

УТВЕРЖДЕНА

Правлением
Акционерного общества
«Санкт-Петербургская
Валютная Биржа»
(протокол от 11.09.2025 № 42)

МЕТОДИКА

**расчета курсов иностранных валют Акционерного общества
«Санкт-Петербургская Валютная Биржа»**

Редакция 3

ОГЛАВЛЕНИЕ

1. Общие положения.....	3
2. Порядок расчета курсов валют	3
3. Порядок расчета цен валютных биржевых инструментов	4
3.1 Текущая цена валютного биржевого инструмента	4
3.2 Цена открытия валютного биржевого инструмента	4
3.3 Цена закрытия валютного биржевого инструмента.....	5
3.4 Средневзвешенная цена валютного биржевого инструмента.....	5
4. Установление лимитов изменения цен валютных биржевых инструментов	6

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»¹ (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 Методике, используются в значениях, установленных Правилами организованных торгов, а также законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.
- 1.3. Текст 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. Методика, а также изменения и дополнения к ней утверждаются Правлением АО СПВБ и вступают в силу в дату, определенную Правлением АО СПВБ.
- 1.5. Значения цен и курсов валютного биржевого инструмента, определяемых в соответствии с Методикой, содержит n число знаков после запятой с округлением по математическим правилам согласно точности (разрядности) цены, установленной в Спецификации соответствующего Биржевого инструмента.

2. ПОРЯДОК РАСЧЕТА КУРСОВ ВАЛЮТ

- 2.1. Курс валюты рассчитывается по каждому валютному биржевому инструменту, торги которым проводятся в Секции денежного и валютного рынков.
- 2.2. Курсом валюты по валютному биржевому инструменту является цена последнего договора, заключенного в течение торгового дня (включая дополнительную торговую сессию, в случае ее проведения) по данному валютному биржевому инструменту на основании безадресных заявок на организованных торгах. В случае отсутствия на момент окончания последней торговой сессии текущего торгового дня договоров, заключенных на основании безадресных заявок по валютному биржевому инструменту, курс валюты по указанному инструменту не определяется.

¹ 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 денежного и валютного рынков Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» и «Правила листинга (делистинга) ценных бумаг Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

3. ПОРЯДОК РАСЧЕТА ЦЕН ВАЛЮТНЫХ БИРЖЕВЫХ ИНСТРУМЕНТОВ

3.1 Текущая цена валютного биржевого инструмента

3.1.1 Текущая цена валютного биржевого инструмента рассчитывается не реже одного раза в минуту в течение торгового дня (включая дополнительную торговую сессию, в случае ее проведения) как средневзвешенная цена данного валютного биржевого инструмента в соответствии с п. 3.4.1 Методики за предшествующие моменту расчета 10 (десять) минут торгов по всем договорам, заключенным на основании безадресных заявок.

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

- 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 в текущий торговый день;
- 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.

3.1.3 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 3.1.2 Методики, текущая цена валютного биржевого инструмента принимается равной последней рассчитанной текущей цене в течение текущего торгового дня данного валютного биржевого инструмента.

3.1.4 В случае отсутствия договоров, заключенных на основании безадресных заявок в течение текущего торгового дня, текущая цена валютного биржевого инструмента не рассчитывается.

3.2 Цена открытия валютного биржевого инструмента

3.2.1 Цена открытия валютного биржевого инструмента (за исключением договоров СВОП) рассчитывается по состоянию на момент заключения первого договора, заключенного на основании безадресных заявок в течение текущего торгового дня, и приравнивается к цене этого договора.

3.2.2 Цена открытия валютного биржевого инструмента – договора СВОП рассчитывается по состоянию на момент заключения первого договора, заключенного на основании безадресных заявок в течение текущего торгового дня, и приравнивается к цене этого договора СВОП, определяемой как разница между итоговым курсом договора СВОП и базовым курсом договора СВОП.

- 3.2.3 В случае отсутствия договоров, заключенных на основании безадресных заявок в течение текущего торгового дня, цена открытия валютного биржевого инструмента не рассчитывается.

3.3 Цена закрытия валютного биржевого инструмента

- 3.3.1 Цена закрытия валютного биржевого инструмента (за исключением договоров СВОП) рассчитывается по состоянию на момент окончания основной торговой сессии текущего торгового дня (один раз в течение торгового дня) и приравнивается к цене последнего договора, заключенного на основании безадресных заявок в течение основной торговой сессии.
- 3.3.2 Цена закрытия валютного биржевого инструмента – договора СВОП рассчитывается по состоянию на момент окончания основной торговой сессии текущего торгового дня (один раз в течение торгового дня) и приравнивается к цене последнего договора СВОП, заключенного на основании безадресных заявок в течение основной торговой сессии, определяемой как разница между итоговым курсом договора СВОП и базовым курсом договора СВОП.
- 3.3.3 В случае отсутствия на момент окончания основной торговой сессии текущего торгового дня договоров, заключенных на основании безадресных заявок, цена закрытия валютного биржевого инструмента не рассчитывается.
- 3.3.4 В случае наличия по итогам торгового дня рассчитанной цены закрытия АО СПВБ в целях контроля лимитов изменения цены валютных биржевых инструментов на следующий торговый день использует цену закрытия (в порядке и случаях, предусмотренными в разделе 4 Методики).

3.4 Средневзвешенная цена валютного биржевого инструмента

- 3.4.1 Средневзвешенная цена валютного биржевого инструмента за торговый день (включая дополнительную торговую сессию, в случае ее проведения) определяется путем деления значения, полученного в результате суммы произведений цен каждого из договоров, заключенных в данный период времени на основании безадресных заявок, на объем каждого из этих договоров, на суммарный объем всех указанных договоров за тот же период времени. В случае отсутствия договоров, заключенных на основании безадресных заявок в течение текущего торгового дня, средневзвешенная цена валютного биржевого инструмента не рассчитывается.
- 3.4.2 Для валютных биржевых инструментов, являющихся договором СВОП, средневзвешенная цена за торговый день (включая дополнительную торговую сессию, в случае ее проведения) определяется путем деления значения, полученного в результате суммы произведений разницы итогового курса договора СВОП и базового курса договора СВОП каждого из договоров СВОП, заключенных в данный период времени на основании безадресных заявок, на объем каждого из этих договоров СВОП, на суммарный объем всех указанных договоров СВОП за тот же период времени. В случае отсутствия договоров, заключенных на основании безадресных заявок в течение текущего торгового дня, средневзвешенная цена валютного биржевого инструмента не рассчитывается.

4. УСТАНОВЛЕНИЕ ЛИМИТОВ ИЗМЕНЕНИЯ ЦЕН ВАЛЮТНЫХ БИРЖЕВЫХ ИНСТРУМЕНТОВ

- 4.1. АО СПВБ вправе установить лимиты изменения цен в отношении любых валютных биржевых инструментов для Режимы непрерывных торгов (торги иностранной валютой) и Режимы непрерывных торгов (торги иностранной валютой с Провайдером ликвидности) - максимально допустимое изменение цены валютного биржевого инструмента за одну торговую сессию.
- 4.2. Значение предельного отклонения цен заявок и показатели, от которых определяется максимально допустимое изменение цены валютных биржевых инструментов, определяются АО СПВБ и раскрываются на сайте АО СПВБ и/или в Торговой системе.
- 4.3. Если Участник торгов подает в Торговую систему заявку с ценовыми условиями вне границ допустимого лимита изменения цены, такая заявка не может быть зарегистрирована и автоматически отклоняется Торговой системой, а Участник торгов видит сообщение: «Цена заявки не соответствует установленному диапазону».
- 4.4. Если по валютному биржевому инструменту на момент регистрации заявки был заключен хотя бы один договор с начала торговой сессии текущего торгового дня, то значение цены заявки не должно выходить за пределы диапазона, определяемого как [цена последнего договора минус предельно допустимое отклонение; цена последнего договора плюс предельно допустимое отклонение].
- 4.5. Если по валютному биржевому инструменту на момент регистрации заявки не было заключено ни одного договора с начала торговой сессии текущего торгового дня, при этом определена цена закрытия предыдущего торгового дня, то значение цены заявки не должно выходить за границы диапазона, определяемого как [цена закрытия предыдущего торгового дня минус предельно допустимое отклонение; цена закрытия предыдущего торгового дня плюс предельно допустимое отклонение].
- 4.6. Если по валютному биржевому инструменту на момент регистрации заявки не было заключено ни одного договора с начала торговой сессии текущего торгового дня и в случае отсутствия рассчитанной цены закрытия предыдущего торгового дня (в том числе для первого торгового дня валютного биржевого инструмента), то значение цены заявки не должно выходить за границы диапазона, определяемого как [значение показателя, используемого в целях контроля лимитов изменения цен валютного биржевого инструмента, минус предельно допустимое отклонение; значение показателя, используемого в целях контроля лимитов изменения цен валютного биржевого инструмента плюс предельно допустимое отклонение].

Для случая отсутствия цены закрытия предыдущего торгового дня (в том числе для первого торгового дня валютного биржевого инструмента) в целях контроля лимитов изменения цен АО СПВБ вправе применить один из следующих механизмов определения значения показателя, используемого в соответствии с настоящим пунктом в целях контроля лимитов изменения цен валютного биржевого инструмента:

- установить значение показателя, которое будет действовать в течение определенного торгового дня, для которого отсутствует цена закрытия предыдущего торгового дня для данного валютного биржевого инструмента;

- установить порядок определения значения показателя, используемого в целях контроля лимитов изменения цен валютного биржевого инструмента. Указанный порядок будет действовать в любые торговые дни, когда отсутствует цена закрытия предыдущего торгового дня для данного валютного биржевого инструмента.
- 4.7. В случае отсутствия показателя, указанного в пункте 4.6 Методики, проверка цены заявки, вводимой в ходе торгов Участником торгов, на соответствие предельному отклонению цен (заявок) валютного биржевого инструмента не осуществляется.