

УТВЕРЖДЕНА

Президентом Акционерного общества
«Санкт-Петербургская Международная
Товарно-сырьевая Биржа»

«14» февраля 2020 г. (Приказ № 78/20)

**МЕТОДИКА ОТНЕСЕНИЯ ДОГОВОРОВ, ЗАКЛЮЧАЕМЫХ В
СЕКЦИИ СРОЧНОГО РЫНКА АО «СПБМТСБ», К
НЕСТАНДАРТНЫМ ДОГОВОРАМ**

1. Общие положения

- 1.1. Методика отнесения договоров, заключаемых в Секции срочного рынка АО «СПбМТСБ», к нестандартным договорам (далее – Методика) разработана в соответствии с 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 – Закон № 224-ФЗ), Положением Банка России от 17.10.2014 № 437-П «О деятельности по проведению организованных торгов» (далее – Положение № 437-П), Методическими рекомендациями по установлению критериев существенного отклонения объема торгов производными финансовыми инструментами (утверждены Банком России 11.03.2019 № 6-МР, далее – Методические рекомендации № 6-МР), а также внутренним документом АО «СПбМТСБ», определяющим порядок организации мониторинга организованных торгов и контроля за участниками торгов (далее – Порядок мониторинга).
- 1.2. Настоящая Методика определяет разработанные в соответствии с Законом № 224-ФЗ, Положением № 437-П, а также Методическими рекомендациями № 6-МР критерии, на основании которых осуществляется выявление нестандартных договоров (заявок) при проведении организованных торгов в Секции срочного рынка АО «СПбМТСБ» посредством автоматизированной системы мониторинга.
- 1.3. Методика применяется в отношении договоров (заявок), заключаемых (зарегистрированных) в соответствии с Правилами проведения организованных торгов в Секции срочного рынка Акционерного общества «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа» (далее – Правила торгов).
- 1.4. Методика применяется при проведении организационно-технических мероприятий, направленных на автоматизированное непрерывное отслеживание при проведении организованных торгов цен, объемов и иных характеристик регистрируемых в АО «СПбМТСБ» 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 Методики осуществляется АО «СПбМТСБ» 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 АО «СПбМТСБ» или лицом, его замещающим, с определением даты вступления в силу Методики (изменений и дополнений в Методику).
- 1.7. Методика представляется для сведения в Банк России до даты вступления ее в силу в срок, установленный в Порядке мониторинга.
- 1.8. Текст Методики (за исключением пороговых значений критериев) размещается на официальном сайте АО «СПбМТСБ» в сети Интернет.

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 АО «СПбМТСБ».

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

- 2.1. Установленные в соответствии с п.2.3 Методики критерии применяются для контроля заключенных договоров и зарегистрированных 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 зарегистрированы заявки в интересах не менее чем 20 (двадцати) Участников рынка¹.
- 2.2. Установленные в соответствии с п.2.3 Методики критерии применяются только к безадресным заявкам, зарегистрированным в основном режиме торгов, и договорам, заключенным на основании указанных заявок.
- 2.3. В соответствии с Положением № 437-П и Методическими рекомендациями № 6-МР для срочных контрактов, обращающихся в Секции срочного рынка АО «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
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

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 Правилами допуска к участию в организованных торгах Акционерного Общества «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа».

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.

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
10.	1. Отклонение среднего объема сделок срочного контракта данной серии, совершенных в течение одного торгового дня одним Участником рынка от среднего объема всех сделок данной серии без учета сделок, совершенных этим Участником рынка	XX
	2. Отклонение суммарного объема сделок по срочным контрактам одной серии, совершенных в течение одного торгового дня одним Участником рынка, от суммарных объемов сделок той же серии контрактов, совершенных иными Участниками рынка	XX
	3. Доля суммарного объема сделок по срочным контрактам одной серии, совершенных одним Участником рынка в течение текущего торгового дня в суммарном объеме сделок, совершенных всеми Участниками рынка по данной серии контрактов.	XX
	4. Отношение суммарного объема сделок срочных контрактов данной серии, совершенных в течение одного торгового дня одним Участником рынка, к величине υ , определяемой в соответствии с Методическими рекомендациями № 6-МР.	XX

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