



**УТВЕРЖДЕНА**

Правлением АО СПВБ

(протокол от 16.05.2024 № 18)

**МЕТОДИКА**

**расчета курсов иностранных валют Акционерного общества**

**«Санкт-Петербургская Валютная Биржа»**

(редакция 1)

Санкт-Петербург

2024

## **1. Общие положения**

1.1. Настоящая Методика расчета курсов иностранных валют Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (далее – Методика) разработана в соответствии с Правилами организованных торгов Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»<sup>1</sup> (далее – Правила организованных торгов) и устанавливает порядок расчета Акционерным обществом «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (далее – АО СПВБ) курсов денежной единицы одной страны, выраженных в денежной единице другой страны (далее – курсы валют), с учетом требований законодательства Российской Федерации.

1.2. Термины, специально не определенные в настоящей Методике, используются в значениях, установленных Правилами организованных торгов, а также законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

1.3. Текст настоящей Методики размещается на официальном сайте АО СПВБ в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (далее – Сайт АО СПВБ) не позднее, чем за один рабочий день до даты вступления ее в силу, если иное не предусмотрено решением АО СПВБ.

1.4. Настоящая Методика, а также изменения и дополнения к ней утверждаются Правлением АО СПВБ и вступают в силу в дату, определенную Правлением АО СПВБ.

## **2. Порядок расчета курсов валют**

2.1. Курсы валют рассчитываются по каждой валюте лота валютных биржевых инструментов, торги которыми проводятся в Секции денежного и валютного рынков, в каждой из сопряженных валют (далее – курс АО СПВБ).

2.2. Курс АО СПВБ определенной иностранной валюты рассчитывается на основании договоров, заключенных на организованных торгах в Секции денежного и валютного рынков по валютному биржевому инструменту, лот которого номинирован в соответствующей иностранной валюте.

2.3. Курс АО СПВБ определенной иностранной валюты рассчитывается на основании договоров, заключенных в торговых режимах Секции денежного и валютного рынков, проводимых на основании безадресных заявок, и приравнивается к цене закрытия валютного биржевого инструмента, определенной в ходе последней торговой сессии каждого торгового дня соответствующим валютным биржевым инструментом.

---

<sup>1</sup> Правила организованных торгов АО СПВБ – внутренний документ Биржи, состоящий из документов «Правила допуска к торгам Акционерного общества «Санкт Петербургская Валютная Биржа», «Правила проведения организованных торгов в Фондовой секции Акционерного общества «Санкт Петербургская Валютная Биржа», «Правила проведения организованных торгов в Секции межбанковского кредитного рынка Акционерного общества «Санкт Петербургская Валютная Биржа» и «Правила листинга (делистинга) ценных бумаг Акционерного общества «Санкт Петербургская Валютная Биржа».

2.4. В целях контроля лимитов изменения цены валютных биржевых инструментов в первый торговый день по валютному биржевому инструменту используется курс Банка России, установленный на дату, соответствующую первому торговому дню валютного биржевого инструмента, опубликованный на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» ([https://cbr.ru/currency\\_base/daily/](https://cbr.ru/currency_base/daily/)).

### **3. Порядок расчета цен валютных биржевых инструментов**

3.1. **Текущая цена валютного биржевого инструмента** рассчитывается не реже одного раза в минуту в течение торговой сессии как средневзвешенная цена данного валютного инструмента за предшествующие моменту расчета 10 (десять) минут торгов по всем договорам, заключенным на основании безадресных заявок.

3.2. В случае отсутствия в течение последних 10 (десяти) минут торговой сессии договоров, заключенных на основании безадресных заявок, текущая цена валютного биржевого инструмента определяется следующим образом:

- при наличии активных безадресных заявок на покупку и продажу – как среднее значение цен лучшей заявки на покупку (максимальная цена) и лучшей заявки на продажу (минимальная цена);
- при наличии активных безадресных заявок только на покупку – как цена лучшей заявки на покупку (максимальная цена), если такая цена выше последнего рассчитанного значения текущей цены валютного биржевого инструмента, иначе – как последнее рассчитанное значение текущей цены валютного биржевого инструмента;
- при наличии активных безадресных заявок только на продажу – как цена лучшей заявки на продажу (минимальная цена), если такая цена ниже последнего рассчитанного значения текущей цены валютного биржевого инструмента, иначе – как последнее рассчитанное значение текущей цены валютного биржевого инструмента в текущий торговый день.

3.3. В случае отсутствия в течение последней минуты торговой сессии договоров, заключенных на основании хотя бы одной безадресной заявки, а также заявок, удовлетворяющих условиям, предусмотренным пунктом 3.2 настоящей Методики, текущая цена валютного биржевого инструмента принимается равной последней рассчитанной текущей цене данного валютного биржевого инструмента.

3.4. **Цена открытия валютного биржевого инструмента** рассчитывается по всем договорам, заключенным на основании безадресных заявок, и приравнивается к первой рассчитанной текущей цене валютного биржевого инструмента в течение торговой сессии.

3.5. В случае отсутствия в течение торговой сессии договоров, заключенных на основании безадресных заявок, а также заявок, удовлетворяющих условиям,

предусмотренным пунктом 3.2 настоящей Методики, цена открытия валютного биржевого инструмента не рассчитывается.

**3.6. Цена закрытия валютного биржевого инструмента** рассчитывается по всем договорам, заключенным на основании безадресных заявок, и приравнивается к последней рассчитанной текущей цене на момент окончания торговой сессии.

**3.7.** В случае отсутствия в течение торговой сессии договоров, заключенных на основании безадресных заявок, а также заявок, удовлетворяющих условиям, предусмотренным пунктом 3.2 настоящей Методики, цена закрытия валютного биржевого инструмента не рассчитывается. В этом случае в целях контроля лимитов изменения цены валютных биржевых инструментов на следующий торговый день по валютному биржевому инструменту используется курс Банка России, установленный на соответствующую дату, опубликованный на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» ([https://cbr.ru/currency\\_base/daily/](https://cbr.ru/currency_base/daily/)).

**3.8. Средневзвешенная цена валютного биржевого инструмента** за установленный период времени определяется путем деления значения, полученного в результате суммы произведений цен каждого из договоров, заключенных в данный период времени, на сумму каждого из этих договоров в валюте лота, на общую сумму всех указанных договоров в валюте лота за тот же период времени.

**3.9.** Значение цен валютного биржевого инструмента, определяемых в соответствии с настоящей Методикой, содержит  $n$  число знаков после запятой с округлением по математическим правилам согласно точности (разрядности) цены, установленной в Спецификации соответствующего Биржевого инструмента.

#### **4. Раскрытие курсов АО СПВБ и цен валютных биржевых инструментов**

**4.1.** Значения курсов АО СПВБ и цен валютных биржевых инструментов, определяемых в соответствии с настоящей Методикой, раскрываются (публикуются) на Сайте АО СПВБ ежедневно по итогам каждого торгового дня.