



УТВЕРЖДЕН

Президентом Закрытого акционерного
общества «Санкт-Петербургская
Международная
Товарно-сырьевая Биржа»
«04» августа 2014 г. (Приказ № 222)

Президент ЗАО «СПбМТСБ»



А.Э. Рыбников А.Э. Рыбников

**Порядок организации мониторинга организованных
торгов и контроля за участниками торгов**

в ЗАО «СПбМТСБ»

Москва
2014

1. Общие положения

1.1. Настоящий Порядок организации мониторинга организованных торгов и контроля за участниками торгов в ЗАО «СПбМТСБ» (далее - Порядок) разработан в соответствии с Федеральным законом от 21 ноября 2011 года № 325-ФЗ «Об организованных торгах», Федеральным законом от 27 июля 2010 года № 224-ФЗ «О противодействии неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком и о внесении изменений в отдельные законодательные акты Российской Федерации», а также правилами проведения организованных торгов в Секциях срочного и товарного рынков ЗАО «СПбМТСБ» (далее - Правила торгов) и иными внутренними документами ЗАО «СПбМТСБ».

1.2. Для целей Порядка используются термины и определения Правил торгов, а также иных внутренних документов Закрытого акционерного общества «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа», регламентирующих проведение торгов в ЗАО «СПбМТСБ».

1.3. Настоящий Порядок определяет порядок мониторинга проводимых в ЗАО «СПбМТСБ» организованных торгов с целью выявления действий Участников торгов, имеющих признаки манипулирования ценами и (или) неправомерного использования инсайдерской информации. Порядок определяет критерии сделок (заявок), имеющих признаки манипулирования ценами и (или) неправомерного использования инсайдерской информации (далее - нестандартные сделки (заявки), а также порядок проведения проверки нестандартных сделок (заявок) на предмет манипулирования ценами и (или) неправомерного использования инсайдерской информации.

1.4. Порядок применяется в отношении заявок (сделок), подаваемых (заключаемых) на организованных торгах, проводимых в Секциях срочного и товарного рынков ЗАО «СПбМТСБ» в соответствии с Правилами торгов.

1.5. Порядок, а также изменений и дополнений в Порядок, утверждаются Президентом ЗАО «СПбМТСБ» и подлежат регистрации в Банке России. Порядок (изменения и дополнения в Порядок) вступают в силу в дату, определяемую Президентом ЗАО «СПбМТСБ», которая не может быть ранее даты регистрации Порядка (изменений и дополнения в Порядок) в Банке России.

О вступлении в силу Порядка, а также изменений и дополнений в Порядок, Участники торгов, а также Банк России оповещаются не позднее, чем за 5 (пять) рабочих дней до дня вступления в силу Порядка (изменений и дополнений в Порядок), если иное не установлено Президентом ЗАО «СПбМТСБ» или лицом, его замещающим.

2. Об организации мониторинга организованных торгов и контроля за Участниками торгов

2.1. В целях снижения рисков при проведении торгов в ЗАО «СПбМТСБ» создана система мониторинга и контроля, которая включает мониторинг организованных торгов и контроль за Участниками торгов, осуществляемый в соответствии с требованиями законодательных актов Российской Федерации и внутренних документов Биржи.

2.2. Под мониторингом организованных торгов в ЗАО «СПбМТСБ» понимается совокупность организационно-технических мероприятий, направленных на непрерывное отслеживание при проведении биржевых торгов цен, объемов и иных характеристик регистрируемых в ЗАО «СПбМТСБ» сделок и заявок, к которым относятся:

- выявление сделок (заявок), параметры и условия которых подпадают под установленные критерии, указанные в Приложениях № 1 и № 2 к настоящему Порядку;
- выявление случаев нарушения законодательных актов Российской Федерации об организованных торгах, нормативных актов Банка России и иных нормативных правовых актов Российской Федерации, требований внутренних документов ЗАО «СПбМТСБ», регламентирующих организацию и проведение организованных торгов в ЗАО «СПбМТСБ».

2.3. Должностное лицо, ответственное за осуществление контроля соблюдения требований по противодействию неправомерному использованию инсайдерской информации, обеспечивает проведение мероприятий, направленных на выявление нестандартных сделок (заявок) в следующих случаях:

- по результатам биржевых торгов за каждый торговый день;
- при поступлении обращения (жалобы, заявления) Участника торгов на неправомерное использование инсайдерской информации и/или манипулирование рынком;
- по требованию Банка России.

2.4. В случае выявления нестандартных сделок (заявок) ЗАО «СПбМТСБ» проводится проверка таких сделок (заявок) на предмет манипулирования рынком и (или) неправомерного использования инсайдерской информации в порядке, предусмотренном Правилами торгов и настоящим Порядком.

2.5. Контроль за Участниками торгов представляет собой совокупность действий по получению информации от Участников торгов и регулярной проверке актуальности представленной информации. Контроль осуществляется в порядке, установленном в Разделе 4 настоящего Порядка.

3. Порядок действий при выявлении нестандартных сделок (заявок)

3.1. ЗАО «СПбМТСБ» направляет в Банк России уведомления обо всех выявленных в течение каждого торгового дня нестандартных сделках (заявках).

3.2. При выявлении нестандартной сделки (заявки) ЗАО «СПбМТСБ» направляет запросы Участнику торгов, которым были поданы соответствующие заявки (совершены сделки) о предоставлении документов и сведений, прямо или косвенно касающиеся таких сделок (заявок), и раскрывающих причины совершения им нестандартной сделки/подачи заявки (включая поручение клиента Участника торгов, на основании которого была подана заявка - если заявка подана Участником торгов на совершение сделки по поручению и за счет клиента), а также о наличии в его действиях признаков манипулирования рынком и

(или) неправомерного использования инсайдерской информации, нарушений законов, нормативных актов Банка России и иных нормативных правовых актов Российской Федерации, а также требований внутренних документов ЗАО «СПбМТСБ».

3.3. ЗАО «СПбМТСБ» осуществляет проверку нестандартных сделок в сроки, установленные нормативными актами Банка России и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации. В том случае, если сроки не установлены нормативными актами Банка России и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации, то сроки проверки не должны превышать:

- 30 рабочих дней со дня получения от Участника торгов ответа на запрос ЗАО «СПбМТСБ», направленный в ходе проведения проверки нестандартной сделки; или
- 45 рабочих дней со дня направления запроса – в случае неполучения от Участника торгов ответа на запрос ЗАО «СПбМТСБ» в установленный срок.

3.4. В случае предоставления Участником торгов неудовлетворительных объяснений в отношении совершенных им действий или неполучения от Участника торгов объяснений в установленный срок, или при наличии оснований квалифицировать действия Участника торгов как нарушение Правил торгов, ЗАО «СПбМТСБ» имеет право применить к Участнику торгов меры ответственности, установленные Правилами торгов и/или обратиться в Банк России.

3.5. Не позднее рабочего дня, следующего за днем окончания проверки нестандартной сделки (заявки), в Банк России направляется копия отчета о результатах проверки нестандартной сделки (заявки). В отчете отражается наличие или отсутствие в действиях Участников торгов оснований квалифицировать нестандартную сделку (заявку) как заключенную (поданную) путем совершения действий, которые могут быть признаны манипулированием рынком, либо путем неправомерного использования при совершении нестандартной сделки (подаче заявки) инсайдерской информации.

3.6. Если в ходе проверки нестандартной сделки (заявки) полномочий ЗАО «СПбМТСБ» недостаточно для установления правомерности действий сторон по сделке либо ЗАО «СПбМТСБ» оказывается противодействие в проведении проверки, ЗАО «СПбМТСБ» вправе направлять все имеющиеся материалы анализа обстоятельств совершения нестандартной сделки (заявки) в Банк России.

4. Порядок контроля за участниками торгов и иными лицами

4.1. Контроль за Участниками торгов и иными лицами осуществляется путем сбора и анализа финансовой и иной отчетности, а также других документов, указанных в настоящем Порядке и нормативных актах Банка России и иных нормативных правовых актов Российской Федерации.

4.2. Юридические лица, обратившиеся с заявлением о предоставлении права участия в организованных торгах Закрытого акционерного общества «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа», обязаны представить в ЗАО «СПбМТСБ» для прохождения идентификации следующие документы:

- нотариально удостоверенные или заверенные регистрирующим органом копии учредительных документов, изменений и дополнений в них (если они вносились);

- нотариально удостоверенную или заверенную регистрирующим органом копию свидетельства о внесении юридического лица в Единый государственный реестр юридических лиц;
- оригинал выписки из Единого государственного реестра юридических лиц, выданной органом, осуществляющим государственную регистрацию юридических лиц, и датированной не ранее чем за 30 дней календарных дней до даты ее предоставления в ЗАО «СПБМТСБ»;
- нотариально удостоверенную копию свидетельства о постановке на налоговый учет и присвоении идентификационного номера налогоплательщика;
- заверенные копии бухгалтерского баланса (форма №1) и отчета о финансовых результатах (форма № 2) за последний отчетный год (с отметками налогового органа о принятии);
- заверенные копии бухгалтерского баланса (форма №1) и отчета о финансовых результатах (форма № 2) на последнюю отчетную дату;
- выписку из книги учета доходов и расходов организаций, применяющих упрощенную систему налогообложения, содержащую итоги деятельности за последний отчетный год и на последнюю отчетную дату.

4.3. Индивидуальные предприниматели, обратившиеся с заявлением о предоставлении права участия в организованных торгах ЗАО «СПБМТСБ», обязаны представить в ЗАО «СПБМТСБ» для прохождения идентификации следующие документы:

- копию основного документа, удостоверяющего личность гражданина Российской Федерации;
- нотариально удостоверенную или заверенную органом, осуществляющим государственную регистрацию физических лиц в качестве индивидуальных предпринимателей, копию свидетельства, подтверждающего государственную регистрацию физического лица в качестве индивидуального предпринимателя;
- нотариально удостоверенную копию свидетельства о постановке физического лица на учет в налоговом органе и присвоении идентификационного номера налогоплательщика;
- оригинал выписки из Единого государственного реестра индивидуальных предпринимателей, выданной органом, осуществляющим государственную регистрацию физических лиц в качестве индивидуальных предпринимателей, и датированной не ранее чем за 30 дней календарных дней до даты ее предоставления в ЗАО «СПБМТСБ»;
- заверенные копии бухгалтерского баланса (форма №1) и отчета о финансовых результатах (форма № 2) за последний отчетный год (с отметками налогового органа о принятии);
- заверенные копии бухгалтерского баланса (форма №1) и отчета о финансовых результатах (форма № 2) на последнюю отчетную дату;

- заверенные индивидуальным предпринимателем выписки из книги учета доходов и расходов и хозяйственных операций индивидуального предпринимателя или выписки из книги учета доходов и расходов индивидуальных предпринимателей, применяющих упрощенную систему налогообложения, содержащие итоги деятельности за последний отчетный год и на последнюю отчетную дату.

4.4. Участники торгов для подтверждения достоверности сведений, имеющихся у ЗАО «СПбМТСБ», ежегодно обязаны предоставлять:

- скан-копию оригинала выписки из Единого государственного реестра юридических лиц, выданной органом, осуществляющим государственную регистрацию юридических лиц, и датированной не ранее чем за 30 дней календарных дней до даты ее представления в ЗАО «СПбМТСБ» (для юридических лиц);
- скан-копию оригинала выписки из Единого государственного реестра индивидуальных предпринимателей, выданной органом, осуществляющим государственную регистрацию физических лиц в качестве индивидуальных предпринимателей, и датированной не ранее чем за 30 дней календарных дней до даты ее представления в ЗАО «СПбМТСБ» (для индивидуальных предпринимателей).

4.5. При мониторинге финансового состояния Участников торгов ЗАО «СПбМТСБ» вправе затребовать:

- скан-копии бухгалтерского баланса (форма №1) и отчета о финансовых результатах (форма № 2) за последний отчетный год (с отметками налогового органа о принятии);
- скан-копии выписки из книги учета доходов и расходов и хозяйственных операций индивидуального предпринимателя;
- скан-копии выписки из книги доходов и расходов организаций и индивидуальных предпринимателей, применяющих упрощенную систему налогообложения.

4.6. ЗАО «СПбМТСБ» вправе провести проверку достоверности информации и документов, представляемых в соответствии с Правилами допуска к участию в организованных торгах Закрытого акционерного общества «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа».

4.7. Продолжительность указанной проверки не должна превышать 10 (десяти) рабочих дней со дня подачи документов лицами, указанными в пп.4.2 и 4.3. настоящего раздела Порядка. При необходимости этот срок может быть продлен ЗАО «СПбМТСБ» не более, чем на 10 (десять) рабочих дней.

4.8. ЗАО «СПбМТСБ» вправе потребовать от лиц, указанных в пп. 4.2 и 4.3. настоящего Порядка, а также от Участников торгов предоставления дополнительной информации о его деятельности, в том числе об органах управления, а также информацию, характеризующую их финансовое состояние.

4.9. Члены Биржи, Члены Секции, Временные Члены Секции, Посетители обязаны проинформировать ЗАО «СПбМТСБ» об изменении их организационно-правовой формы, устава, адреса местонахождения, фактического и/или почтового адреса, смене единоличного исполнительного органа, лиц, имеющих право первой или второй подписи.

Данная информация должна представляться в письменной форме за подписью руководителя организации, в течение десяти рабочих дней после вступления в силу данных изменений.

ПРИЛОЖЕНИЕ №1
к Порядку организации мониторинга
организованных торгов и контроля
за участниками торгов
ЗАО «СПБМТСБ»

**Критерии нестандартных сделок (заявок)
в Секции срочного рынка ЗАО «СПБМТСБ»**

1. Приведенные в настоящем Приложении №1 к Порядку критерии применяются для контроля совершенных сделок и поданных заявок в ходе торговой сессии в отношении срочных контрактов определенной серии в случае, если в течение данной торговой сессии до момента применения данного критерия в отношении срочных контрактов данной серии Участниками торгов поданы заявки в интересах не менее чем 20 (двадцати) Участников рынка.
2. Указанные в настоящем Приложении №1 к Порядку критерии применяются только к безадресным заявкам, поданным в основном режиме торгов, и сделкам, заключенным на основании указанных заявок.
3. Для расчетных и поставочных срочных контрактов на нефтепродукты и индексы стоимости нефтепродуктов установлены следующие критерии нестандартных сделок (заявок) и пороговые значения:

№	Критерий/группа критериев	Пороговое значение
1	Отклонение цены сделки (заявки) от расчетной цены, определенной по данной серии срочного контракта по итогам торгов в предыдущий торговый день, выраженное в процентах	XX
2	Отклонение цены сделки (заявки) от цены предыдущей сделки, совершенной по данной серии срочного контракта в течение данной торговой сессии, выраженное в процентах	XX
3	Отклонение цены сделки (заявки) от текущей расчетной цены, определенной по данной серии срочного контракта на момент совершения сделки (подачи заявки), выраженное в процентах	XX
4	Количество взаимных сделок ¹ , совершенных между двумя Участниками рынков	XX

5	5.1. Количество сделок, совершенных последовательно одним Участником рынка и ведущих к изменению расчетной цены данного срочного контракта в одном направлении	XX
	5.2 Отклонение цены последней сделки последовательности сделок, количество которых устанавливается в п. 5.1, от расчетной цены, определенной по данной серии срочного контракта по итогам торгов в предыдущий торговый день, выраженное в процентах	XX

¹ Под взаимными сделками понимается две сделки, заключенные между одними и теми же Участниками рынка в отношении срочных контрактов одной и той же серии, причем по одной из этих сделок один Участник рынка является покупателем, а по другой продавцом.

Количество взаимных сделок между двумя Участниками рынка определяется как количество пар взаимных сделок между одними и теми же Участниками рынка.

**Критерии нестандартных сделок
в Секциях товарного рынка ЗАО «СПБМТСБ»**

1. Критерии нестандартных сделок

1.01. Нестандартными признаются сделки, заключенные в ходе двустороннего встречного аукциона при удовлетворении параметров сделки хотя бы одному из следующих критериев:

1.01.1. Отклонение цены сделки по биржевому товару от Рыночной цены предыдущего дня превышает значение скорректированного показателя волатильности, определяемого ЗАО «СПБМТСБ» следующим образом:

$$|\delta_k^{pr.m}| > \sigma_{adj},$$

где

σ_{adj} - скорректированный показатель волатильности ценового индикатора;

$\delta_k^{pr.m} = (P_k - P_m)/P_m$ - относительное отклонение цены биржевого товара;

где

P_k – цена сделки;

P_m – Рыночная цена предыдущего дня.

В случае, если Рыночная цена предыдущего дня для указанного биржевого товара не определена в соответствии с Правилами торгов, расчет данного критерия для указанного биржевого товара не производится.

1.01.2. Отклонение цены последней сделки с биржевым товаром от цены первой сделки с биржевым товаром одного торгового дня превышает значение скорректированного показателя волатильности, определяемого ЗАО «СПБМТСБ» в соответствии с настоящим Приложением № 2 к Порядку, - в случае если в течение торгового дня все сделки с биржевым товаром заключались за счет двух участников торгов/клиентов участников торгов:

$$|\delta_k^{z-o}| > \sigma_{adj},$$

где

σ_{adj} - скорректированный показатель волатильности ценового индикатора;

$\delta_k^{z_0} = (P_z - P_0)/P_0$ - относительное отклонение цены биржевого товара;

где

P_z – цена закрытия на конец рабочего дня;

P_0 – цена открытия на начало торгового дня.

- 1.01.3. Отклонение средневзвешенной цены биржевого товара, рассчитанной по сделкам, заключенным в течение одного торгового дня, за исключением сделок, признанных нестандартными по критериям, которые установлены п.п. 1.01.1 и 1.01.2 Приложения № 2 к настоящему Порядку, и сделок, заключенных за счет одного участника торгов/клиента участника торгов, от средневзвешенной цены биржевого товара, рассчитанной по всем сделкам, заключенным в течение одного торгового дня за исключением сделок, признанных нестандартными по критериям, которые установлены п.п. 1.01.1 и 1.01.2 Приложения № 2 к настоящему Порядку, превышает значение скорректированного показателя волатильности, определяемого ЗАО «СПБМТСБ» в соответствии с настоящим Приложением № 2 к Порядку, - в случае если в течение торгового дня все сделки с биржевым товаром заключались за счет более двух участников торгов/клиентов участников торгов с каждой из сторон (покупка/продажа):

$$|\bar{\delta}_k| > \sigma_{adj},$$

где

σ_{adj} - скорректированный показатель волатильности ценового индикатора;

$\bar{\delta}_k = \frac{(\bar{P}_i - \bar{P}_k)}{\bar{P}_k}$ - относительное отклонение цены биржевого товара;

где

\bar{P}_i – средневзвешенная цена биржевого товара, рассчитанная по сделкам, заключенным в течение k-го торгового дня, за исключением сделок, признанных нестандартными по критериям, которые установлены п.п. 1.01.1 и 1.01.2 Приложения № 2 к настоящему Порядку, и сделок, заключенных за счет i-го участника торгов/клиента участника торгов;

\bar{P}_k - средневзвешенная цена биржевого товара, рассчитанная по сделкам, заключенным в течение k-го торгового дня за исключением сделок, признанных нестандартными по критериям, которые установлены п.п. 1.01.1 и 1.01.2 Приложения № 2 к настоящему Порядку.

- 1.01.4. Отклонение средневзвешенной цены биржевого товара, рассчитанной по сделкам, заключенным в течение одного торгового дня, без учета сделок, заключенных за счет нескольких участников торгов/клиентов участников торгов, от средневзвешенной цены биржевого товара, рассчитанной по всем сделкам, заключенным в течение одного торгового дня, превышает значение скорректированного показателя волатильности, определяемого ЗАО «СПБМТСБ» в соответствии с настоящим Приложением № 2 к Порядку, - в

случае если в течение торгового дня все сделки с биржевым товаром заключались за счет более двух участников торгов/клиентов участников торгов:

$$|\overline{\delta}_k'| > \sigma_{adj},$$

где

σ_{adj} - скорректированный показатель волатильности ценового индикатора;

$\overline{\delta}_k' = \frac{(P_i - \overline{P}_k)}{\overline{P}_k}$ - относительное отклонение цены биржевого товара;

где

\overline{P}_i – средневзвешенная цена биржевого товара, рассчитанная по сделкам, заключенным в течение k-го торгового дня, без учета сделок, заключенных за счет нескольких участников торгов/клиентов участников торгов, принимаемых как один i-й участник торгов/клиент участника торгов;

\overline{P}_k - средневзвешенная цена биржевого товара, рассчитанная по сделкам, заключенным в течение k-го торгового дня.

Расчет данного критерия производится в случае поступления запроса от Банка России.

1.02. Указанные в настоящем Разделе Приложения № 2 к Порядку критерии не применяются к адресным сделкам.

2. Порядок расчета значений критериев для выявления нестандартных сделок

2.01. В целях определения значений критериев, используемых для выявления нестандартных сделок, ЗАО «СПбМТСБ» устанавливаются ценовые индикаторы групп биржевого товара (далее – ценовые индикаторы), соответствующие Индексам цен, рассчитываемым согласно утверждаемой Президентом ЗАО «СПбМТСБ» Методике расчета индексов цен нефтепродуктов. Порядок соотнесения биржевого товара Индексам цен (ценовым индикаторам) определяется Реестром соответствия биржевых товаров ценовым индикаторам ЗАО «СПбМТСБ», который ведется в электронной форме.

2.02. Корзина ценового индикатора включает биржевой товар, информация о торгах которым учитывается при определении ценового индикатора. Корзина ценового индикатора для биржевого товара Секции товарного рынка формируется из биржевых инструментов, входящих в базу расчета индексов цен нефтепродуктов, определяемой согласно утверждаемой Президентом ЗАО «СПбМТСБ» Методике расчета индексов цен нефтепродуктов.

2.03. Для определения показателя волатильности ценового индикатора (на конец каждого торгового дня) ЗАО «СПбМТСБ» рассчитывается значение волатильности однодневного относительного изменения значения ценового индикатора в интервале 30

торговых дней, предшествующих текущему торговому дню, в каждый из которых была заключена хотя бы одна сделка с биржевым товаром, включенным в корзину данного ценового индикатора. Волатильность к k-ому торговому дню указанного интервала определяется как среднеквадратическое отклонение относительных однодневных изменений значений ценового индикатора согласно следующей формуле:

$$\sigma_k = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^N (\Delta P_{k-i} - \overline{\Delta P_k})^2}{N-1}}$$

где

$\overline{\Delta P_k} = \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N \Delta P_{k-i}$ - математическое ожидание относительных однодневных

изменений ценового индикатора к k-ому торговому дню;

σ_k – показатель волатильности к k-ому торговому дню;

P_k – значение ценового индикатора на конец торговой сессии в k-ый торговый день;

$\Delta P_k = \frac{P_k - P_{k-1}}{P_{k-1}}$ - относительное однодневное (к предыдущему торговому дню)

изменение значения ценового индикатора в k-ый торговый день;

N – количество торговых дней в интервале.

2.04. Скорректированный показатель волатильности ценового индикатора предполагает корректировку показателя волатильности с учетом коэффициента разброса при изменении цены биржевого товара, поправочного значения, оперативно вводимого решением Банка России, в случае значимых системных событий, а также поправки на коэффициент сезонности.

Скорректированный показатель волатильности ценового индикатора определяется по следующей формуле:

$$\sigma_{adj} = Z * \sigma_k + R + f(\beta k)$$

где

σ_{adj} - скорректированный показатель волатильности ценового индикатора;

Z – коэффициент разброса;

R – поправочное значение, оперативно вводимое решением Банка России в случае значимых системных событий (явлений), не может быть отрицательным;

$f(\beta k)$ – поправка на коэффициент сезонности.

2.05. В целях установления (расчета) коэффициента Z биржевой товар, отнесенный к ценовым индикаторам в соответствии с настоящим Приложением № 2 к Порядку, подразделяется на ликвидный и низколиквидный. К ликвидному относится биржевой товар, число сделок по которому за текущий календарный месяц больше или равно установленному решением Президента ЗАО «СПБМТСБ» или лица, его замещающего, значению. К низколиквидному относится иной биржевой товар, отнесенный к ценовым индикаторам. Разделение биржевого товара на ликвидный и

низколиквидный производится в последний торговый день текущего календарного месяца и действует в течение следующего календарного месяца.

2.06. Значение коэффициента Z для ликвидного биржевого товара устанавливается решением Президента ЗАО «СПбМТСБ» либо лица, его замещающего и действует до его отмены. Все виды ликвидных биржевых товаров, отнесенных к одному и тому же биржевому индикатору, имеют одно и то же значение Z .

2.07. Значение коэффициента Z для низколиквидного биржевого товара устанавливается решением Президента ЗАО «СПбМТСБ» либо лица, его замещающего и действует до его отмены. Все виды низколиквидных биржевых товаров, отнесенных к одному и тому же биржевому индикатору, имеют одно и то же значение Z .

2.08. В целях выявления существенного отклонения цены биржевого товара, не отнесенному ни к одному ценовому индикатору в соответствии с настоящим Приложением №2 к Порядку, значения Z и σ_k устанавливаются решением Президента ЗАО «СПбМТСБ» или лица, его замещающего.

2.09. Значения, установленные в порядке, предусмотренном пунктами 2.06 – 2.08. настоящего Приложения №2 к Порядку, действительны в течение текущего календарного месяца. ЗАО «СПбМТСБ» производит перерасчет вышеуказанных значений и, при необходимости, утверждает в установленном порядке новые значения. ЗАО «СПбМТСБ» уведомляет Банк России о решениях, принятых Президентом ЗАО «СПбМТСБ» или лицом, его замещающим, в соответствии с пунктами 2.06 – 2.08 настоящего Приложения №2 к Порядку и настоящим пунктом, за 3 рабочих дня до даты вступления указанных решений в силу.

2.10. Значения поправки на коэффициент сезонности $f(\beta_k)$ устанавливаются решением Президента ЗАО «СПбМТСБ» или лица, его замещающего, и действуют до последующего изменения указанного значения. ЗАО «СПбМТСБ» уведомляет Банк России об установлении (изменении) значения поправки на коэффициент сезонности не позднее, чем за 3 рабочих дня до даты установления (изменения) коэффициента. ЗАО «СПбМТСБ» оповещает участников торгов об установлении (изменении) значения поправки на коэффициент сезонности не позднее, чем за 3 рабочих дня до даты установления (изменения) коэффициента, если иное не установлено решением Президента ЗАО «СПбМТСБ» или лица, его замещающего.

2.11. Поправочное значение R , используемое в расчетах скорректированного показателя волатильности в соответствии с настоящим Приложением № 2 к Порядку, определяется решением Банка России и действует до его отмены. ЗАО «СПбМТСБ» оповещает участников торгов об установлении поправочного значения R или о его отмене не позднее дня, следующего за днем вступления в силу или отмены поправочного коэффициента, если иное не установлено решением Банка России или Президента ЗАО «СПбМТСБ» или лица, его замещающего.

