая Рыночная Заявка или Обрабатываемая Лимитная Заявка одной направленности и одна из Заявок, указанная в пункте 17.11. настоящих Правил и находящаяся в Очереди заявок, противоположной направленности, являются встречными при условии, что:

- у таких разнонаправленных Заявок совпадают признаки, указанные в пункте 11.2. настоящих Правил;
- Обрабатываемая Рыночная Заявка или Обрабатываемая Лимитная Заявка содержит указание на Краткий код Клиента, соответствующий Группе Клиентов, указанной в одной из Заявок, указанных в пункте 17.11. настоящих Правил, либо Краткий код Клиента, соответствующий Коду Клиента, отнесённому к Группе Клиентов, указанной в одной из Заявок, указанных в пункте 17.11. настоящих Правил;
- цена, указанная в Заявке на покупку, не меньше, чем цена, указанная в Заявке на продажу (только для Лимитной Заявки);

При этом одна из Обрабатываемых Заявок, указанная в пункте 17.11. настоящих Правил, одной направленности и Лимитная Заявка противоположной направленности, находящаяся в Очереди заявок, содержащая указание на Краткий код Клиента, являются встречными независимо от того, к какой Группе Клиентов относится Краткий код Клиента, содержащийся в указанной Лимитной Заявке, или Код Клиента, соответствующий данному Краткому коду Клиента.

17.11.4. Заявка одной направленности, содержащая указание на краткий код Маркет-мейкера и в которой не указан признак, предусмотренный в пункте 17.12. настоящих Правил, и Заявка противоположной направленности считаются встречными при условии, что:

- у таких разнонаправленных Заявок совпадают признаки, указанные в пункте 11.2. настоящих Правил;
- Заявка противоположной направленности содержит указание на краткий код Маркет-мейкера и не содержит признак, предусмотренный в пункте 17.12. настоящих Правил, либо не содержит указание на краткий код Маркет-мейкера и содержит указание на Краткий код Клиента, входящий в Группу Клиентов;
- цена, указанная в Заявке на покупку, не меньше, чем цена, указанная в Заявке на продажу (только для Лимитной Заявки).

17.12. При наличии Обрабатываемой Заявки одной направленности, а также Заявки, находящейся в Очереди заявок, противоположной направленности (далее в настоящем пункте - «Заявка 1»), которые не являются встречными, при условии, что:

- обе Заявки содержат краткие коды Маркет-мейкера;
- цена, указанная в Заявке на покупку, не меньше чем цена, указанная в Заявке на продажу;
- хотя бы одна из указанных Заявок не содержит признак, указанный в пункте 17.11. настоящих Правил,

на основании данной Обрабатываемой Заявки и иных встречных Заявок, находящихся в Очереди заявок, может быть заключен один или несколько Договоров, при условии, что цены, указанные в этих Заявках, находящихся в Очереди заявок, хуже цены, указанной в Заявке 1. Неисполненная часть Обрабатываемой Заявки подлежит аннулированию Биржей.

17.13. При наличии Обрабатываемой Заявки и Заявки, находящейся в Очереди заявок, поданных за счет одного и того же лица (в соответствии с кодом этого лица), если в соответствии

с пунктом 9.12. настоящих Правил указанные Заявки не являются основанием для заключения Договоров, и при условии, что цена, указанная в Заявке на покупку, не меньше, чем цена, указанная в Заявке на продажу, то Обрабатываемая Заявка в случае ее неисполнения или частичного исполнения аннулируется Биржей полностью или в части соответственно.

#### **Статья 18. Порядок заключения Договоров в периоде непрерывного аукциона**

18.1. Договоры в Режиме безадресных торгов ПФИ в периоде непрерывного аукциона заключаются в порядке, установленном в статье 11 настоящих Правил и в настоящей статье.

18.2. Договоры на основании Заявок на покупку (Заявок на продажу) заключаются по правилам двойного встречного аукциона при условии наличия для Обрабатываемой Заявки встречных Заявок, находящихся в Очереди заявок, определенных по правилам, указанным в статье 17 настоящих Правил.

18.3. Цена одного Срочного контракта, заключенного на основании Рыночной Заявки, равна цене, указанной во встречной по отношению к ней Заявке.

18.4. Цена одного Срочного контракта, заключенного на основании Лимитной Заявки, равна:

- цене, указанной во встречной по отношению к ней Заявке, находящейся в Очереди заявок (если Договор заключен на основании Обрабатываемой Лимитной Заявки);
- в случае наличия иных встречных Заявок, цене, указанной в данной Лимитной Заявке (если Договор заключен на основании Лимитной Заявки, находящейся в Очереди заявок).

18.5. На основании Обрабатываемой Заявки и Заявки, находящейся в Очереди заявок, являющихся встречными, по одной цене всегда заключается один Договор.

18.6. Договоры на основании Рыночной Заявки и встречной Заявки заключается в отношении количества Срочных контрактов, меньшего из указанного в этих Заявках.

18.7. Договоры на основании Обрабатываемой Лимитной Заявки, действующей до конца Торгового дня, Обрабатываемой Лимитной Заявки, допускающей частичное исполнение, Обрабатываемой Лимитной Заявки, действующей до определенного времени в течение Торгового дня, и встречной Заявки, находящейся в Очереди заявок, заключается в отношении количества Срочных контрактов, меньшего из указанного в этих Заявках.

Договоры на основании Обрабатываемой Лимитной Заявки, не допускающей частичного исполнения, и встречной Заявки, находящейся в Очереди заявок, заключаются в отношении количества Срочных контрактов, указанного в Обрабатываемой Лимитной Заявке, если оно меньше или равно количеству Срочных контрактов, указанному во встречной Заявке, или в отношении количества Срочных контрактов, указанного во встречной Заявке, если количество Срочных контрактов, указанное в Обрабатываемой Лимитной Заявке, превышает количество Срочных контрактов, указанное во встречной Заявке, и при этом количество Срочных контрактов, указанное во встречных Заявках, не меньше количества Срочных контрактов, указанного в Обрабатываемой Лимитной Заявке.

18.8. При наличии в Очереди заявок нескольких Заявок, являющихся встречными по отношению к Обрабатываемой Заявке, Договор заключается на основании указанной Обрабатываемой Заявки и встречной Заявки, находящейся в Очереди заявок, содержащей лучшую цену.

18.9. Если количество Срочных контрактов, указанное в Обрабатываемой Заявке меньше, чем количество Срочных контрактов, указанное во всех встречных Заявках, находящихся в Очереди заявок, то встречные Заявки исполняются по принципу пропорционального или паритетного заключения Договоров в порядке, предусмотренном пунктами 18.12. – 18.13. настоящих Правил.

18.10. Заключение Договоров на основании Заявок в соответствии с пунктом 18.9. настоящих Правил осуществляется с учетом пунктов 18.5. – 18.7. настоящих Правил.

18.11. Договоры на основании Обрабатываемой Заявки и встречных Заявок, находящихся в Очереди заявок, заключаются в порядке, определенном пунктом 18.12 или пунктом 18.13 настоящих Правил. Соответствующий порядок заключения Договора устанавливается решением Биржи по одному или нескольким Срочным контрактам, или по одной или нескольким Группам инструментов. Указанное решение подлежит раскрытию на сайте Биржи в сети Интернет не позднее 1 (одного) дня до даты его вступления в силу.

18.12. Договоры на основании Обрабатываемой Заявки и встречных Заявок заключаются **по принципу пропорционального заключения Договоров** в следующем порядке:

1) при наличии встречных Заявок с одинаковыми ценами первой в Очереди заявок находится Заявка, содержащая большее количество Срочных контрактов. Если несколько Заявок содержат одинаковое количество Срочных контрактов, первой в Очереди заявок находится Заявка, объявленная ранее;

2) количество Срочных контрактов, заключаемых на основании Обрабатываемой Заявки и встречных по отношению к ней Заявок, объявленных ранее и распределённых в Очереди заявок в

соответствии с подпунктом 1 настоящего пункта (далее – встречные Заявки), рассчитывается в следующем порядке:

$$Vi_{\text{исп}} = \text{floor}\left(\frac{Vi}{\sum_{i=1}^I Vi} * V_{\text{акт}}\right),$$

где:

*floor* – округление в меньшую сторону до целого;

*I* – количество встречных Заявок, с одинаковой ценой;

*i* – порядковый номер встречной Заявки;

*Vi* – количество Срочных контрактов, выраженное в Торговых лотах, указанное в *i*-ой встречной Заявке;

*Vi<sub>исп</sub>* – часть количества Срочных контрактов, выраженное в Торговых лотах, указанного в *i*-ой встречной Заявке;

*V<sub>акт</sub>* – количество Срочных контрактов, выраженное в Торговых лотах, указанное в Обрабатываемой Заявке, на основании которой могут быть заключены Договоры путем исполнения встречных Заявок по цене, определённой в соответствии с пунктом 18.9. настоящих Правил;

3) если в результате расчёта количества Срочных контрактов в соответствии с подпунктом 2 настоящего пункта, Обрабатываемая Заявка исполняется не в полном объёме, то в отношении оставшегося количества Срочных контрактов такая Заявка исполняется путем исполнения встречной Заявки, находящейся первой в Очереди заявок в соответствии с подпунктом 1 настоящего пункта.

В случае если количество Срочных контрактов, указанное во встречной Заявке, меньше количества Срочных контрактов, оставшегося после частичного исполнения Обрабатываемой Заявки, то Договоры заключаются в отношении количества Срочных контрактов, равного количеству Срочных контрактов, указанному во встречной Заявке. Договор заключаются в отношении оставшегося количества Срочных контрактов на основании Обрабатываемой Заявки и каждой последующей встречной Заявки до полного исполнения указанной Обрабатываемой Заявки.

18.13. Договоры на основании Обрабатываемой Заявки и встречных Заявок заключаются по принципу паритетного заключения Договоров в следующем порядке:

1) при наличии встречных Заявок, находящихся в Очереди заявок и содержащих одинаковые цены, отбираются Заявки, содержащие указание на один и тот же Код Клиента, если Участник торгов действует за счет Клиента, или указание на один и тот же Код Участника торгов, если Участник торгов действует в своих интересах и за свой счет (далее в настоящей статье – уникальный код), и рассчитывается сумма объёмов Заявок (*Vi*), содержащих один и тот же уникальный код, выраженная в Торговых лотах. Для целей настоящего пункта под объёмом Заявки понимается количество Срочных контрактов, указанное в Заявке.

2) встречные Заявки, отобранные в соответствии с подпунктом 1 настоящего пункта, содержащие один и тот же уникальный код, сортируются по убыванию рассчитанного суммарного объёма (*Vi*) от большего значения к меньшему. В случае совпадения суммарных объёмов (*Vi*) Заявок, содержащих один и тот же уникальный код, все Заявки, содержащие один и тот же уникальный код, становятся первыми в Очереди заявок, если хотя бы одна из них объявлена ранее Заявок, содержащих другие уникальные коды;

3) при наличии нескольких встречных Заявок, находящихся в Очереди заявок, на основании которых рассчитывается суммарный объём (*Vi*) Заявок, содержащих один и тот же уникальный код, указанные Заявки сортируются в Очереди заявок по времени регистрации - первой из указанных Заявок в Очереди заявок находится встречная Заявка, зарегистрированная ранее;

4) суммарное количество Срочных контрактов, указанных в Заявках, в отношении которых могут быть заключены Договоры (далее – объём Договоров), на основании Обрабатываемой Заявки и встречных Заявок, содержащих один и тот же уникальный код и находящихся в Очереди заявок, исходя из сортировки Заявок, указанной в подпунктах 1 - 3 настоящего пункта, рассчитывается в следующем порядке:

$$V_{\text{икк}} = \min\left(\text{floor}\left(\frac{V_{\text{акт}}}{I}\right); Vi\right),$$

где:

*floor* – округление в меньшую сторону до целого;

*min* – функция, возвращающая минимальное из двух значений;

*I* – количество уникальных кодов, по которым просуммированы Заявки, являющиеся встречными по отношению к Обрабатываемой Заявке и находящиеся в Очереди заявок;

$V_i$  – выраженный в Торговых лотах суммарный объем Заявок, являющихся встречными по отношению к Обрабатываемой Заявке, находящихся в Очереди заявок и содержащих один и тот же уникальный код;

$i$  – порядковый номер уникального кода, указанного в Заявках, находящихся в Очереди заявок;

$V_{i_{kk}}$  – часть суммарного объема, выраженного Торговых лотах, Заявок, являющихся встречными по отношению к Обрабатываемой Заявке, находящихся в Очереди заявок и содержащих один и тот же уникальный код;

$V_{акт}$  – выраженный в Торговых лотах объем Обрабатываемой Заявки;

5) для каждой последующей встречной Заявки из Очереди заявок, содержащей один и тот же уникальный код, объем заключаемых Договоров рассчитывается до тех пор, пока суммарный объем Договоров, подлежащих заключению на основании Заявок, содержащих этот уникальный код (с учетом объема указанной встречной Заявки), не превышает значение  $V_{i_{kk}}$ ;

6) в случае если суммарный объем подлежащих заключению Договоров с учетом объема встречной Заявки, указанной в подпункте 5 настоящего пункта, превышает значение  $V_{i_{kk}}$ , то объем Договоров, подлежащих заключению путем исполнения указанной встречной Заявки, равен разности между значением  $V_{i_{kk}}$  и суммарным объемом встречных Заявок, содержащих один и тот же уникальный код, предшествующих в Очереди заявок текущей встречной Заявке;

7) если в результате расчета объемов Договоров, подлежащих заключению в соответствии с подпунктами 4 - 6 настоящего пункта, Обрабатываемая Заявка исполняется не в полном объеме, то оставшийся неисполненный объем Обрабатываемой Заявки последовательно увеличивает объем заключаемых на основании Заявок, содержащих один и тот же уникальный код, Договоров, определённый в соответствии с подпунктами 4 - 6 настоящего пункта; при этом последовательность Заявок, полученная в результате сортировки, указанной в подпунктах 2 - 3 настоящего пункта, сохраняется. Каждое такое последовательное увеличение осуществляется в объеме, равном 1 (одному) Срочному контракту.

18.16. В целях расчета объема Заявок и объема Договоров в соответствии с пунктами 18.12. и 18.13. настоящих Правил, не учитываются Заявки, не являющиеся встречными, за исключением случая, указанного в настоящем пункте.

Заявка, указанная в пункте 17.15. настоящих Правил, находящаяся в Очереди заявок, учитывается в целях расчета объема Заявок и объема Договоров в соответствии с пунктами 18.12. и 18.13. настоящих Правил, однако Договоры на основании данной Заявки, находящейся в Очереди заявок, не подлежат заключению в соответствии с настоящими Правилами, а Обрабатываемая Заявка, указанная в пункте 17.15. настоящих Правил, не исполненная в полном объеме или частично, подлежит аннулированию Биржей.

## **Статья 19. Аукцион дополнительной ликвидности. Особенности подачи Заявок и заключения Договоров**

19.1. В рамках Режима безадресных торгов ПФИ может проводиться аукцион дополнительной ликвидности.

Аукцион дополнительной ликвидности может проводиться по одной или нескольким Срочным контрактам и (или) одной или нескольким Группам инструментов, определенным в соответствии с решением Биржи. Указанное решение подлежит раскрытию на сайте Биржи в сети Интернет не позднее 1 (одного) дня до даты его вступления в силу.

19.2. Аукцион дополнительной ликвидности состоит из следующих последовательных периодов:

- основной период;
- дополнительный период.

Время начала и время окончания каждого из указанных периодов определяется решением Биржи.

19.3. В рамках аукциона дополнительной ликвидности могут подаваться следующие виды Заявок:

- Заявка с указанием цены;
- Заявка без указания цены;
- Заявка дополнительной ликвидности.

19.4. Под Заявкой с указанием цены понимается Заявка на покупку или Заявка на продажу, обладающая в совокупности следующими признаками:

- Заявка является безадресной;
- Заявка является анонимной;
- Заявка содержит цену за один Срочный контракт;
- Заявка предусматривает заключение Договора по цене, указанной в Заявке, или по лучшей цене.

Заявки с указанием цены вправе подавать все Участники торгов, за исключением Центрального контрагента.

19.5. В рамках аукциона дополнительной ликвидности допускается подача следующих видов Заявок с указанием цены:

19.5.1. Заявка с указанием цены, действующая до конца Торгового дня:

- действует до момента, определенного Биржей в течение Торгового дня, в рамках которого объявлена указанная Заявка, и по факту наступления которого подлежит аннулированию Биржей;
- допускает частичное исполнение. В случае полного или частичного неисполнения Обрабатываемой Заявки с указанием цены она подлежит выставлению в Очередь заявок в неисполненной части.

19.5.2. Заявка с указанием цены, действующая до определенного времени:

- действует до момента аннулирования указанной Заявки Биржей, производимого в течение периода времени, начало и окончание которого устанавливается решением Биржи, в рамках Торгового дня, в течение которого объявлена указанная Заявка;
- допускает частичное исполнение. В случае полного или частичного неисполнения Обрабатываемой Заявки с указанием цены она подлежит выставлению в Очередь заявок в неисполненной части.

19.5.3. Заявка с указанием цены, не допускающая частичного исполнения:

- не допускает частичного исполнения. В случае неисполнения Заявки в полном объеме она подлежит аннулированию Биржей;
- действует до момента ее исполнения в полном объеме или до момента ее аннулирования Биржей в связи с получением Биржей уведомления о неподаче Рутинговым агентом Заявки дополнительной ликвидности в соответствии с пунктом 19.9. настоящих Правил.

19.5.4. Заявка с указанием цены, допускающая частичное исполнение:

- допускает частичное исполнение. В случае полного или частичного неисполнения Заявки она подлежит аннулированию Биржей в неисполненной части;
- действует до момента ее полного или частичного исполнения или до момента ее аннулирования Биржей в связи с получением Биржей уведомления о неподаче Рутинговым агентом Заявки дополнительной ликвидности в соответствии с пунктом 19.9. настоящих Правил.

19.6. Под Заявкой без указания цены понимается Заявка на покупку или Заявка на продажу, обладающая в совокупности следующими признаками:

- Заявка является безадресной;
- Заявка является анонимной;
- Заявка не содержит цену за один Срочный контракт;
- Заявка предусматривает заключение Договора по цене, указанной во встречной по отношению к ней Заявке дополнительной ликвидности;
- Заявка или неисполненный остаток Заявки подлежит выставлению в Очередь заявок;
- Заявка действует до момента заключения Договора на основании указанной Заявки или до момента аннулирования данной Заявки без указания цены Биржей в связи с получением Биржей уведомления о неподаче Рутинговым агентом Заявки дополнительной ликвидности в соответствии с пунктом 19.9. настоящих Правил.

Заявки без указания цены вправе подавать все Участники торгов, за исключением Центрального контрагента.

19.7. Под Заявкой дополнительной ликвидности понимается Заявка на покупку или Заявка на продажу, обладающая в совокупности следующими признаками:

- Заявка является адресной. При этом информация о ней не раскрывается Участникам торгов в Очереди заявок;
- Заявка является анонимной;
- Заявка содержит указание на идентификационный номер встречной Заявки без указания цены или встречной Заявки с указанием цены;
- Заявка содержит цену за один Срочный контракт;
- Заявка допускает частичное исполнение;
- Заявка подлежит немедленному исполнению в момент ее объявления, а в случае полного или частичного неисполнения в указанный момент времени немедленно аннулируется Биржей.

Заявки дополнительной ликвидности вправе подавать только Рутинговый агент.

19.8. Заявки с указанием цены и Заявки без указания цены могут быть поданы только в течение основного периода.

Заявки дополнительной ликвидности могут быть поданы как в течение основного периода, так и в течение дополнительного периода.

19.9. При наличии в Очереди заявок Заявок с указанием цены, допускающих частичное исполнение, Заявок с указанием цены, не допускающих частичного исполнения и Заявок без

указания цены, Рутинговый агент обязуется подать Заявки дополнительной ликвидности или предоставить Бирже уведомление о неподаче Заявок дополнительной ликвидности.

Уведомление о неподаче Заявки дополнительной ликвидности передаётся Бирже посредством Системы проведения торгов.

Уведомление о неподаче Заявки дополнительной ликвидности должно содержать идентификационный номер Обрабатываемых Заявок, в отношении которой оно составлено.

19.10. Для целей установления соответствия Заявок друг другу в рамках аукциона дополнительной ликвидности встречными Заявками могут являться:

19.10.1. Заявка с указанием цены одной направленности и Заявка дополнительной ликвидности противоположной направленности при условии, что:

- у таких разнонаправленных Заявок совпадают признаки, указанные в пункте 11.2 настоящих Правил;

- цена, указанная в Заявке на покупку, не меньше, чем цена, указанная в Заявке на продажу;

- Заявка дополнительной ликвидности содержит указание на идентификационный номер Заявки с указанием цены.

19.10.2. Заявка без указания цены одной направленности и Заявка дополнительной ликвидности противоположной направленности при условии, что:

- у таких разнонаправленных Заявок совпадают признаки, указанные в пункте 11.2 настоящих Правил;

- Заявка дополнительной ликвидности содержит указание на идентификационный номер Заявки без указания цены.

19.11. Договоры в рамках аукциона дополнительной ликвидности заключаются в порядке, установленной в статье 11 настоящих Правил, и в соответствии с настоящим пунктом.

Договоры в рамках аукциона дополнительной ликвидности заключаются на основании Обрабатываемых Заявок дополнительной ликвидности и Заявок с указанием цены либо Заявок без указания цены, находящихся в Очереди заявок.

Цена Срочного контракта, заключаемого в рамках аукциона дополнительной ликвидности, равна цене одного Срочного контракта, указанной в Заявке дополнительной ликвидности, на основании которой заключён Договор.

Количество Срочных контрактов, заключаемых в рамках аукциона дополнительной ликвидности, определяется как меньшее из количества Срочных контрактов, указанного во встречных Заявках, на основании которых заключён Договор.

## **Глава VII Проведение Торгов в Режиме торгов RFQ ПФИ**

### **Статья 20. Запросы на котировку**

20.1. Участник торгов для целей объявления Заявок в Системе проведения торгов вправе подать в Систему проведения торгов Запрос на котировку.

20.2. Запрос на котировку не является Заявкой и не регистрируется в реестре Заявок. Запрос на котировку является приглашением делать оферты путем подачи Котировочных Заявок на Торгах в Режиме торгов RFQ ПФИ.

20.3. В Режиме торгов RFQ ПФИ могут подаваться следующие виды Запросов на котировку:

- Запрос на продажу;

- Запрос на покупку.

Подача Запроса на продажу Участником торгов означает приглашение делать оферты путем направления Заявки на покупку с целью заключения Договора по цене, не ниже той, что указана в Запросе на продажу.

Подача Запроса на покупку Участником торгов означает приглашение делать оферты путем направления Заявки на продажу с целью заключения Договора по цене, не выше той, что указана в Запросе на покупку.

Если в Запросе на котировку не указана цена, то Запрос на котировку означает приглашение делать оферты путём направления Заявок на покупку (Заявок на продажу), направленность которых противоположна направленности указанного Запроса на котировку, с целью заключения Договора по ценам, указанным в Заявках.

20.4. Запрос на котировку содержит:

- указание на Идентификатор Участника торгов, подавшего Запрос на котировку;

- указание на Код Участника торгов, подавшего Запрос на котировку;

- Краткий код Клиента (при подаче Участником торгов Запроса на котировку за счет Клиента);

- указание на Идентификационный код Срочного контракта;

- количество Срочных контрактов, выраженное в Торговых лотах;
- указание на Торгово-клиринговый счет;
- указание на вид Запроса на котировку (Запрос на продажу или Запрос на покупку);
- иные сведения в случаях, предусмотренных настоящими Правилами.

Запрос на котировку может также содержать цену за один Срочный контракт.

20.5. Запросы на котировку могут быть следующих видов:

20.5.1. Запрос на котировку с указанием цены, действующий до конца Торгового дня:

- действует до момента, определенного Биржей в течение Торгового дня, в рамках которого указанный Запрос на котировку был подан, и по факту наступления которого подлежит аннулированию Биржей;

- допускает частичное исполнение.

20.5.2. Запрос на котировку с указанием цены, действующий до определённого времени в течение Торгового дня:

- действует до момента аннулирования указанного Запроса на котировку Биржей, производимого в течение периода времени, начало и окончание которого устанавливается решением Биржи, в рамках Торгового дня, в течение которого указанный Запрос на котировку был подан;

- допускает частичное исполнение.

20.5.3. Запрос на котировку с указанием цены, не допускающий частичного исполнения.

- не допускает частичного исполнения;

- действует до момента его исполнения в полном объеме или до момента его аннулирования Биржей в связи с получением Биржей уведомления о неподаче Центральным контрагентом Котировочной Заявки в соответствии с пунктом 20.8. настоящих Правил.

20.5.4. Запрос на котировку с указанием цены, допускающий частичное исполнение:

- допускает частичное исполнение;

- действует до момента его исполнения в полном объеме или до момента его аннулирования в полной или неисполненной части Биржей в связи с получением Биржей уведомления о неподаче Центральным контрагентом Котировочной Заявки в соответствии с пунктом 20.8. настоящих Правил.

20.5.5. Запрос на котировку без указания цены:

- допускает частичное исполнение.

- действует до момента его исполнения в полном объеме или до момента его аннулирования Биржей в полном объеме или в неисполненной части в связи с получением Биржей уведомления о неподаче Центральным контрагентом Котировочной Заявки в соответствии с пунктом 20.8. настоящих Правил.

20.6. Решением Биржи может быть установлен перечень Срочных контрактов, в отношении которых могут быть поданы только Запросы на котировку с указанием цены, действующие до конца Торгового дня, в течение которого указанные Запросы на котировку были поданы. Указанное решение подлежит раскрытию на сайте Биржи в сети Интернет не позднее 1 (одного) дня до даты его вступления в силу.

20.7. Участник торгов вправе отозвать Запрос на котировку, поданный на Торгах. Отзыв Запроса на котировку осуществляется путём подачи Участником торгов в Систему проведения торгов соответствующего запроса на отзыв Запроса на котировку. Случаи отзыва Запросов на котировку регистрируются в реестре Запросов на котировку.

20.8. При наличии Запроса на котировку с указанием цены, не допускающего частичного исполнения, Запроса на котировку с указанием цены, допускающего частичное исполнение, и Запроса на котировку без указания цены Центральный контрагент обязуется подать Котировочную Заявку или предоставить Бирже уведомление о неподаче Котировочной Заявки.

Уведомление о неподаче Котировочной Заявки передаётся Бирже посредством Системы проведения торгов.

Уведомление о неподаче Центральным контрагентом Котировочной Заявки должна содержать указание на идентификационный номер соответствующего Запроса на котировку.

20.9. Запрос на котировку исполняется в полном объеме или частично в случае заключения Договора на основании Некотировочной Заявки, объявленной на основании данного Запроса на котировку.

20.10. Участник торгов вправе до момента аннулирования или отзыва Запроса на котировку изменить количество Срочных контрактов, выраженное в Торговых лотах и указанное в поданном Запросе на котировку. Изменение количества Срочных контрактов не является отзывом Запроса на котировку.

20.11. Если иное не установлено настоящим пунктом, Запросы на котировку вправе подавать все Участники торгов.

Решением Биржи может быть установлен перечень Срочных контрактов, в отношении которых Участники торгов категории А вправе подавать Запросы на котировку, в которых указаны

соответствующие Срочные контракты, только в случае, если Краткий код Клиента, указанный в данном Запросе на котировку, не является кратким кодом Маркет-мейкера. Указанное решение подлежит раскрытию на сайте Биржи в сети Интернет не позднее 1 (одного) дня до даты его вступления в силу.

20.12. Биржа осуществляет ведение реестра Запросов на котировку, поданных на Торгах (далее – реестр Запросов на котировку).

20.13. Реестр Запросов на котировку включает в себя следующие сведения:

- идентификационный номер Запроса на котировку;
- Идентификатор Участника торгов, подавшего Запрос на котировку;
- Код Участника торгов, подавшего Запрос на котировку;
- Краткий код Участника торгов, подавшего Запрос на котировку;
- Код (Коды) Клиента (Клиентов), за счет которого (которых) подан Запрос на котировку;
- Краткий код Клиента (при подаче Участником торгов Запроса на котировку за счет Клиента);
- Идентификационный код Срочного контракта;
- код (обозначение) Срочного контракта;
- Торгово-клиринговый счет;
- время подачи Запроса на котировку;
- цена за один Срочный контракт (указывается, если видом Запроса на котировку предусмотрено указание цены);
- вид Запроса на котировку (Запрос на продажу или Запрос на покупку);
- количество Срочных контрактов, выраженное в Торговых лотах, указанное при подаче Запроса на котировку;
- количество Срочных контрактов, содержащееся в Торговых лотах, указанное при подаче Запроса на котировку, выраженное в штуках;
- время последнего изменения Запроса на котировку;
- результат подачи Запроса на котировку (исполнен, отозван, аннулирован);
- количество Срочных контрактов, выраженное в Торговых лотах (в случае изменения количества Срочных контрактов, содержащееся в Запросе на котировку).

20.14. В реестр Запросов на котировку дополнительно может быть включена иная информация.

20.15. Запрос на котировку считается объявленным с момента его регистрации в реестре Запросов на котировку.

20.16. Информация, содержащаяся в Запросе на котировку, после регистрации указанного запроса в реестре Запросов на котировку, раскрывается только Участнику торгов, объявившему данный запрос, и, если иное не предусмотрено решением Биржи, всем Участникам торгов категории А и Центральному контрагенту.

## **Статья 21. Порядок подачи Заявок**

21.1. В Режиме торгов RFQ ПФИ могут подаваться Заявки на покупку и Заявки на продажу с соблюдением требований настоящих Правил.

21.2. В Режиме торгов RFQ ПФИ могут быть поданы следующие виды Заявок:

- Котировочные Заявки;
- Некотировочные Заявки.

21.3. Под Котировочной Заявкой понимается Заявка на покупку или Заявка на продажу, обладающая в совокупности следующими признаками:

- Заявка является адресной. При этом информация об указанной Заявке раскрывается только Участнику торгов, подавшему Запрос на котировку, идентификационный номер которого указан в данной Котировочной Заявке;

- Заявка является анонимной;

- Заявка содержит указание на идентификационный номер Запроса на котировку следующим образом:

- Заявка на покупку содержит указание на идентификационный номер Запроса на продажу;

- Заявка на продажу содержит указание на идентификационный номер Запроса на покупку;

- Заявка содержит указание на цену одного Срочного контракта. Если в Запросе на котировку, идентификационный номер которого указан в данной Заявке, указана цена, то цена Котировочной заявки должна быть равна или лучше цены, указанной в Запросе на котировку. В случае если цена, указанная в данном Запросе на котировку, лучше цены, указанной в Котировочной заявке, то указанная Заявка не подлежит регистрации в реестре Заявок;

- Заявка допускает частичное исполнение;

- Заявка действует до момента заключения Договора на основании указанной Заявки или до момента аннулирования указанной Заявки Биржей;

- Заявка в отношении Срочных контрактов, определенных решением Биржи, подлежит выставлению в Очередь заявок.

Решением Биржи может быть установлен перечень Срочных контрактов, Котировочные Заявки в отношении которых могут подавать:

- только Участники торгов категории А, при условии указания в данной Заявке краткого кода Маркет-мейкера;

- только Центральный контрагент;

- все Участники торгов.

Соответствующее решение подлежит раскрытию на сайте Биржи в сети Интернет не позднее 1 (одного) дня до даты его вступления в силу.

21.4. Под Некотировочной Заявкой понимается Заявка на покупку или Заявка на продажу, обладающая в совокупности следующими признаками:

- Заявка является адресной. При этом информация об указанной Заявке раскрывается только Участнику торгов, подавшему Котировочную Заявку, по отношению к которой данная Заявка является встречной;

- Заявка является анонимной;

- Заявка содержит указание на идентификационный номер Запроса на котировку следующим образом:

- Заявка на покупку содержит указание на идентификационный номер Запроса на покупку;

- Заявка на продажу содержит указание на идентификационный номер Запроса на продажу.

- Заявка допускает частичное исполнение;

- Заявка или неисполненный остаток Заявки подлежит выставлению в Очередь заявок;

- Заявка действует до момента заключения Договора на основании указанной Заявки или до момента аннулирования указанной Заявки Биржей;

Некотировочные Заявки на покупку могут подавать только Участники торгов, подавшие Запрос на покупку, идентификационный номер которого указан в данной Некотировочной Заявке. Некотировочные Заявки на продажу могут подавать только Участники торгов, подавшие Запрос на продажу, идентификационный номер которого содержится в данной Некотировочной Заявке. При этом указанная Некотировочная заявка должна содержать Краткий код Клиента, указанный в Запросе на котировку.

21.5. Для целей исполнения Котировочных Заявок лучшей ценой, содержащейся в Заявках на продажу, считается наименьшая цена, а лучшей ценой, содержащейся в Заявках на покупку – наибольшая цена.

21.6. Некотировочная Заявка может быть отозвана Участником торгов. Отзыв Некотировочной Заявки осуществляется путем подачи Участником торгов в Систему проведения торгов соответствующего запроса на отзыв Запроса на котировку, идентификационный номер которого указан в данной Некотировочной Заявке. Случаи отзыва Некотировочной Заявки регистрируются в реестре Заявок.

Котировочная Заявка может быть отозвана Участником торгов. Отзыв Котировочной Заявки осуществляется путем подачи Участником торгов в Систему проведения торгов соответствующего запроса на отзыв Котировочной Заявки. Случаи отзыва Котировочных Заявок регистрируются в реестре Заявок.

21.7. При подаче Заявки в Систему проведения торгов Котировочная Заявка и Некотировочная Заявка должны содержать:

- указание на Код Участника торгов, подавшего Заявку;

- Краткий код (коды) Клиента (Клиентов), за счет которого (которых) подана Заявка (в случае если Участник торгов действует за счет Клиентов);

- указание на Идентификатор Участника торгов, подавшего Заявку;

- указание на вид Заявки;

- указание на направленность Заявки (Заявка на покупку или Заявка на продажу);

- количество Срочных контрактов, выраженное в Торговых лотах;

- указание на Торгово-клиринговый счет;

- цену за один Срочный контракт (указывается, если видом Заявки предусмотрено указание цены);

- указание на Идентификационный код Срочного контракта;

- указание на Режим торгов, в котором подается Заявка;

- указание на валюту цены;

- указание на валюту расчетов;

- указание на идентификационный номер Запроса на котировку, зарегистрированного в реестре Запросов на котировку;

- иные сведения в случаях, предусмотренных настоящими Правилами.

21.8. Решением Биржи может быть установлен перечень Срочных контрактов, для которых применяются следующие правила:

- в случае если предметом Котировочной Заявки являются соответствующие Срочные контракты, количество Срочных контрактов, указанное в Котировочной Заявке, должно быть не меньше, чем количество Срочных контрактов, указанное в Запросе на котировку, идентификационный номер которого указан в реквизитах Котировочной Заявки;

- в случае если предметом Котировочной Заявки являются соответствующие Срочные контракты, количество Срочных контрактов, указанное в Некотировочной Заявке, должно быть не больше, чем количество Срочных контрактов, указанное во встречной Котировочной Заявке.

Соответствующее решение подлежит раскрытию на сайте Биржи в сети Интернет не позднее 1 (одного) дня до даты его вступления в силу.

21.9. В Режиме торгов RFQ ПФИ Котировочная Заявка одной направленности и Некотировочная Заявка противоположной направленности являются встречными при условии, что:

- совпадают признаки, указанные в пункте 11.2 настоящих Правил;

- цена, указанная в Заявке на покупку, не меньше, чем цена, указанная в Заявке на продажу (указывается, если видом Заявки предусмотрено указание цены);

- в Котировочной Заявке и в Некотировочной Заявке указан одинаковый идентификационный номер Запроса на котировку.

21.10. Решением Биржи может быть установлен перечень Срочных контрактов, в отношении которых применяется следующее правило: в случае подачи двух Котировочных Заявок, предметом которых являются соответствующие Срочные контракты, содержащих одинаковый идентификационный номер Запроса на котировку, Котировочная Заявка объявленная позже аннулируется Биржей. Соответствующее решение подлежит раскрытию на сайте Биржи в сети Интернет не позднее 1 (одного) дня до даты его вступления в силу.

## **Статья 22. Порядок заключения Договоров**

22.1. Договоры в Режиме торгов RFQ ПФИ заключаются в порядке, установленном в статье 11 настоящих Правил и в настоящей статье.

22.2. Договоры заключаются на основании двух разнонаправленных Заявок, являющихся встречными, в соответствии с пунктом 21.9. настоящих Правил.

22.3. Договор заключается по цене, указанной в Котировочной заявке, в отношении меньшего количества Срочных контрактов из указанных во встречных Заявках.

## **Глава VIII. Проведение Торгов в Режиме переговорных сделок ПФИ**

### **Статья 23. Порядок подачи Заявок**

23.1. В Режиме переговорных сделок ПФИ могут подаваться Заявки на покупку и Заявки на продажу с соблюдением требований настоящих Правил.

23.2. В Режиме переговорных сделок ПФИ Участники торгов вправе подавать адресные неанонимные Заявки.

23.3. Информация о поданной Заявке раскрывается Участнику торгов, подавшему указанную Заявку. Участник торгов в ходе Торгов имеет доступ к информации о Заявках, адресованных указанному Участнику торгов.

23.4. При подаче Заявки в Систему проведения торгов Заявка на покупку и Заявка на продажу должны содержать:

- указание на Код Участника торгов, подавшего Заявку;

- указание на Краткий код (коды) Клиента (Клиентов), за счет которого (которых) подана Заявка (в случае если Участник торгов действует за счет Клиентов);

- указание на Идентификатор Участника торгов, подавшего Заявку;

- указание на направленность Заявки (Заявка на покупку или Заявка на продажу);

- указание на Идентификационный код Срочного контракта;

- количество Срочных контрактов, выраженное в Торговых лотах;

- указание на Торгово-клиринговый счет;

- цену за один Срочный контракт;

- указание на Режим торгов, в котором подается Заявка;

- указание на валюту цены;

- указание на валюту расчетов;

- указание на Идентификатор адресных сделок Участника торгов, которому адресована Заявка;

- указание на Идентификатор адресных сделок Участника торгов, подавшего Заявку;

- иные сведения в случаях, предусмотренных настоящими Правилами.

23.5. Заявка может содержать ссылку, под которой понимается последовательность символов, дополнительно используемая для установления соответствия Объявленных Заявок друг другу в соответствии с настоящими Правилами.

23.6. В Режиме переговорных сделок ПФИ две разнонаправленные Заявки являются встречными при совпадении параметров, указанных в пунктах 11.2.1 – 11.2.2 настоящих Правил, а также при совпадении следующих параметров:

- количества Срочных контрактов, выраженного в Торговых лотах, указанного в Заявках;
- цены за один Срочный контракт, указанной в Заявках;
- Идентификатора адресных сделок Участника торгов, объявившего Заявку, указанного в одной из Заявок, и Идентификатора адресных сделок Участника торгов, которому адресована встречная Заявка, указанного в другой Заявке;
- ссылки (в случае указания хотя бы в одной из Заявок).

## **Статья 24. Порядок заключения Договоров**

24.1. Договоры в Режиме переговорных сделок ПФИ заключаются в порядке, установленном в статье 11 настоящих Правил и в настоящей статье.

24.2. Договор в Режиме переговорных сделок ПФИ заключается на основании двух разнонаправленных Заявок, являющихся встречными в соответствии с пунктом 23.6 настоящих Правил.

24.3. Договоры заключаются по цене и в отношении количества Срочных контрактов, указанных во встречных Заявках.

В случае, когда объявлены две Заявки, содержащие одинаковые цены и количество Срочных контрактов, Договоры заключается на основании Заявки, объявленной ранее.

24.4. При получении адресной Заявки Участник торгов вправе отклонить полученную Заявку.

24.5. В случае если в течение Торгов Заявка не была исполнена, указанная Заявка подлежит аннулированию Биржей по окончании Торгового дня.

24.6. Режим переговорных сделок ПФИ может состоять из периода, в течение которого Участники торгов вправе подавать Заявки, в которых указаны одинаковые ТКС (далее – Внутриброкерский РПС). Возможность проведения периода Внутриброкерский РПС может быть установлена решением Биржи для одного или нескольких Срочных контрактов и (или) для одной или нескольких Групп инструментов.

Для целей установления соответствия Заявок друг другу и заключения Договоров ПФИ в рамках периода Внутриброкерский РПС встречными Заявками могут являться две разнонаправленные Заявки при совпадении параметров, указанных в пункте 23.6 настоящих Правил, а также при совпадении ТКС, указанных в данных Заявках.

24.7. Режим переговорных сделок ПФИ может состоять из периода, в течение которого Договоры ПФИ заключаются между Участниками торгов и Центральным контрагентом. Договор ПФИ заключается на основании Заявки, адресованной Участником торгов Центальному контрагенту, и Заявки, подаваемой Центральным контрагентом в адрес Участника торгов (далее – «РПС с ЦК Режиме переговорных сделок»).

В Заявках, подаваемых Участниками торгов, должно содержаться указание на Идентификатор адресных сделок Участника торгов, однозначно идентифицирующий Центрального контрагента.

Возможность проведения периода РПС с ЦК Режиме переговорных сделок ПФИ может быть установлена решением Биржи для одного или нескольких Срочных контрактов и (или) для одной или нескольких Групп инструментов.

Для целей установления соответствия Заявок друг другу и заключения Договоров в рамках периода РПС с ЦК Режиме переговорных сделок ПФИ встречными Заявками могут являться две разнонаправленные Заявки при совпадении параметров, указанных в пункте 23.6 настоящих Правил, а также при условии, что один из Идентификаторов адресных сделок Участника торгов, указанных в Заявках, однозначно определяет Центрального контрагента.

24.8. В реестре Договоров может содержаться информация, указанная в пункте 23.5. настоящих Правил.

## **Глава IX. Иные положения**

### **Статья 25. Приостановка, возобновление и прекращение Торгов**

25.1. Под приостановкой Торгов в рамках настоящей статьи понимается временное отсутствие возможности проводить Торги в результате возникновения обстоятельств, указанных в настоящей статье.

Под прекращением Торгов в рамках настоящей статьи понимается невозможность проведения Торгов в течение и до конца текущего Торгового дня, если законодательством Российской Федерации или решением Биржи не предусмотрен иной срок.

25.2. Биржа приостанавливает или прекращает Торги в случаях, предусмотренных нормативными актами Банка России, и в сроки, определённые в соответствии с такими нормативными актами.

Требования о прекращении или приостановлении Торгов распространяются на основную и дополнительные торговые сессии.

25.3. Биржа вправе принять решение о приостановке Торгов при возникновении обстоятельств, которые нарушают или могут нарушить нормальный порядок проведения Торгов, к которым в частности, относятся:

- технические сбои и (или) ошибки в работе Системы проведения торгов, сбои в работе информационно-коммуникационных средств связи, с помощью которых обеспечивается проведение Торгов, или иных средств, обеспечивающих нормальный порядок проведения Торгов;

- сбои в работе энергоснабжения;

обстоятельства непреодолимой силы, в том числе введение чрезвычайного или военного положения, наступление иных обстоятельств природного и (или) техногенного характера;

- нефункционирование или ненадлежащее функционирование Клиринговой организации, Расчетной организации и/или иных организаций, которые могут повлиять на нормальный порядок проведения Торгов;

- фактическая невозможность проведения Торгов, возникшая до времени начала проведения Торгов в связи с наличием технических сбоев и (или) ошибок в работе Системы проведения торгов и приводящая к необходимости сдвига времени начала проведения Торгов;

- любые обстоятельства, которые могут привести к ненадлежащему функционированию программных средств и (или) оборудования, необходимых для проведения Торгов;

- иные обстоятельства, которые могут привести к нарушению порядка проведения Торгов.

25.4. Биржа вправе принять решение о приостановке Торгов в случае получения от Клиринговой организации информации о необходимости изменений верхнего и (или) нижнего лимитов колебаний цены ценной бумаги, являющейся Базисным активом Срочного контракта, или Срочного контракта (если применимо).

25.5. Биржа приостанавливает Торги при возникновении технических сбоев в работе Системы проведения торгов, которые оказывают влияние или могут оказать влияние на ход Торгов, установленный в соответствии с настоящими Правилами, в течение Торгового дня в отношении большинства Участников торгов.

При возникновении указанных технических сбоев Торги приостанавливаются в течение 5 (пяти) минут с момента выявления технического сбоя.

25.6. Если в течение текущего Торгового дня приостановленные Торги были возобновлены менее чем за один час до окончания основной торговой сессии, Биржа вправе продлить основную торговую сессию после истечения времени, предусмотренного настоящими Правилами, для ее проведения. Информация о продлении основной торговой сессии раскрывается на сайте Биржи в сети Интернет и (или) посредством Системы проведения торгов.

25.7. Биржа принимает решение о признании технического сбоя при наступлении следующего события, следствием которого не стала приостановка Торгов:

- невозможность раскрытия и предоставления Биржей информации, требуемой к раскрытию на сайте Биржи в сети Интернет в связи с возникновением технических сбоев и (или) ошибок в работе сайта Биржи в сети Интернет.

25.8. О приостановке Торгов / о технических сбоях, указанных в пункте 25.7. настоящих Правил, Участники торгов извещаются с использованием Системы проведения торгов и (или) путем опубликования соответствующего сообщения на сайте Биржи в сети Интернет, (или) другим доступным способом с учётом требований законодательства Российской Федерации.

О невозможности раскрытия и предоставления Биржей информации, требуемой к раскрытию на сайте Биржи в сети Интернет, Участники торгов извещаются в течение 15 (пятнадцати) минут с момента обнаружения указанной невозможности.

25.9. Биржа вправе приостанавливать Торги в целях проведения клиринговых сессий, время и порядок проведения которых установлены внутренними документами Клиринговой организации.

25.10. После устранения (прекращения) обстоятельств, послуживших причиной приостановки Торгов, Торги возобновляются.

О возобновлении Торгов Участники торгов извещаются не позднее чем за 15 (пятнадцать) минут до возобновления Торгов с использованием Системы проведения торгов и (или) путем опубликования соответствующего сообщения на сайте Биржи в сети Интернет, и (или) другим доступным способом с учётом требований законодательства Российской Федерации.

До возобновления Торгов Биржа предоставляет Участникам торгов возможность отозвать Объявленные Заявки посредством Системы проведения торгов. Отзыв Заявок осуществляется в порядке и в сроки, предусмотренные настоящими Правилами и требованиями законодательства Российской Федерации.

В случае невозможности отозвать Объявленные Заявки посредством Системы проведения торгов Участник торгов может предоставить Бирже заявление на отзыв объявленных им Заявок в форме Электронного документа посредством Системы электронного документооборота, при условии подключения Сторон к данной системе или по телефону.

25.11. В случае если в течение 20 (двадцати) минут обстоятельства, послужившие основанием для приостановки Торгов, не устранены, Биржа вправе принять решение о досрочном прекращении Торгов.

Извещение Участников торгов о досрочном прекращении Торгов осуществляется способом, указанным в пункте 25.8. настоящих Правил.

25.12. Информация о прекращении Торгов всеми Срочными контрактами, в том числе в отдельном Режиме торгов, раскрывается на сайте Биржи в сети Интернет не позднее одного Торгового дня, следующего за днем принятия Биржей соответствующего решения, и не позднее, чем за один месяц до даты прекращения Торгов.

Информация о прекращении торгов Срочным контрактом раскрывается на сайте Биржи в сети Интернет не позднее одного Торгового дня, следующего за днем принятия Биржей соответствующего решения.

## **Статья 26. Биржевая информация**

26.1. Биржа является обладателем всей информации, связанной с ходом и итогами Торгов.

26.2. Биржа, Участники торгов и (или) Клиенты вправе предоставлять информацию, связанную с ходом и итогами Торгов, а также производную информацию, созданную на основе информации, связанной с ходом и итогами Торгов, своим Клиентам для целей участия в Торгах и принятия решения о подаче Заявок и (или) заключении Договоров.

Предоставление информации, связанной с ходом и итогами Торгов, а также производной информации, созданной на основе информации, связанной с ходом и итогами Торгов, лицам, не указанным в настоящем пункте Правил, и (или) для целей, не предусмотренных настоящим пунктом Правил, и распространение указанной информации неограниченному кругу лиц возможно только на основании договора с Биржей.

26.3. В случае нарушения Участником торгов пункта 26.2 настоящих Правил Биржа вправе требовать от Участника торгов возмещения убытков, возникших у Биржи в связи с таким нарушением.

26.4. Не является распространением информации и не влечет применение мер ответственности в соответствии со статьей 26.3 настоящих Правил предоставление Участником торгов своему Клиенту информации о ходе Торгов в объеме, необходимом для принятия решения о заключении Договоров, а также об итогах Торгов в отношении Договоров, которые были заключены за счет этого Клиента.

26.5. После окончания Торгового дня Биржа раскрывает на сайте Биржи в сети Интернет информацию об итогах Торгов в объеме, сроках и порядке, установленных требованиями законодательства Российской Федерации.

26.6. Биржа вправе раскрывать в Системе проведения торгов информацию обо всех Договорах, заключенных в текущий Торговый день, без указания Кодов Участников торгов и Кодов Клиентов, которые присвоены им в порядке, предусмотренном законодательством Российской Федерации и документами Биржи.

26.7. Биржа вправе утвердить внутренний документ, определяющий порядок и условия предоставления, распространения и использования информации, связанной с ходом и итогами Торгов, обязательный для исполнения всеми заинтересованными лицами.

## **Статья 27. Информация о Торгах**

27.1. Биржа каждый Торговый день представляет Участнику торгов выписку из реестра Договоров, содержащую информацию о Договорах, заключенных данным Участником торгов на Торгах в течение соответствующего Торгового дня. Выписка из реестра Договоров о Договорах, заключенных данным Участником торгов, предоставляется Участнику торгов посредством Системы проведения торгов в режиме реального времени или посредством Системы электронного документооборота. Выписка из реестра Договоров о Договорах, заключенных данным Участником торгов, считается предоставленной Участнику торгов в момент регистрации Договора в реестре Договоров. Реестр Договоров, заключенных Участником торгов в течение Торгового дня, представляет собой совокупность сведений, содержащихся в отчетах обо всех таких Договорах, и считается предоставленным Участнику торгов с момента предоставления ему указанных отчетов.

27.2. Выписки из реестра Договоров содержат все сведения, указанные в статье 12 настоящих Правил.

27.3. Биржа вправе в дополнение к информации, содержащейся в выписках из реестра Договоров предоставлять Участникам торгов дополнительные отчеты, состав информации, порядок, формы и сроки предоставления которых устанавливаются внутренними документами Биржи и подлежат опубликованию на сайте Биржи в сети Интернет.

#### **Статья 28. Определение тарифов Биржи**

28.1. Участник торгов обязуется оплачивать услуги Биржи по проведению Торгов.

28.2. Оплата услуг Биржи по проведению Торгов осуществляется в виде разовых и периодических платежей, в том числе биржевого сбора, в соответствии с тарифами, установленными Советом директоров Биржи (далее - Тарифы).

28.3. Тарифы подлежат опубликованию на сайте Биржи в сети Интернет. В случае внесения изменений в Тарифы Биржа извещает Участников торгов об изменении Тарифов не менее чем за 3 (три) рабочих дня до вступления указанных Тарифов в силу.

28.4. Биржа вправе в одностороннем порядке изменять размер Тарифов.

#### **Статья 29. Порядок оплаты услуг Биржи**

29.1. Биржевой сбор удерживается с торговых или клиринговых счетов в порядке, определенном в Правилах клиринга.

29.2. Уплата иных платежей в оплату услуг Биржи, помимо определенных в соответствии с пунктом 28.2 настоящих Правил, осуществляется не позднее 5 (пяти) рабочих дней со дня выставления Участнику торгов соответствующего счета.

29.3. Временной период оказания услуг Биржи (расчетный период для биржевого сбора и иных периодических платежей) устанавливается равным 1 (одному) календарному месяцу.

29.4. Неисполнение или ненадлежащее исполнение обязанностей по оплате услуг Биржи в связи с отсутствием или недостаточностью денежных средств на счетах, определенных в пункте 29.1. настоящих Правил, является основанием для применения мер ответственности к Участнику торгов в соответствии с настоящими Правилами и Правилами допуска.

29.5. Услуги считаются оказанными Участнику торгов надлежащим образом за истекший календарный месяц, если в течение 5 (пяти) рабочих дней после его окончания Участник торгов письменно не заявит об обратном.

#### **Статья 30. Порядок осуществления контроля за Участниками торгов и контроля за операциями**

30.1. Биржа осуществляет контроль за Участниками торгов и за операциями, совершаемыми Участниками торгов в ходе проведения Торгов, в соответствии с внутренними документами, утвержденными Биржей.

30.2. В целях предотвращения, выявления и пресечения неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком Биржа осуществляет контроль за операциями со Срочными контрактами, осуществляемыми на Торгах. При осуществлении такого контроля Биржа:

- устанавливает правила предотвращения, выявления и пресечения случаев неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком, в том числе критерии сделок (заявок), имеющих признаки неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком (далее – нестандартные сделки (заявки));

- осуществляет проверку нестандартных сделок (заявок) на предмет неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком;

- направляет в Банк России уведомления о результатах проведенных проверок выявленных нестандартных сделок (заявок). Требования к содержанию уведомления, а также порядок и сроки его представления в Банк России определяются нормативными актами Банка России.

30.3. При осуществлении контроля, предусмотренного настоящей статьей, Биржа, вправе:

- требовать от Участников торгов представления необходимых документов (в том числе полученных Участником торгов от его Клиента), объяснений, информации соответственно в письменной и устной форме;

- осуществлять иные действия, направленные на предупреждение, выявление и пресечение нарушений требований Федерального закона «Об организованных торгах» и принятых в соответствии с ним нормативных актов, Федерального закона от 27.07.2010 № 224-ФЗ «О противодействии неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком и о внесении изменений в отдельные законодательные акты Российской Федерации», а также внутренних документов Биржи.

30.4. Участники торгов обязаны определить должностное лицо, ответственное за осуществление контроля за соблюдением требований Федерального закона от 27.07.2010 № 224-ФЗ «О противодействии неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком и о внесении изменений в отдельные законодательные акты Российской Федерации» и принятых в соответствии с ним нормативных актов, а также установить порядок осуществления им своих функций.

30.5. Участники торгов, имеющие основания полагать, что операция, осуществляемая от их имени, но на счет Клиента, осуществляется с неправомерным использованием инсайдерской информации и (или) является манипулированием рынком, обязаны уведомить Банк России о такой операции. Порядок уведомления, сроки направления уведомления и содержание уведомления определяются Банком России.

30.6. При осуществлении мониторинга организованных торгов, а также контроля за Участниками торгов и иными лицами Биржа осуществляет следующие действия:

- выявляет нестандартные сделки (заявки), заключенные (поданные) в ходе Торгов;
- проверяет нестандартные сделки (заявки) на предмет неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком;
- проверяет нестандартные сделки (заявки) на предмет нарушения внутренних документов Биржи.

30.7. Если в ходе проверки нестандартной сделки (заявки) выявляется, что полномочий Биржи для установления правомерности действий сторон по Договору недостаточно либо оказывается противодействие в проведении проверки, Биржа направляет все имеющиеся материалы по нестандартной сделке (заявке) в Банк России.

30.8. При наличии оснований квалифицировать нестандартную сделку (заявку) как нарушение внутренних документов Биржи, Биржа принимает решение о применении мер к Участникам торгов, являющимся сторонами Договора или подавшими Заявки.

30.9. К нестандартным сделкам (Заявкам), которые могут быть квалифицированы как нарушения настоящих Правил и иных внутренних документов Биржи могут относиться Договоры, приведшие к существенному изменению текущей цены.

30.10. В целях предотвращения и пресечения неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком Участник торгов должен соблюдать следующие правила:

- Участник торгов не вправе осуществлять действия, относящиеся к манипулированию рынком в соответствии с Федеральным законом «О противодействии неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком и о внесении изменений в отдельные законодательные акты Российской Федерации».
- Участник торгов не вправе использовать инсайдерскую информацию для подачи Заявок и заключения Договоров на Торгах.

### **Статья 31. Ответственность**

31.1. За нарушение правил совершения операций на Бирже Участник торгов несет ответственность, предусмотренную настоящими Правилами и законодательством Российской Федерации.

31.2. Биржа не несет ответственности в случае невозможности исполнения своих обязательств по оказанию услуг по организации Торгов, возникшей в результате обстоятельств, указанных в пунктах 25.3 и 25.5. настоящих Правил.

31.3. В случае неисполнения Участниками торгов обязательств, возникших из заключенных Договоров, а также при наличии у Биржи оснований квалифицировать нестандартную сделку (заявку) как нарушение внутренних документов Биржи, Биржа вправе принять решение о применении к Участникам торгов одну из следующих мер воздействия:

- предупреждение;
- приостановление допуска к участию в Торгах, в том числе в одном или нескольких Режимов торгов, одной или нескольких торговых сессиях, и (или) в отдельных периодах проведения Торгов, и (или) к подаче Заявок по одному или нескольким Срочным контрактам и (или) Группе инструментов, и (или) к заключению отдельных Договоров;
- прекращение допуска к участию в Торгах на Бирже.

31.4. Биржа осуществляет раскрытие информации о нарушениях, совершенных Участниками торгов, и принятых к ним мерах, в сроки и порядке, предусмотренные законодательством Российской Федерации.

### **Статья 32. Порядок разрешения споров**

32.1. Все споры, разногласия и требования, возникающие в связи с оказанием Биржей услуг в соответствии с настоящими Правилами, с заключением, изменением или прекращением

Договоров, а также исполнением обязательств из Договоров или в связи с ними, подлежат разрешению в порядке арбитража (третейского разбирательства), администрируемого Арбитражным центром при Российском союзе промышленников и предпринимателей (далее – Арбитражный центр при РСПП) в соответствии с его правилами, действующими на дату подачи искового заявления.

32.2. Передача споров на разрешение в Арбитражный центр при РСПП возможна только после соблюдения предварительного претензионного порядка урегулирования споров. В случае полного или частичного отказа в удовлетворении претензии или неполучения ответа в течение 7 (семи) рабочих дней с момента получения претензии заявитель вправе предъявить иск в Арбитражный центр при РСПП.

32.3. Решения Арбитражного центра при РСПП являются окончательными и обязательными для сторон. Неисполненное добровольно решение Арбитражного центра при РСПП подлежит принудительному исполнению в соответствии с законодательством Российской Федерации или законодательством страны места принудительного исполнения и международными соглашениями.

32.4. Участники торгов обязаны воздерживаться от действий, направленных на затягивание процесса рассмотрения спора в Арбитражном центре при РСПП, а в случае вынесения Арбитражным центром при РСПП решения – на затягивание сроков исполнения определений и решений, вынесенных Арбитражным центром при РСПП.

### **Статья 33. Общие правила использования информации**

33.1. Настоящей статьей устанавливаются общие положения, касающиеся обеспечения конфиденциальности информации, которая стала известна Бирже в связи с оказанием услуг по проведению Торгов в соответствии с пунктом 2.4. настоящих Правил, в том числе была предоставлена Бирже Участниками торгов, Клиринговой организацией и (или) техническим центром.

33.2. К указанной информации относится, в частности, информация об Участнике торгов как в отношении себя лично, так и в отношении Клиентов Участника торгов, информация, полученная в соответствии с Правилами допуска, а также иная информация, которая стала известна в связи с оказанием Биржей услуг по проведению Торгов (далее в настоящей статье - Информация).

33.3. Участник торгов, заключая договор об оказании услуг по проведению Торгов, соглашается с тем, что Информация или ее часть может быть предоставлена Клиринговой организации, техническому центру и (или) иным юридическим лицам, оказывающим Бирже аутсорсинговые, консультационные и (или) иные услуги на основании заключаемых с такими юридическими лицами договоров.

33.4. Информация предоставляется Бирже в Банк России по его запросу, соответствующему требованиям Федерального закона «Об организованных торгах».

33.5. Информация может быть предоставлена Биржей в суды и арбитражные суды (судьям), а при наличии согласия руководителя следственного органа - в органы предварительного следствия по делам, находящимся в их производстве, а также в органы внутренних дел при осуществлении ими функций по выявлению, предупреждению и пресечению налоговых преступлений, а также иным лицам в соответствии с требованиями федеральных законов.

33.6. Наличие у Биржи Информации является необходимым условием оказания услуг по проведению Торгов.

33.7. Участник торгов подтверждает и уполномочивает Биржу частично и (или) полностью предоставлять сведения, составляющие персональные данные физических лиц - Клиентов Участника торгов, необходимые для исполнения Биржей своих обязательств, Клиринговой организации, техническому центру и (или) иным юридическим лицам, оказывающим Бирже аутсорсинговые, консультационные и (или) иные услуги на основании заключаемых с такими юридическими лицами договоров. Биржа и иные юридические лица, получившие сведения, составляющие персональные данные физических лиц - Клиентов Участника торгов, обязуются обеспечить конфиденциальность обрабатываемых ими персональных данных, соблюдение требований к обработке персональных данных, установленных Федеральным законом № 152-ФЗ от 27.07.2006 г. «О персональных данных», и несут ответственность за принятие всех необходимых правовых, организационных и технических мер их защиты от неправомерного или случайного доступа к ним, уничтожения, изменения, блокирования, копирования, распространения персональных данных, а также от иных неправомерных действий с такими данными. Биржа и указанные юридические лица, получившие сведения, составляющие персональные данные физических лиц - Клиентов Участника торгов, обязуются принимать необходимые правовые, организационные и технические меры или обеспечивать их принятие для защиты персональных данных при их передаче посредством электронных каналов связи, машинных и (или) бумажных носителей информации или иным способом.

Участник торгов гарантирует наличие у него согласий физических лиц - Клиентов Участника торгов, являющихся субъектами персональных данных, на обработку и передачу их персональных данных Бирже, в Клиринговую организацию, техническому центру и (или) иным юридическим лицам, оказывающим Бирже аутсорсинговые, консультационные и (или) иные услуги на основании заключаемых с такими юридическими лицами договоров.

Участник торгов обязуется предоставить согласия и иные документы, подтверждающие правовые основания обработки персональных данных физических лиц - Клиентов Участника торгов, по письменному запросу Биржи в срок не позднее 10 (десяти) рабочих дней с момента направления запроса.

### **Порядок использования АСП**

1. Настоящее Приложение устанавливает порядок использования АСП на Торгах, а также способ и периодичность идентификации Участников торгов.

2. АСП используется при подаче (направлении) с использованием Системы проведения торгов Заявок или иных электронных сообщений, предусмотренных настоящими Правилами. Заявка или иное электронное сообщение, подписанное АСП, признается электронным документом, равнозначным документу на бумажном носителе, подписанному собственноручной подписью уполномоченного лица Участника торгов.

3. Заявка или иное электронное сообщение считается подписанным АСП с момента отправки Участником торгов в Систему проведения торгов такой Заявки или иного электронного сообщения при условии успешного прохождения Участником торгов процедуры аутентификации в порядке, предусмотренном настоящим Приложением.

4. Присвоение Имени и Пароля Участнику торгов осуществляется техническим центром, определенным Биржей, информация о котором раскрыта на сайте Бирже в сети Интернет (далее – технический центр), на основании договора (соглашения), заключенного между Участником торгов и техническим центром, посредством внесения указанных Имени и Пароля в базу данных Системы проведения торгов.

5. Процедура аутентификации осуществляется техническим центром с использованием Системы проведения торгов при осуществлении технического доступа Участника торгов в Систему проведения торгов путем сопоставления введенных Имени и Пароля соответствующим Имени и Паролю Участника торгов, информация о которых содержится в базе данных Системы проведения торгов. В случае успешного прохождения процедуры аутентификации Участник торгов получает возможность доступа к Системе проведения торгов. Аутентификация Участника торгов осуществляется автоматическим способом при каждом входе Участника торгов в Систему проведения торгов.

6. Участник торгов соглашается с тем, что техническим центром могут быть изготовлены (распечатаны) копии Заявок или иных электронных сообщений, подписанных АСП, на бумажном носителе, которые удостоверяются подписью уполномоченного лица технического центра и являются доказательством факта направления Заявки или иного электронного сообщения с использованием Системы проведения торгов, а также подтверждают соответствие Заявки или иного электронного сообщения содержанию копии Заявки или иного электронного сообщения, изготовленного (распечатанного) на бумажном носителе.

7. Участник торгов обязуется хранить в тайне присвоенные им Пароль (Пароли) и несут риск последствий, вызванных нарушением тайны Пароля (Паролей). В случае нарушения тайны Пароля Участник торгов обязан незамедлительно уведомить об этом технический центр. Технический центр в этом случае присваивает Участнику торгов новый Пароль.