

УТВЕРЖДЕНЫ
решением Совета директоров
Акционерного общества «Санкт-
Петербургская Валютная Биржа»
(протокол от 2 июня 2022 г. № 369)

**ПРАВИЛА ПРОВЕДЕНИЯ ОРГАНИЗОВАННЫХ ТОРГОВ
В СЕКЦИИ МЕЖБАНКОВСКОГО КРЕДИТНОГО РЫНКА
АКЦИОНЕРНОГО ОБЩЕСТВА
«САНКТ-ПЕТЕРБУРГСКАЯ ВАЛЮТНАЯ БИРЖА»**

Санкт-Петербург
2022

Оглавление

1.	Термины и определения (гlossарий)	3
2.	Общие положения	3
3.	Расписание торгов	4
4.	Спецификация биржевого инструмента	5
5.	Заявки	6
6.	Порядок формирования реестра заявок.....	7
7.	Порядок заключения на торгах договоров	8
8.	Порядок формирования реестра договоров, заключенных на организованных торгах	8
9.	Порядок аннулирования договоров	9
10.	Торговые режимы в Секции МКР.....	9
11.	Порядок заключения договоров на организованных торгах	10
12.	Порядок контроля лимитов.....	12
13.	Порядок приостановления, возобновления и прекращения торгов при наступлении Чрезвычайной ситуации.....	14
14.	Требования к содержанию и порядку предоставления отчетов	16
15.	Ответственность и порядок рассмотрения претензий	16

1. Термины и определения (гlossарий)

1.1. Термины, специально не определенные в настоящих Правилах проведения организованных торгов в Секции МКР Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (далее – Правила торгов в Секции МКР), используются в значениях, установленных законами, нормативными актами Банка России, иными нормативными правовыми актами Российской Федерации (далее – законодательство Российской Федерации), а также Правилами допуска к торгам Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» и Правилами клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

2. Общие положения

2.1. Настоящие Правила торгов в Секции МКР, являющиеся составной частью Правил организованных торгов АО СПВБ, разработаны на основании законодательства Российской Федерации, нормативных актов Банка России, являющегося регулирующим органом власти в сфере финансовых рынков (далее – Банк России), Устава Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» и внутренних документов Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (далее – Биржа) и устанавливают порядок проведения организованных торгов в Секции МКР.

2.2. Правила торгов в Секции МКР устанавливают порядок заключения договоров, правила регистрации договоров, а также порядок исполнения договоров.

2.3. Правила торгов в Секции МКР, а также изменения и дополнения к ним, утверждаются Советом директоров Биржи и подлежат регистрации в Банке России.

2.4. Правила торгов в Секции МКР, а также изменения и дополнения к ним вступают в силу после их регистрации Банком России в дату, определяемую Советом директоров Биржи или исполнительным органом Биржи по поручению Совета директоров Биржи с учетом требований законодательства Российской Федерации.

2.5. Текст Правил торгов в Секции МКР раскрывается на Сайте Биржи в течение 5 (пяти) рабочих дней с даты получения Биржей официального решения Банка России (или его копии) о регистрации настоящего документа, но не позднее, чем за 3 (три) рабочих дня до даты вступления их в силу, если иной срок не установлен в нормативных актах Банка России.

2.6. Для осуществления деятельности по проведению организованных торгов, в том числе деятельности по допуску лиц к торгам, допуску Биржевых инструментов к торгам на Бирже создано отдельное структурное подразделение, обеспечивающее проведение торгов во всех Секциях в соответствии с Правилами организованных торгов АО СПВБ.

2.7. Клиринг по итогам организованных торгов в Секции МКР осуществляется без участия центрального контрагента. Клиринг по итогам организованных торгов в Секции МКР осуществляется Акционерным обществом «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (АО СПВБ).

2.8. Основанием для начала, приостановления или прекращения заключения договоров с Биржевым инструментом в Секции МКР является утверждение соответствующей Спецификации Биржевого инструмента.

2.9. Полномочия по проведению торгов возлагаются на должностное лицо Биржи – Маклера, который уполномочен:

- 2.9.1. проводить (в том числе открывать и завершать) торги в соответствии с Регламентом;
- 2.9.2. в установленных настоящими Правилами торгов в Секции МКР случаях приостанавливать и возобновлять торги отдельными Биржевыми инструментами, либо целиком в Секции;
- 2.9.3. взаимодействовать с Участниками торгов;
- 2.9.4. контролировать исполнение Участниками торгов настоящих Правил торгов в Секции МКР;
- 2.9.5. делать объявления и сообщения для Участников торгов по вопросам, связанным с порядком проведения торгов;
- 2.9.6. прекращать допуск Участников торгов к заключению сделок в случаях, предусмотренных Правилами организованных торгов АО СПВБ;
- 2.9.7. выполнять иные действия в рамках предоставленных ему полномочий.

2.10. Заявки подаются (вводятся) Участниками торгов в Торговую систему в электронном виде. При подаче заявок и заключении сделок на организованных торгах могут использоваться средства электронной подписи, аналоги собственноручной подписи, коды, пароли и иные средства, подтверждающие, что документ исходит от уполномоченного на это лица.

3. Расписание торгов

3.1. Расписание торгов в Секции, в том числе расписание проведения торговой сессии и торговых режимов, определяется Регламентом.

3.2. В случае необходимости проведения дополнительной торговой сессии, в том числе для урегулирования неисполненных обязательств Участников торгов, возобновления торгов после прекращения Чрезвычайных ситуаций, а также по другим предусмотренным настоящими Правилами торгов в Секции МКР ситуациям, решением Правления Биржи время завершения торговой сессии может быть продлено.

3.3. В случае возникновения обстоятельств, препятствующих проведению торгов в соответствии с установленным в Регламенте расписанием, Правление Биржи может принять решение об изменении расписания торгов на текущий торговый день.

3.4. В случае отмены проведения торгов в Секции МКР, либо внесения изменений в расписание торгов, Биржа извещает об этом Участников торгов, расчетные организации и информационные агентства, с которыми у Биржи заключены соглашения о раскрытии информации, а также размещает указанную информацию на Сайте Биржи не менее чем за

3 (три) рабочих дня до даты отмененных торгов, если иное не предусмотрено настоящими Правилами торгов в Секции МКР.

3.5. В случае принятия решения о проведении торгов в день, не определенный расписанием торгов, Биржа уведомляет об этом Банк России не позднее, чем за три месяца до соответствующего торгового дня, а также раскрывает информацию об этом на Сайте Биржи.

3.6. Биржа вправе принять решение об отмене проведения торгов в установленный в соответствии с законодательством Российской Федерации рабочий день и (или) о проведении торгов в установленный в соответствии с законодательством Российской Федерации выходной или нерабочий праздничный день.

4. Спецификация биржевого инструмента

4.1. Спецификация Биржевого инструмента содержит следующие основные условия договора:

- 4.1.1. код Биржевого инструмента (тикер);
- 4.1.2. описание Биржевого инструмента;
- 4.1.3. Секция, в которой проводятся торги;
- 4.1.4. допустимые торговые режимы;
- 4.1.5. допустимые виды заявок;
- 4.1.6. валюта расчетов;
- 4.1.7. код расчетов;
- 4.1.8. единица измерения цены (в российских рублях, в единицах иностранных валют, в процентах от номинальной стоимости, в процентах годовых);
- 4.1.9. точность (разрядность) цены;
- 4.1.10. шаг изменения цены;
- 4.1.11. пределы изменения цены (если применимо);
- 4.1.12. размер лота;
- 4.1.13. наименование клиринговой организации;
- 4.1.14. наименование расчетной организации;
- 4.1.15. дополнительные условия.

4.2. В Спецификации Биржевого инструмента устанавливаются возможные для данного Биржевого инструмента торговые режимы и соответствующие им коды расчетов.

4.3. Код расчетов – код, определяющий условия принятия заявки, а также порядок и условия исполнения договора, предусмотренные внутренними документами Клиринговой организации. Перечень допустимых кодов расчетов, в т.ч. по режиму торгов/Секции устанавливается и утверждается решением Биржи. По решению Биржи могут быть изменены коды расчетов, предусмотренные для отдельных видов заявок/режимов торгов/Секций настоящими Правилами торгов в Секции МКР. Для заключения договоров могут использоваться следующие коды расчетов:

- 4.3.1. Код расчетов T0 – код расчетов, определяющий, что при подаче заявки проводится контроль обеспечения обязательств, которые подлежат

исполнению, а датой исполнения обязательств по договору является дата заключения договора.

- 4.3.2. Код расчетов Вп – код расчетов, определяющий, что при подаче заявки контроль обеспечения обязательств не проводится, а датой исполнения обязательств по договору является дата, определяемая как $T+n$, где T – дата заключения договора, а n – число календарных дней.

5. Заявки

5.1. Все поданные Участником торгов в течение торговой сессии заявки могут быть им сняты, за исключением случаев, предусмотренных настоящими Правилами торгов в Секции МКР. При этом договоры, заключенные на основании такой заявки до ее отзыва, сохраняют силу.

5.2. Биржа вправе отказать в регистрации поданной заявки в реестре заявок или аннулировать (удалить) зарегистрированную заявку в случае наступления Чрезвычайной ситуации, а также в том случае если указанная заявка подана с нарушением требований, установленных настоящими Правилами торгов в Секции МКР.

5.3. Заявки могут быть адресными и безадресными. Возможность подачи адресных заявок либо безадресных заявок определяется режимом торгов.

5.4. К основным видам заявок относятся:

- 5.4.1. адресная заявка;
- 5.4.2. безадресная заявка;
- 5.4.3. лимитированная (конкурентная) заявка.

5.5. Заявка содержит следующие существенные условия (параметры заявки):

- 5.5.1. вид заявки;
- 5.5.2. код Биржевого инструмента (тикер);
- 5.5.3. направление заявки (покупка или продажа);
- 5.5.4. количество лотов в заявке, либо сумму заявки;
- 5.5.5. цену Биржевого инструмента;
- 5.5.6. указание на Участника торгов, которому адресована заявка (для адресной заявки);
- 5.5.7. принадлежность заявки.

5.6. Направлением заявки может быть покупка или продажа Биржевого инструмента.

5.7. Безадресной заявкой признается заявка, которая адресована (информация о которой раскрывается) неограниченному кругу Участников торгов (всем Участникам торгов). Адресная заявка – все иные заявки.

5.8. Лимитированная (конкурентная) заявка содержит цену заявки и количество лотов Биржевого инструмента. Для лимитированной заявки на покупку это максимальная допустимая цена покупки Биржевого инструмента, для лимитированной заявки на продажу это минимальная допустимая цена продажи Биржевого инструмента.

5.9. Заявка действует до тех пор, пока Участник торгов не отменит ее или до тех пор, пока она не будет исполнена или снята. Срок действия заявки не превышает времени окончания торговой сессии, по окончании которой все заявки в Торговой системе автоматически снимаются, если иное не определено Биржей.

5.10. Заявка может подаваться Участником торгов от своего имени и за свой счет.

5.11. Заявки на покупку или продажу Биржевых инструментов могут подаваться трейдерами с использованием автоматизированных рабочих мест Торговой системы, или иным предусмотренным договором с Участником торгов способом.

5.12. При приеме заявки Биржа фиксирует дату и время ее подачи, осуществляет проверку заявки и последующую регистрацию заявки путем присвоения каждой заявке уникального индивидуального номера (кода) в базе данных Торговой системы (далее – Идентификационный номер заявки).

5.13. Биржа хранит информацию о заявках, которые не прошли проверку и не были вследствие этого зарегистрированы в Торговой системе. Биржа по заявлению Участника торгов выдает отчет, содержащий информацию о незарегистрированных заявках с указанием причины отказа в регистрации.

6. Порядок формирования реестра заявок

6.1. Реестр заявок Участников торгов ведется Биржей в электронной форме.

6.2. Система ведения реестра заявок обеспечивает возможность формирования отчетов о заявках Участников торгов за каждый торговый день.

6.3. Биржа по заявлению Участника торгов предоставляет выписку из реестра заявок в отношении заявок, поданных этим Участником торгов, в течение месяца с даты получения указанного заявления.

6.4. Реестр заявок содержит следующие сведения:

- 6.4.1. идентификационный номер заявки, совпадающий с уникальным кодом заявки, присвоенным Биржей в момент поступления заявки от Участника торгов (в момент ее регистрации в реестре заявок);
- 6.4.2. код Участника торгов, подавшего заявку;
- 6.4.3. код Участника торгов, которому адресована заявка (для адресной заявки);
- 6.4.4. направление заявки (покупка или продажа);
- 6.4.5. вид заявки (в том числе адресная или безадресная заявка);
- 6.4.6. объем заявки (количество лотов Биржевого инструмента, в отношении которого подана заявка);
- 6.4.7. цена (за единицу Биржевого инструмента);
- 6.4.8. сумму заявки;
- 6.4.9. дату и время регистрации заявки;
- 6.4.10. дату и время исполнения (отзыва) заявки;
- 6.4.11. результат подачи заявки (на исполнении, исполнена, исполнена частично, отозвана, аннулирована);

- 6.4.12. причину аннулирования;
- 6.4.13. код Биржевого инструмента (тикер).

7. Порядок заключения на торгах договоров

7.1. В Секции МКР могут заключаться следующие виды договоров:

- 7.1.1. Депозитные договоры;
- 7.1.2. Кредитные договоры.

7.2. Депозитным договором является договор банковского депозита, заключенный на торгах в Секции МКР в соответствии с настоящими Правилами торгов в Секции МКР и Регламентом.

7.3. Кредитным договором является кредитный договор, заключенный на торгах в Секции МКР в соответствии с настоящими Правилами торгов в Секции МКР и Регламентом.

7.4. Договор на торгах заключается на основании двух зарегистрированных Биржей разнонаправленных заявок, полное или частичное соответствие которых друг другу установлено в порядке, определенном настоящими Правилами торгов в Секции МКР. При этом двумя разнонаправленными заявками являются заявка на покупку и заявка на продажу. Критерии соответствия разнонаправленных заявок для различных торговых режимов и Биржевых инструментов установлены в настоящих Правилах торгов в Секции МКР.

7.5. Договор считается заключенным на торгах в момент определения Биржей соответствия разнонаправленных заявок друг другу и регистрации договора путем присвоения каждому договору уникального идентификационного номера и внесения записи о заключении соответствующего договора в реестр договоров. При этом составление одного документа, подписываемого сторонами договора, не осуществляется, и простая письменная форма договора считается соблюденной.

7.6. Биржа ведет реестр договоров, заключенных на торгах, и предоставляет Участникам торгов, заключившим договоры, а также по запросу третьих лиц (в случаях, предусмотренных законодательством Российской Федерации) выписки из реестра договоров в соответствии с нормативными актами Банка России.

8. Порядок формирования реестра договоров, заключенных на организованных торгах

8.1. Реестр договоров, заключенных на организованных торгах, ведется Биржей в электронном виде в Торговой системе.

8.2. Реестр договоров, заключенных на организованных торгах, содержит следующие сведения:

- 8.2.1. идентификационный номер договора;
- 8.2.2. дату и время регистрации договора;

- 8.2.3. идентификационные номера заявок, на основании которых заключен договор;
- 8.2.4. код Биржевого инструмента (тикер);
- 8.2.5. стандартные условия договора (указываются в Спецификации Биржевого инструмента);
- 8.2.6. коды Участников торгов, подавших заявки, на основании которых заключен договор;
- 8.2.7. цену Биржевого инструмента;
- 8.2.8. объем договора (количество Биржевых инструментов, продаваемых/приобретаемых по договору);
- 8.2.9. сумма заключенного договора (денежное выражение стоимости Биржевых инструментов, продаваемых/приобретаемых по договору).

9. Порядок аннулирования договоров

9.1. Под аннулированием договора подразумевается прекращение действия договора, заключенного на торгах, либо его расторжение.

9.2. Договоры, заключенные Участниками торгов, могут быть аннулированы Биржей в следующих случаях:

- 9.2.1. по заявлениям сторон договора;
- 9.2.2. в случаях, предусмотренных законодательством Российской Федерации, в том числе по решению суда;
- 9.2.3. в случаях, если договор заключен с нарушениями Правил торгов в Секции МКР;
- 9.2.4. в случае наступления Чрезвычайной ситуации, препятствующей проведению торгов.

9.3. Письменное извещение об аннулировании договора направляется Биржей сторонам договора в день принятия такого решения.

9.4. Может быть аннулирована часть договоров, либо все договоры за торговую сессию. В последнем случае торговая сессия объявляется несостоявшейся, клиринг, сверка и расчеты по итогам торговой сессии не проводятся.

9.5. В том случае, если договор был аннулирован после завершения расчетов по нему, урегулирование споров и взаимных обязательств осуществляется сторонами договора в двухстороннем порядке.

10. Торговые режимы в Секции МКР

10.1. При проведении торговой сессии в Секции МКР возможны следующие режимы торгов:

- 10.1.1. Депозитный Аукцион;
- 10.1.2. Кредитный Аукцион;
- 10.1.3. Режим непрерывных торгов (депозитные торги);
- 10.1.4. Режим непрерывных торгов (кредитные торги).

10.2. Торги в Секции МКР проводятся на основании утвержденных Биржей Спецификаций Биржевых инструментов.

10.3. Порядок заключения договоров в Секции МКР определяется законодательством Российской Федерации, Правилами торгов в Секции МКР, Спецификацией Биржевого инструмента, а также в случае заключения сделок с участием Инициатора торгов – внутренними нормативными документами Инициатора торгов. В том случае, если внутренние нормативные документы Инициатора торгов предусматривают дополнительные особенности заключения договоров, порядок их заключения регулируется утвержденным Биржей порядком, не противоречащим Правилам организованных торгов АО СПВБ, и/или соглашением, заключенным между Инициатором торгов и Участником торгов.

11. Порядок заключения договоров на организованных торгах

11.1. Организованные торги в режимах «Депозитный аукцион» и «Режим непрерывных торгов (депозитные торги)» проводятся в целях определения условий размещения денежных средств Инициатором торгов (Вкладчиком) на депозитных счетах в кредитных организациях, являющихся Участниками торгов, а также заключения договоров банковского депозита (депозитных договоров).

11.2. Организованные торги в режимах «Кредитный аукцион» и «Режим непрерывных торгов (кредитные торги)» проводятся в целях определения условий заключения кредитных договоров Инициатором торгов (Заемщиком) с кредитными организациями, являющимися Участниками торгов.

11.3. В зависимости от того, доступна ли в ходе торгов Участникам торгов информация о сумме и ставке в заявках других Участников торгов, Инициатором торгов может быть установлен открытый, либо закрытый способ проведения торгов.

11.4. В соответствии со способом удовлетворения заявок, установленным во внутренних нормативных документах Инициатора торгов и (или) объявлении о проведении торгов Инициатора торгов, заявки Участников торгов либо удовлетворяются по единой ставке, установленной Инициатором торгов, либо по ставкам, указанным в заявках Участников торгов.

11.5. Инициатор торгов вправе ограничить количество заявок Участника торгов на торгах.

11.6. Критерием, на основании которого Инициатор торгов удовлетворяет заявки Участников торгов на торгах, является цена заявки:

- 11.6.1. при заключении депозитного договора до востребования – ставка депозита до востребования;
- 11.6.2. при заключении депозитного договора на срок или комбинированного депозитного договора (депозитного договора с особыми условиями) – ставка депозита на срок.

11.7. Инициатор торгов в объявлении о проведении торгов вправе указать дополнительные сведения, не содержащиеся в Спецификации Биржевого инструмента, необходимые для заключения договоров (расписание проведения торгов, расчетные реквизиты, минимальная ставка депозита /максимальная ставка кредита, максимальная сумма привлекаемых/размещаемых средств, минимальный/максимальный размер заявки, ограничения, накладываемые на круг Участников торгов, пр.).

11.8. Спецификацией Биржевого инструмента комбинированного депозитного договора (депозитного договора с особыми условиями) может быть также установлена ставка депозита, предназначенная для расчета процентов по договору (либо порядок определения ставки) в случае досрочного изъятия средств Инициатора торгов (Вкладчика) с банковского депозита.

11.9. В течение периода приема заявок при проведении аукциона Участники торгов вправе подавать, изменять и снимать свои заявки.

11.10. В течение периода приема заявок на депозитный аукцион Биржа контролирует соответствие общей суммы поданных заявок величине максимального лимита, установленного Инициатора торгов (Вкладчиком) для каждого Участника торгов. Заявки Участников торгов, сумма которых превышает значение максимального лимита, Торговой системой не принимаются.

11.11. По окончании периода приема заявок на аукцион Участник торгов не имеет возможности снять или изменить поданную заявку.

11.12. Внутренними нормативными документами Инициатора торгов может быть предусмотрено проведение дополнительного этапа аукциона (этапа повышения/понижения ставки), в течение которого Участники торгов вправе только повышать/снижать ставку в своих заявках.

11.13. В течение периода удовлетворения заявок Инициатор торгов подает встречную по отношению к Участнику торгов, чья заявка была удовлетворена, заявку с указанием ставки отсечения и суммы.

11.14. Устанавливается следующая стандартная процедура и очередность удовлетворения заявок Участников торгов на аукционе:

- 11.14.1. удовлетворению подлежат заявки, в которых ставки депозита больше или равны ставке отсечения, установленной Инициатором торгов (Вкладчиком), а также те заявки, в которых ставки кредита меньше или равны ставке отсечения, установленной Инициатором торгов (Заемщиком);
- 11.14.2. заявки удовлетворяются в порядке убывания указанных в них депозитных ставок, либо в порядке возрастания кредитных ставок;
- 11.14.3. заявки удовлетворяются в пределах суммы заявки Инициатора торгов;
- 11.14.4. если объем последней удовлетворяемой заявки Участника торгов превышает остаток заявки Инициатора торгов, данная заявка Участника торгов удовлетворяется частично (в пределах остатка заявки Инициатора торгов);

11.14.5. если объем последних двух или более заявок Участников торгов с одинаковой ставкой превышает остаток заявки Инициатора торгов, указанные заявки удовлетворяются пропорционально их объему и в пределах остатка заявки Инициатора торгов. Суммы удовлетворенных таким образом заявок Участников торгов округляются до целого лота.

11.15. В случае проведения депозитных и кредитных торгов в режиме непрерывных торгов, к заявке Участника торгов, зарегистрированной Биржей, в Торговой системе осуществляется поиск соответствующей заявки. Договор заключается на основе двух соответствующих заявок противоположной направленности.

11.16. Устанавливается следующая стандартная процедура поиска соответствующей заявки и очередность удовлетворения заявок Участников торгов в ходе непрерывных торгов:

11.16.1. заявки считаются соответствующими, если они имеют противоположную направленность, поданы в отношении одного Биржевого инструмента, и ставка в заявке на покупку не ниже ставки в заявке на продажу.

11.16.2. если для поданной заявки (входящая заявка) в Торговой системе существует поданная ранее зарегистрированная соответствующая заявка (встречная заявка), Биржа регистрирует сделку;

11.16.3. договор заключается по цене встречной заявки;

11.16.4. независимо от времени подачи, встречная заявка с лучшей ценой (большей ставкой для покупки или меньшей ставкой для продажи) удовлетворяется раньше, чем заявка с менее выгодной ценой. При равенстве цен встречная заявка, поданная раньше, удовлетворяется раньше, чем заявка, поданная позже.

11.17. Заявка Участника торгов может быть удовлетворена частично.

11.18. В том случае, если внутренними нормативными документами Инициатора торгов либо соглашением Инициатора торгов с Участниками торгов установлена процедура удовлетворения заявок, отличная от описанной в пп. (11.14.), (11.15.) и (11.16.) Правил торгов в Секции МКР, стандартная процедура не применяется.

12. Порядок контроля лимитов

12.1. Заявки, подаваемые Инициаторами торгов в отношении Биржевых инструментов с кодом расчетов T0, проверяются Биржей на соответствие лимиту, установленному данному Инициатору торгов Клиринговой организацией в соответствии с Правилами клиринга.

12.2. Заявки, подаваемые Участниками торгов, не являющимися Инициаторами торгов, в отношении Биржевых инструментов с кодами расчетов T0 и Bn, проверяются Биржей на соответствие лимиту, установленному данному Участнику торгов Инициатором торгов по данному Биржевому инструменту.

12.3. В том случае, если в результате регистрации Биржей заявки изменение лимита может превысить текущее значение лимита, такая заявка не регистрируется Биржей:

$\Delta \text{Lim} \leq \text{Lim}$, где:

Lim – текущее значение лимита, установленного для Участника торгов;

ΔLim – изменение лимита в результате регистрации заявки, либо заключении договора.

12.4. Значение лимита, рассчитанное в соответствии с порядком, определенным настоящим разделом Правил торгов в Секции МКР, не может превышать максимального лимита, установленного для Участника торгов Клиринговой организацией либо Инициатором торгов.

$\text{Lim} \leq \text{Lim MAX}$, где:

Lim MAX – максимальный лимит, установленный для Участника торгов.

12.5. Лимиты, установленные для Участника торгов, представляют собой максимально допустимый размер изменения торговой позиции по Биржевым инструментам, обеспечивающий проведение клиринга и расчетов по договорам, заключенных данным Участником торгов с Биржевыми инструментами.

12.6. После регистрации заявки Биржа рассчитывает новое значение лимита для Участника торгов, подавшего заявку:

$\text{Lim}' = \text{Lim} - \Delta \text{Lim O}$;

Lim' – значение лимита, рассчитанное в результате подачи заявки;

$\Delta \text{Lim O}$ – изменение лимита, обусловленное заявкой.

12.7. Величина изменения лимита на продажу при регистрации заявки уменьшается на количество Биржевых инструментов в заявке на продажу. Заявки на покупку не приводят к изменению лимита на продажу:

$\Delta \text{Lim O A} = V O$, где:

$\Delta \text{Lim O A}$ – изменение лимита на продажу, обусловленное заявкой;

$V O$ – объем заявки на продажу Биржевого инструмента.

12.8. Величина изменения лимита на покупку при регистрации заявки уменьшается на сумму заявки на покупку. Заявки на продажу не приводят к изменению лимита на покупку:

$\Delta \text{Lim O M} = S O$, где:

$\Delta \text{Lim O M}$ – изменение лимита на покупку, обусловленное заявкой;

$S O$ – сумма заявки.

12.9. В случае удовлетворения (частичного удовлетворения) заявки Биржа рассчитывает для Участников торгов, заключивших договоры, новые значения лимитов на продажу:

$\text{Lim}' = \text{Lim} \pm \Delta \text{Lim P} + \Delta \text{Lim O}$, где:

$\Delta \text{Lim P}$ – изменение лимита, обусловленное договором;

$\Delta \text{Lim O}$ – изменение лимита, обусловленное изменением объема заявки, рассчитанное в соответствии с описанными выше правилами.

12.10. Изменение лимита Участника торгов на продажу, обусловленное договором, равно количеству Биржевых инструментов в договоре (с отрицательным знаком при продаже и с положительным знаком при покупке):

$\Delta \text{LimP A} = V T$, где:

$V T$ – объем договора.

12.11. Изменение лимита Участника торгов на покупку равно сумме договора (с положительным знаком при продаже и с отрицательным знаком при покупке):

$\Delta \text{LimP M} = S P$, где:

$S P$ – сумма договора.

13. Порядок приостановления, возобновления и прекращения торгов при наступлении Чрезвычайной ситуации

13.1. Торги в Секции МКР могут быть приостановлены либо прекращены в случае наступления Чрезвычайной ситуации.

13.2. Под Чрезвычайной ситуацией понимаются обстоятельства, которые нарушили, нарушают или могут нарушить установленные Правилами организованных торгов АО СПВБ условия проведения торгов.

13.3. Чрезвычайными могут быть признаны ситуации, обусловленные обстоятельствами непреодолимой силы: пожарами, авариями, стихийными бедствиями, военными действиями, актами террора, диверсии и саботажа, забастовками, сменой политического режима и других политических осложнений, изменений законодательных или иных актов государственных органов Российской Федерации, решений законодательных и исполнительных органов власти, а также технических сбоев, возникших вследствие неисправностей и отказов оборудования, сбоев и ошибок программного обеспечения, сбоев, неисправностей и отказов систем связи, энергоснабжения, кондиционирования и других систем жизнеобеспечения.

13.4. Чрезвычайными могут быть признаны также ситуации, связанные с наступлением иных обстоятельств, препятствующих проведению торгов и осуществлению клиринга и расчетов, которые находятся вне контроля Биржи.

13.5. Организованные торги могут быть приостановлены либо прекращены по решению Председателя Банка России (его заместителя). Решение Председателя Банка России (его заместителя) оформляется соответствующим предписанием Банка России, и в случае приостановки торгов – может содержать срок действия приостановки.

13.6. Биржа принимает решение о приостановке торгов в одной или нескольких Секциях, руководствуясь следующими основаниями (критериями):

13.6.1. наступление Чрезвычайной ситуации влияет или может повлиять на ход проведения торгов в отношении большинства Участников торгов, принимающих участие в торговой сессии;

13.6.2. решения Председателя Банка России (его заместителя).

13.7. В случае приостановки торгов Биржа раскрывает информацию об этом на Сайте Биржи (основной способ), а в случае отсутствия возможности раскрыть указанную информацию на Сайте Биржи – иным доступным способом (резервный способ), обеспечивающим ее получение Участниками торгов (в том числе – средствами Торговой системы), не позднее чем через пятнадцать минут после наступления Чрезвычайной ситуации.

13.8. После прекращения обстоятельств, послуживших основанием для приостановления торгов, торги подлежат возобновлению. В случае приостановления торгов, вызванного техническим сбоем в работе средств проведения торгов, Биржа раскрывает информацию о времени возобновления торгов и предоставляет Участникам торгов возможность отозвать активные заявки посредством средств проведения торгов не менее чем за пятнадцать минут до возобновления торгов.

13.9. В случае невозможности отзыва активных заявок посредством средств проведения торгов Участник торгов может предоставить Бирже заявление на снятие активных заявок с использованием телефонной или электронных средств связи. Биржа после получения такого заявления снимает (при наличии такой возможности) активные заявки данного Участника торгов.

13.10. Организованные торги возобновляются по решению Биржи после прекращения Чрезвычайной ситуации, в том числе после восстановления работоспособности средств проведения торгов.

13.11. Биржа вправе принять решение о продлении времени завершения торгов после их возобновления.

13.12. При восстановлении работоспособности средств проведения торгов и обнаружении технических сбоев в работе средств проведения торгов Биржа раскрывает информацию об этом на Сайте Биржи (основной способ), а в случае отсутствия возможности раскрыть указанную информацию на Сайте Биржи – иным доступным способом (резервный способ), обеспечивающим ее получение Участниками торгов, не менее чем за пятнадцать минут до возобновления торгов.

13.13. В случае приостановки либо прекращении торгов Биржей может быть принято решение о проведении сверки договоров, заключенных до наступления Чрезвычайной ситуации. При выявлении по результатам сверки некорректных данных в реестрах заявок и договоров Биржа вправе признать результаты торгов (частично или полностью) недействительными и аннулировать их.

13.14. В случае признания результатов торгов полностью недействительными Биржа объявляет торги несостоявшимися.

13.15. В Чрезвычайных ситуациях, исходя из конкретных обстоятельств, Биржа вправе принимать решения, направленные на урегулирование возникших споров, и требовать от Участников торгов выполнения этих решений.

14. Требования к содержанию и порядку предоставления отчетов

14.1. По окончании торговой сессии Участнику торгов предоставляются отчеты о заявках (выписка из реестра заявок), поданных данным Участником торгов в течение торгового дня, и договорах (выписка из реестра договоров), заключенных данным Участником торгов в течение торгового дня.

14.2. Формы и форматы отчетов установлены Положением о формах и форматах документов АО СПВБ.

14.3. Отчеты в бумажном виде заверяются подписью уполномоченного лица Биржи и предоставляются Участникам торгов по их запросу ежедневно по торговым дням после 11 часов 00 минут по московскому времени дня, следующего после даты регистрации запроса. Отчеты предоставляются представителям Участников торгов, уполномоченным на получение указанных документов надлежащим образом.

14.4. Отчеты по итогам торгов текущего торгового дня в форме электронных документов, заверенные электронной подписью уполномоченного лица Биржи, Биржа предоставляет Участникам торгов не позднее 20 часов 00 минут по московскому времени того же торгового дня. В том случае, если в результате технического сбоя время окончания торгового дня было изменено, указанные отчеты предоставляются Участникам торгов не позднее 60 минут после восстановления возможности формирования отчетов.

15. Ответственность и порядок рассмотрения претензий

15.1. Участники торгов несут ответственность за нарушение требований Правил торгов в Секции МКР.

15.2. К Участникам торгов, нарушившим требования Правил торгов в Секции МКР, применяются предусмотренные Правилами организованных торгов АО СПВБ меры дисциплинарного воздействия, в том числе штрафы.

15.3. Правилами организованных торгов АО СПВБ устанавливается претензионный порядок рассмотрения споров.

15.4. Претензии направляются на Биржу в письменной форме. Претензия подписывается уполномоченным представителем Участника торгов и должна содержать:

- 15.4.1. полное наименование заявителя;
- 15.4.2. полное наименование лица, к которому предъявляется претензия;
- 15.4.3. изложение требований заявителя;
- 15.4.4. указание суммы претензии и ее расчет (если претензия подлежит денежной оценке);

15.4.5. изложение обстоятельств, на которых основываются требования заявителя, и доказательства, подтверждающие их, со ссылкой на соответствующие нормативные документы;

15.4.6. перечень прилагаемых к претензии документов и других доказательств;

15.4.7. иные сведения, необходимые для урегулирования спора.

15.5. Претензии рассматриваются Биржей в срок, не превышающий 30 (тридцать) календарных дней со дня их получения.

15.6. Если к претензии не приложены все документы, необходимые для ее рассмотрения, они запрашиваются у заявителя претензии. При этом срок рассмотрения претензии исчисляется с даты получения указанных документов.

15.7. Ответ на претензию предоставляется в письменной форме и направляется заявителю заказным письмом или с курьером.

15.8. Неурегулированные споры и претензии подлежат рассмотрению в арбитражном суде по месту нахождения ответчика в соответствии с законодательством Российской Федерации.