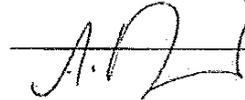


УТВЕРЖДЕНА
Президентом Закрытого акционерного
общества «Санкт-Петербургская
Международная
Товарно-сырьевая Биржа»
« 07 » августа 2015 г. (Приказ № 295)

Президент ЗАО «СПбМТСБ»

 А.Э. Рыбников

**МЕТОДИКА ОТНЕСЕНИЯ ДОГОВОРОВ, ЗАКЛЮЧАЕМЫХ В
СЕКЦИИ СРОЧНОГО РЫНКА ЗАО «СПбМТСБ», К
НЕСТАНДАРТНЫМ ДОГОВОРАМ**

2015

1. Общие положения.

1.1. Методика отнесения договоров, заключаемых в Секции срочного рынка ЗАО «СПбМТСБ», к нестандартным договорам (далее – Методика) разработана на основании требований, установленных Федеральным законом 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» (далее – Федеральный закон № 224-ФЗ), Положением Банка России от 17.10.2014 г. № 437-П «О деятельности по проведению организованных торгов» (далее – Положение ЦБ РФ № 437-П) и Порядком организации мониторинга организованных торгов и контроля за участниками торгов в ЗАО «СПбМТСБ».

1.2. Настоящая Методика определяет разработанные в соответствии с Федеральным законом № 224-ФЗ и Положением ЦБ РФ № 437-П критерии, на основании которых осуществляется выявление нестандартных договоров (заявок) при проведении организованных торгов в Секции срочного рынка ЗАО «СПбМТСБ» посредством автоматизированной системы мониторинга.

1.3. Методика применяется в отношении договоров (заявок), заключаемых (подаваемых) при проведении организованных торгов в Секции срочного рынка ЗАО «СПбМТСБ» в соответствии с Правилами проведения организованных торгов в Секции срочного рынка Закрытого акционерного общества «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа» (далее – Правила торгов).

1.4. Методика применяется при организационно-технических мероприятиях, направленных на автоматизированное непрерывное отслеживание при проведении организованных торгов цен, объемов и иных характеристик регистрируемых в ЗАО «СПбМТСБ» (далее также – Биржа) договоров (заявок) и выявление нестандартных договоров (заявок) по установленным в настоящей Методике критериям.

1.5. Проведение организационно-технических мероприятий в соответствии с п. 1.4 настоящего раздела Методики осуществляется Биржей по результатам организованных торгов за каждый торговый день, а также при поступлении обращения (жалобы, заявления) от Участника торгов или по требованию Банка России.

1.6. Методика, а также изменения и дополнения в Методику утверждаются Президентом Биржи или лицом, его замещающим, с определением даты вступления в силу Методики (изменений и дополнений в Методику).

1.7. Методика, а также изменения и дополнения в Методику представляются в Банк России не позднее, чем за 5 (пять) рабочих дня до даты вступления в силу Методики (изменений и дополнений в Методику).

1.8. Информация об утверждении и вступлении в силу Методики (изменений и дополнений в Методику), а также текст Методики (изменений и дополнений в Методику), за исключением пороговых значений критериев, размещаются на официальном сайте Биржи в сети Интернет.

1.9. Термины, специально не определенные в настоящей Методике, используются в значениях, установленных законами, нормативными актами Банка России, иными

нормативными правовыми актами Российской Федерации, а также Правилами торгов и иными внутренними документами ЗАО «СПбМТСБ».

2. Критерии отнесения к нестандартным договорам (заявок) в Секции срочного рынка ЗАО «СПбМТСБ».

2.1. Установленные в соответствии с п. 2.3 настоящего раздела Методики критерии применяются для контроля заключенных договоров и поданных заявок в ходе торговой сессии в отношении срочных контрактов определенной серии в случае, если в течение данной торговой сессии до момента применения соответствующего критерия в отношении срочных контрактов определенной серии Участниками торгов поданы заявки в интересах не менее чем 20 (двадцати) Участников рынка¹.

2.2. Установленные в соответствии с п. 2.3 настоящего раздела Методики критерии применяются только к безадресным заявкам, поданным в основном режиме торгов, и договорам, заключенным на основании указанных заявок.

2.3. В соответствии с Положением ЦБ РФ № 437-П для срочных контрактов, обращающихся в Секции срочного рынка ЗАО «СПбМТСБ», устанавливаются следующие критерии нестандартных договоров (заявок) и соответствующие им пороговые значения:

Таблица 1. Критерии нестандартных договоров (заявок)

№	Критерий/группа критериев	Пороговое значение
1.	Отклонение цены договора (заявки) от расчетной цены, определенной по данной серии срочного контракта по итогам торгов в предыдущий торговый день, выраженное в процентах.	XX
2.	Отклонение цены договора (заявки) от цены последнего договора, заключенного с данной серией срочного контракта в течение данной торговой сессии, выраженное в процентах.	XX
3.	Отклонение цены договора (заявки) от текущей расчетной цены, определенной по данной серии срочного контракта на момент заключения договора (подачи заявки), выраженное в процентах.	XX
4.	Количество взаимных договоров ² , заключенных между любыми двумя Участниками рынка.	XX

¹ Под Участником рынка понимается лицо, от имени и/или за счет которого Участник торгов подает заявку. При этом Участник торгов также является Участником рынка. Код Участника рынка определяется в соответствии с таблицей 2 настоящего Приложения.

² Под взаимными договорами понимается два договора, заключенные последовательно друг за другом между одними и теми же Участниками рынка в отношении срочных контрактов одной и той же серии, причем по одному из этих договоров один Участник рынка является покупателем, а по другой продавцом. Количество взаимных договоров между двумя Участниками рынка определяется как количество пар взаимных договоров между одними и теми же Участниками рынка.

5.	1. Количество договоров, заключенных последовательно одним Участником рынка по разным заявкам и ведущих к изменению текущей расчетной цены данной серии срочного контракта в одном направлении.	XX
	2. Отклонение цены последнего договора последовательности договоров, количество которых устанавливается в предыдущем пункте, от расчетной цены, определенной по данной серии срочного контракта по итогам торгов в предыдущий торговый день, выраженное в процентах.	XX
6.	1. Объем договоров в стоимостном выражении, заключенных Участником рынка по серии срочного контракта за текущий торговый день, от общего объема договоров в стоимостном выражении, заключенных по данной серии срочного контракта за текущий торговый день, выраженный в процентах.	XX
	2. Увеличение объема договоров в стоимостном выражении, заключенных за текущий торговый день с данной серией срочного контракта, от среднего ежедневного объема торгов в стоимостном выражении по данной серии срочного контракта, выраженное в процентах.	XX
7.	Отклонение объема договоров в стоимостном выражении, заключенных Участником рынка по серии срочного контракта за текущий торговый день, от среднего ежедневного значения объема договоров, заключаемых Участником рынка по серии срочных контрактов, выраженное в процентах.	XX
8.	Отношение количества заключенных Участником рынка договоров к количеству поданных данным Участником рынка безадресным заявкам по данной серии срочного контракта за текущий торговый день.	XX
9.	Заключение Участником торгов договора в своих интересах по лучшей цене (более низкой при покупке и более высокой при продаже), чем по договору, заключенному в интересах клиентов ³ , с разницей по времени не более 1 минуты.	XX

Таблица 2. Кодировка Участников рынка

Тип лица	y1y2	y3y4...yN	Код Участника рынка
юридическое лицо, имеющее ИНН	OR	Код, присвоенный Участнику рынка Клиринговой организацией	y1y2+ y3y4...yN
юридическое лицо, не имеющее ИНН и имеющее КИО	KI		y1y2+ y3y4...yN
юридическое лицо, не имеющее ИНН и КИО	IO		Код Участника клиринга + y1y2+ y3y4...yN
ИП (физическое лицо), имеющее общегражданский паспорт	IP		y1y2+ y3y4...yN
ИП (физическое лицо) без гражданства	IB		Код Участника клиринга + y1y2+

³ Под клиентом Участника торгов понимается лицо, от имени или за счет которого данный Участник торгов подает заявку.

			y3y4...yN
физическое лицо, достигшее возраста, с которого выдается общегражданский паспорт	PD		y1y2+ y3y4...yN
физическое лицо, не достигшее возраста, с которого выдается общегражданский паспорт	SR		y1y2+ y3y4...yN
физическое лицо без гражданства	BG		Код Участника клиринга + y1y2+ y3y4...yN
недееспособное или ограниченно дееспособное физическое лицо	ND		y1y2+ y3y4...yN