

УТВЕРЖДЕНЫ
решением Наблюдательного совета
ПАО Московская Биржа
«27 ноября» 2020 г., Протокол №13

Председатель Наблюдательного совета

_____ О. В. Вьюгин

**ПРАВИЛА ОРГАНИЗОВАННЫХ ТОРГОВ
ПАО МОСКОВСКАЯ БИРЖА НА ВАЛЮТНОМ
РЫНКЕ И РЫНКЕ ДРАГОЦЕННЫХ МЕТАЛЛОВ**

МОСКВА 2020

СОДЕРЖАНИЕ

| | |
|---|----|
| 1. ГЛОССАРИЙ | 3 |
| 2. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ | 13 |
| 3. ПРОВЕДЕНИЕ ТОРГОВ | 20 |
| 4. ОФОРМЛЕНИЕ ЗАРЕГИСТРИРОВАННЫХ ЗАЯВОК И ЗАКЛЮЧЕННЫХ СДЕЛОК | 43 |
| 5. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО СДЕЛКАМ С ИНОСТРАННОЙ ВАЛЮТОЙ/ДРАГОЦЕННЫМИ МЕТАЛЛАМИ | 45 |
| 6. ПОРЯДОК МОНИТОРИНГА И КОНТРОЛЯ ЗА СДЕЛКАМИ С ИНОСТРАННОЙ ВАЛЮТОЙ/ДРАГОЦЕННЫМИ МЕТАЛЛАМИ | 45 |
| 7. ПОРЯДОК РАССМОТРЕНИЯ КОНФЛИКТНЫХ СИТУАЦИЙ | 46 |
| 8. ПОРЯДОК РАЗРЕШЕНИЯ СПОРОВ | 49 |

1. ГЛОССАРИЙ

В целях настоящих Правил организованных торгов ПАО Московская Биржа на валютном рынке и рынке драгоценных металлов (далее – Правила торгов) применяются следующие термины и определения:

Адресная сделка – сделка, заключаемая во внесистемном режиме торгов, на основании двух встречных адресных заявок, в которых указаны конечные контрагенты, а также заключаемая в системном режиме торгов сделка фикс и средневзвешенная сделка без указания конечных контрагентов.

Алгоритмический пакет заявок (пакет заявок) – подаваемое Участником торгов в ПТК ТЦ сообщение, содержащее определенное Участником торгов в порядке, установленном настоящими Правилами торгов, количество заявок на заключение сделок по одному инструменту на установленный Участником торгов совокупный объем с условием подачи заявок в Торговую систему в течение заданного им периода времени.

Алгоритмический пакет заявок может содержать одну или несколько рыночных или лимитированных заявок типа «снять остаток» на заключение сделок спот, сделок своп или своп контрактов. Все заявки, содержащиеся в пакете заявок, должны быть заявками одного вида и иметь одну направленность.

Алгоритмический пакет заявок и каждая из содержащихся в нем заявок подписываются АСП Участника торгов.

Аналог собственноручной подписи Участника торгов (АСП Участника торгов) – реквизит заявки или иного электронного документа Участника торгов, являющийся торговым идентификатором Участника торгов и позволяющий однозначно идентифицировать Участника торгов, сформировавшего данную заявку или иной электронный документ, а также установить отсутствие искажения информации в заявке или ином электронном документе.

Аукцион с Банком России – режим проведения торгов, который используется для целей определения оптимальной цены сделок своп, базисным активом которых является иностранная валюта или драгоценный металл, заключаемых Участниками торгов с Банком России. Торги, проводимые на организованных торгах в режиме аукциона с Банком России, состоят из периода сбора заявок и периода удовлетворения заявок, подлежащих удовлетворению.

Аутентификация – процедура подтверждения Биржей посредством ПТК ТЦ права Участника торгов на заключение сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами и/или на получение биржевой информации.

Базисный актив – иностранная валюта и/или драгоценный металл, определенный в спецификации соответствующего производного финансового инструмента.

Базовый курс своп контракта – курс исполнения обязательств по передаче в собственность базисного актива по первой части своп-контракта, определяемый в соответствии со спецификацией своп-контракта.

Базовый курс сделки своп – курс сделки своп, определяемый по сделке спот с более ранней датой исполнения обязательств. Базовый курс сделки своп определяется в соответствующей спецификации для каждой сделки своп.

Безадресная сделка – сделка, заключаемая в системном режиме торгов (за исключением безадресной сделки типа «всем»), на основании двух встречных безадресных заявок.

Безадресная сделка типа «всем» – безадресная сделка, заключаемая во внесистемном режиме торгов на основании двух встречных заявок на заключение безадресных сделок типа «всем».

Валюта лота – валюта/драгоценный металл, в которой(-ом) номинирован лот инструмента.

Внесистемный режим торгов – режим торгов, при котором Участники торгов могут подавать адресные заявки (за исключением адресных заявок на заключение сделок фикс и средневзвешенных сделок без указания конечных контрагентов), а также заявки на заключение безадресных сделок типа «всем». Заявки, подаваемые во внесистемном режиме торгов, за исключением заявок на заключение безадресных сделок типа «всем», не попадают в очередь заявок. Сделки, заключаемые во внесистемном режиме торгов, не учитываются при расчете средневзвешенного курса.

Внутренние документы - утвержденные уполномоченными органами Биржи в соответствии с их компетенцией и размещенные на сайте Биржи в сети интернет внутренние документы, регламентирующие деятельность на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ПАО Московская Биржа, отношения, возникающие в связи проведением организованных торгов на указанных рынках и/или участием в них, в том числе права и обязанности Биржи и Участников торгов, порядок и особенности оказания Биржей услуг по проведению организованных торгов, условия заключаемых на организованных торгах Биржи договоров, порядок и сроки расчета Биржей цен, индексов и иных показателей, порядок документооборота и обмена информацией между Биржей и Участниками торгов. Под внутренними документами, в частности, понимаются настоящие Правила торгов, Правила допуска, спецификации и иные документы Биржи, на которые есть ссылка в настоящих Правилах торгов и/или Правилах допуска.

Временной регламент проведения торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов (Временной регламент) – Временной регламент проведения торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, утверждаемый Биржей по согласованию с Клиринговым центром. Временной регламент устанавливает время проведения торгов по каждому из инструментов, а также время выдачи отчетных документов.

Драгоценные металлы – золото, серебро, платина или палладий в обезличенном виде.

Заявка – передаваемое в торговую систему электронное сообщение, подписанное АСП Участника торгов, содержащее информацию, предусмотренную Правилами торгов и являющееся предложением Участника торгов заключить сделку с иностранной валютой/драгоценными металлами в соответствии с Правилами торгов на условиях, содержащихся в заявке.

Информация о заявках (за исключением адресных заявок), зарегистрированных в ТС, раскрывается всем Участникам торгов (отображается на всех рабочих местах Участников торгов).

Заявка считается поданной в надлежащей форме вне зависимости от вида рабочего места Участника торгов, использованного при подаче заявок.

Адресная заявка – заявка, не являющаяся безадресной заявкой. При подаче адресной заявки Участники торгов вправе указать другого Участника торгов в качестве конечного контрагента (в этом случае информация об адресной заявке отображается только на рабочем месте Участника торгов, подавшего заявку, и Участника торгов, указанного в данной адресной заявке в качестве конечного контрагента).

Безадресная заявка – заявка, адресованная (информация о которой раскрывается) всем Участникам торгов. Информация о безадресной заявке отображается на рабочих местах всех Участников торгов. Все иные заявки признаются адресными.

Исполнение заявки – заключение сделки в соответствии с условиями, указанными в заявке. Заявка может быть исполнена частично.

Исполненная заявка – заявка, по которой заключены сделки в соответствии с условиями, указанными в заявке. Заявка, по которой заключены сделки в полном объеме, является исполненной полностью. Заявка, по которой заключены сделки не в полном объеме, является исполненной частично.

Неисполненная заявка – заявка, по которой не заключено ни одной сделки.

Стандартные виды заявок – виды заявок, содержащие определенные, исключаяющие возможность их неоднозначного толкования, условия, предусмотренные настоящими Правилами торгов. Правилами торгов предусмотрены следующие виды заявок: лимитированные, рыночные и заявки со средневзвешенной ценой.

Лимитированная заявка – стандартный вид заявки, выражающий не требующее дополнительного подтверждения согласие купить определенное количество лотов по цене, не выше указанной в такой заявке максимальной цены покупки, или продать определенное количество лотов по цене, не ниже указанной в такой заявке минимальной цены продажи. Если стандартный тип лимитированной заявки не указан, заявка считается заявкой типа «поставить в очередь».

Рыночная заявка – стандартный вид заявки, выражающий не требующее дополнительного подтверждения согласие купить или продать определенное количество лотов по лучшим ценам заявок, зарегистрированных в ТС.

Заявка со средневзвешенной ценой – стандартный вид заявки, выражающий не требующее дополнительного подтверждения согласие купить определенное количество лотов при условии, что средневзвешенная цена сделок по покупке будет не выше максимальной средневзвешенной цены, указанной в такой заявке, или согласие продать определенное количество лотов при условии, что средневзвешенная цена сделок по продаже будет не ниже минимальной средневзвешенной цены, указанной в такой заявке.

Средневзвешенная цена сделок по покупке (по продаже), заключаемых на основании заявки со средневзвешенной ценой, определяется путем деления суммы произведений цен каждой из данных сделок на количество валюты лота в соответствующей сделке, на суммарное количество валюты лота в указанных сделках.

По данному виду заявки не допускается заключение адресных сделок, безадресных сделок типа «всем», а также сделок фикс, средневзвешенных сделок, сделок своп, своп контрактов и поставочных фьючерсов.

Стандартные типы заявок – типы заявок, содержащие особые дополнительные условия их исполнения. Разделяются следующие стандартные типы заявок: «снять остаток», «поставить в очередь», «полностью или отклонить» и «скрыть количество».

Заявка типа «снять остаток» – лимитированная заявка, или заявка со средневзвешенной ценой, или рыночная заявка, которая исполняется в максимально возможном объеме сразу же после ее регистрации в ТС, а ее остаток удаляется из ТС.

Заявка типа «поставить в очередь» – лимитированная заявка, которая исполняется в максимально возможном объеме сразу же после ее регистрации в ТС, после чего она ставится в очередь как лимитированная заявка с объемом в размере неисполненного остатка.

Заявка типа «полностью или отклонить» – лимитированная заявка, или заявка со средневзвешенной ценой, или рыночная заявка, которая исполняется полностью сразу же после ее регистрации в ТС, а при невозможности ее немедленного исполнения отклоняется.

Заявка типа «скрыть количество» – лимитированная заявка, в которой указывается количество лотов, не отображаемое в окне текущих котировок. Минимальное количество лотов, указываемых в заявке типа «скрыть количество» и отображаемых в окне текущих котировок, устанавливается решением Биржи по согласованию с Клиринговым центром. Максимальное соотношение количества лотов, скрытых в заявке типа «скрыть количество», к количеству лотов, отображаемых в окне текущих котировок, устанавливается решением Биржи по согласованию с Клиринговым центром. Заявки типа «скрыть количество» не могут подаваться в ТС с целью заключения сделок своп, своп контрактов и поставочных фьючерсных контрактов.

Встречные заявки – заявки, имеющие противоположную направленность, т.е. для заявок на продажу встречными являются заявки на покупку, и наоборот.

Допустимые встречные заявки – допустимыми встречными заявками по отношению к какой-либо заявке являются встречные заявки, удовлетворяющие ее условиям.

Допустимыми встречными заявками по отношению к какой-либо лимитированной заявке типа «поставить в очередь» или «снять остаток» являются встречные заявки, стоящие первыми в очереди, с ценами не большими, чем цена покупки (не меньшими, чем цена продажи), указанная в данной заявке.

В случае регистрации в ТС лимитированной заявки типа «полностью или отклонить» допустимыми встречными заявками являются встречные заявки, стоящие первыми в очереди, с ценами не большими, чем цена покупки (не меньшими, чем цена продажи), указанная в данной заявке, и совокупный объем которых не меньше указанного в подаваемой заявке.

Допустимыми встречными заявками по отношению к какой-либо заявке со средневзвешенной ценой типа «снять остаток» являются встречные заявки, стоящие первыми в очереди при условии, что при заключении сделок на основании данных заявок средневзвешенная цена сделок по покупке (сделок по продаже) будет не выше указанной в такой заявке максимальной средневзвешенной цены покупки (не ниже указанной в такой заявке минимальной средневзвешенной цены продажи).

Допустимыми встречными заявками по отношению к какой-либо заявке со средневзвешенной ценой типа «полностью или отклонить» являются встречные заявки, стоящие первыми в очереди при условии, что при заключении сделок на основании данных заявок средневзвешенная цена сделок по покупке (сделок по продаже) будет не выше указанной в такой заявке максимальной средневзвешенной цены покупки (не ниже указанной в такой заявке минимальной средневзвешенной цены продажи) и совокупный объем которых будет не меньше объема, указанного в подаваемой заявке со средневзвешенной ценой.

Допустимые встречные заявки на заключение адресной сделки (за исключением заявок на заключение сделок фикс и средневзвешенных сделок без указания конечных контрагентов) должны содержать одинаковые значения цены и объема, а также взаимные указания Участниками торгов друг друга в качестве конечных контрагентов по адресной сделке.

Заявка на заключение безадресной сделки типа «всем» – безадресная заявка, подаваемая во внесистемном режиме торгов путем выбора специального кода «всем», доступного на рабочих местах Участников торгов. Заявка на заключение безадресной сделки типа «всем» может подаваться Клиринговым центром в случаях, установленных п. 3.3.15 настоящих Правил торгов, и Участниками торгов в ответ на активную безадресную заявку типа «всем» Клирингового центра.

Заявка на заключение сделки своп – одновременно подаваемые Участником торгов заявки по двум различным сделкам спот с целью заключения сделки своп.

В случае если в заявке на заключение сделки спот обязательство по продаже иностранной валюты/драгоценного металла является обязательством с более поздней датой исполнения, то заявка на заключение сделки своп имеет направленность «покупка/продажа». В случае если в заявке на заключение сделки спот обязательство по покупке иностранной валюты/драгоценного металла является обязательством с более поздней датой исполнения, то заявка на заключение сделки своп имеет направленность «продажа/покупка».

Заявка на заключение сделки своп может подаваться как адресная или безадресная заявка или как заявка на заключение безадресной сделки типа «всем».

Заявка на заключение своп контракта – заявка, подаваемая Участником торгов с целью заключения своп контракта.

В случае если в заявке на заключение своп контракта обязательство по передаче в собственность базисного актива является обязательством с более поздней датой исполнения, то заявка на заключение своп контракта имеет направленность «покупка/продажа». В случае если в заявке на заключение своп контракта обязательство по приему в собственность базисного актива является обязательством с более поздней датой исполнения, то заявка на заключение своп контракта имеет направленность «продажа/покупка».

Заявка на заключение своп контракта может подаваться как адресная или безадресная заявка или как заявка на заключение безадресной сделки типа «все».

Заявка на заключение сделки типа «аукцион» – адресная заявка на заключение сделки своп, подаваемая в режиме торгов «Аукцион с Банком России», при подаче которой Участники торгов в качестве дополнительной информации указывают Банк России как конечного контрагента путем выбора специального кода «аукцион», доступного на рабочих местах Участников торгов.

Заявка на заключение сделки фикс – подаваемая в режиме фиксинга заявка на заключение сделки спот, при подаче которой Участники торгов указывают, что в качестве цены продажи/покупки будет использован курс фиксинга Московской Биржи, рассчитанный на дату, определенную в соответствии с параметрами этой сделки фикс.

Заявка на заключение средневзвешенной сделки – подаваемая в режиме заключения средневзвешенных сделок заявка на заключение сделки спот, при подаче которой Участники торгов указывают, что в качестве цены продажи/покупки будет использован средневзвешенный курс, рассчитанный на дату и время, определенные в соответствии с параметрами соответствующей средневзвешенной сделки.

Идентификатор Участника торгов – уникальный буквенно-цифровой код, присваиваемый Биржей Участнику торгов для получения технического доступа к ПТК ТЦ в порядке, предусмотренном Правилами допуска, с целью заключения сделок с иностранной валютой и/или драгоценными металлами.

Идентификатор спонсируемого доступа (ИСД) – уникальный буквенно-цифровой код, выдаваемый Техническим центром Участнику торгов по его заявлению с целью последующей передачи клиенту данного Участника торгов для подключения к подсистеме обработки поручений в порядке, предусмотренном Правилами допуска и настоящими Правилами торгов.

Каждый ИСД, выдаваемый Техническим центром, должен соответствовать краткому коду клиента, которому будет передан данный ИСД, торговому идентификатору и Идентификатору Участника торгов, подавшего заявление о выдаче данного ИСД.

Участник торгов вправе определить объем полномочий для каждого ИСД, выдаваемого ему Техническим центром, в том числе ограничить возможность подачи поручений.

Инструмент – сделка спот (в т.ч. сделка фикс, средневзвешенная сделка), сделка своп, своп контракт или, поставочный фьючерсный контракт, совокупность условий заключения каждой из которых на организованных торгах Биржи определена в соответствующей спецификации и (или) в списке параметров соответствующих сделок.

Итоговый курс своп контракта – курс исполнения обязательства по передаче в собственность базисного актива по второй части своп контракта, определяемый в соответствии с Правилами клиринга.

Итоговый курс сделки своп – курс сделки своп, определяемый по сделке спот с более поздней датой исполнения обязательств, численно равный сумме базового курса сделки своп и цены сделки своп.

Клиент Участника торгов (клиент) – юридическое или физическое лицо, зарегистрированное Биржей в качестве клиента Участника торгов в соответствии с Правилами допуска.

Клиринговый центр – Небанковская кредитная организация-центральный контрагент «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество), осуществляющая клиринг в соответствии с правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) и выполняющая функции центрального контрагента.

Конечный контрагент – Участник торгов, указываемый другим Участником торгов в соответствии с настоящими Правилами торгов в качестве контрагента в заявке на заключение адресной сделки.

Краткий код клиента Участника торгов (краткий код клиента) – буквенно-цифровой код, присваиваемый клиенту Участника торгов при регистрации клиента Участника торгов в торговой системе.

Кросс-сделки – сделки, заключенные на основании заявок, поданных за счет и в интересах одного и того же лица (в соответствии с кодом этого лица). Заключение кросс-сделок допускается в случае указания Участником(-ами) торгов соответствующей информации в порядке, предусмотренном Правилами допуска. При этом факт подачи заявок за счет и в интересах одного и того же лица устанавливается Биржей на основании данных, предоставленных при регистрации данного лица в соответствии с Правилами допуска.

Биржа вправе установить ограничения на совершение кросс-сделок.

Лот – стандартное количество валюты/драгоценных металлов, определяемое применительно к каждому инструменту в соответствии с настоящими Правилами торгов и/или соответствующей спецификацией.

Лучшая цена – цена заявки, находящаяся первой в очереди заявок, зарегистрированных в ТС.

Номер заявки – идентификационный номер, присваиваемый заявке при ее регистрации в ТС. Порядковый номер заявки возрастает в зависимости от времени выставления заявки Участником торгов.

ПАО Московская Биржа (Биржа) – организатор торговли, оказывающий в соответствии с настоящими Правилами организованных торгов услуги по организации торгов иностранной валютой и драгоценными металлами.

Организованные торги (торги) – торги иностранной валютой и/или драгоценными металлами, проводимые в порядке, установленном настоящими Правилами торгов.

Основная торговая сессия (основная сессия) – период времени в течение торгового дня с 07:00 до 23:50 по московскому времени, в течение которого проводятся организованные торги иностранной валютой и/или драгоценными металлами в режимах торгов, предусмотренных настоящими Правилами торгов.

Отчетные документы – документы, предоставляемые Биржей по итогам торгов Участнику торгов в соответствии с настоящими Правилами торгов и иными внутренними документами Биржи, устанавливающими формы и форматы документов, получаемых Участниками торгов.

Очередь заявок (очередь) – упорядоченная последовательность зарегистрированных в ТС заявок, неисполненных полностью или частично. Первой заявкой на покупку в очереди является заявка с максимальной ценой, далее – в порядке убывания цены. Первой заявкой на продажу в очереди является заявка с минимальной ценой, далее – в порядке возрастания цены. При равенстве цен в заявках одинаковой направленности приоритет имеет заявка, поступившая ранее. Перед началом торгов очередь отсутствует. В очередь заявок не включаются заявки на заключение адресных сделок (за исключением заявок на заключение сделок фикс и средневзвешенных сделок без указания конечных контрагентов). Все заявки, стоящие в очереди, имеют состояние «активная».

Параметры проведения дискретного аукциона на валютном рынке ПАО Московская Биржа (Параметры дискретного аукциона) – документ, являющийся частью настоящих Правил организованных торгов, утверждаемый уполномоченным органом ПАО Московская Биржа и определяющий параметры проведения дискретного аукциона, в т.ч.: период времени проведения дискретного аукциона, совокупные параметры заявок, при условии соблюдения которых дискретный аукцион считается состоявшимся, порядок определения цены дискретного аукциона, а также иные параметры, согласованные Биржей с Банком России.

Поручение – электронное сообщение клиента, подаваемое в подсистему обработки поручений и являющееся поручением клиента Участнику торгов на подачу заявки в ТС на заключение сделки с иностранной валютой/драгоценными металлами в соответствии с Правилами торгов на условиях, содержащихся в поручении.

Поручение на подачу алгоритмического пакета заявок – электронное сообщение клиента, подаваемое в подсистему обработки поручений и являющееся поручением клиента Участника торгов на формирование и подачу в ПТК ТЦ алгоритмического пакета заявок на условиях, содержащихся в поручении.

Поручение на подачу алгоритмического пакета заявок должно соответствовать условиям, предусмотренным настоящими Правилами торгов, а также должно содержать ИСД клиента, подавшего такое поручение и краткий код данного клиента.

Поставочный своп контракт (своп контракт) – заключаемый на организованных торгах договор, являющийся производным финансовым инструментом и предусматривающий обязанность каждой из сторон договора периодически уплачивать денежные суммы в зависимости от изменения цены базисного актива в соответствии с Правилами клиринга, а также обязанность в дату исполнения обязательств по первой части своп контракта одной стороны (покупателя) передать базисный актив в объеме сделки в валюте лота в собственность второй стороне (продавца), и обязанность второй стороны (продавца) принять базисный актив и уплатить первой стороне (покупателю) сумму в сопряженной валюте в объеме, определяемом в соответствии со спецификацией, и в порядке, определяемом в соответствии с Правилами клиринга, а также обязанность в дату исполнения обязательств по второй части своп контракта второй стороны (продавца) передать базисный актив в объеме сделки в собственность первой стороне (покупателю) и обязанность первой стороны (покупателя) принять базисный актив и уплатить второй стороне (продавцу) сумму в сопряженной валюте в объеме и в порядке, определяемыми Правилами клиринга.

В случае если обязательство по передаче в собственность базового актива является обязательством с более поздней датой исполнения, то своп контракт имеет направленность «покупка/продажа». В случае если обязательство по приему в собственность базового актива является обязательством с более поздней датой исполнения, то своп контракт имеет направленность «продажа/покупка».

Поставочный фьючерсный контракт (поставочный фьючерс) – заключаемый на организованных торгах договор, являющийся производным финансовым инструментом, и предусматривающий обязанность каждой из сторон договора периодически уплачивать денежные суммы в зависимости от изменения цены базисного актива в соответствии с Правилами клиринга, а также обязанность одной стороны договора (продавца) передать в собственность второй стороне (покупателю) базисный актив в объеме сделки и обязанность второй стороны (покупателя) принять базисный актив и уплатить первой стороне (продавцу) сумму в сопряженной валюте в объеме и в порядке, определяемыми в соответствии с Правилами клиринга.

Правила допуска – документ, определяющий порядок допуска лиц к участию в организованных торгах на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, их идентификацию, регистрацию Участников торгов, клиентов, порядок приостановления (прекращения) допуска к

участию в торгах на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, утвержденный уполномоченным органом ПАО Московская Биржа.

Правила организованных торгов (Правила торгов) – настоящие Правила организованных торгов ПАО Московская Биржа на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, утвержденные уполномоченным органом ПАО Московская Биржа.

Правила клиринга – внутренний документ Клирингового центра, регламентирующий порядок осуществления клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

Правила ЭДО – Правила электронного документооборота, утвержденные уполномоченным органом ПАО Московская Биржа.

Программно-технический комплекс Технического центра (ПТК ТЦ) – совокупность программно-технических средств Технического центра, используемых для оказания Участнику торгов услуг в соответствии с договорами, заключаемыми между Участником торгов и Техническим центром. ПТК ТЦ обеспечивает защищенность и целостность заявок Участников торгов в ТС в результате применения комплекса организационных и технических мер.

Подсистема ПТК ТЦ – составная часть ПТК ТЦ, предназначенная для оказания Участнику торгов определенного набора услуг. Торговая система, Клиринговая система и подсистема обработки поручений являются подсистемами ПТК ТЦ.

Подсистема обработки поручений – подсистема ПТК ТЦ, предназначенная для обработки поручений, подаваемых клиентом Участнику торгов, и (или) для получения клиентом Участника торгов информации, необходимой для подачи поручений.

Рабочее место клиента Участника торгов (РМК) – совокупность программно-технических средств, предназначенных для использования клиентом Участника торгов в целях получения технического доступа к подсистеме обработки поручений.

Рабочее место Участника торгов – совокупность программно-технических средств, предназначенных для использования Участником торгов в целях получения технического доступа к ПТК ТЦ.

В целях настоящих Правил торгов определяются следующие виды рабочих мест:

- рабочее место Участника торгов, получающего технический доступ к ПТК ТЦ с использованием удаленного рабочего места (далее – РМ УРМ);
- рабочее место Участника торгов, получающего технический доступ к ПТК ТЦ с использованием системы передачи информации Рейтер (далее – РМ Рейтер);
- рабочее место Участника торгов, получающего технический доступ к ПТК ТЦ с использованием внешних программно-технических средств (далее – РМ ВПТС).

Рабочий день – день, являющийся рабочим в соответствии с законодательством Российской Федерации.

Режим заключения сделок фикс (режим фиксинга) – режим торгов, в котором Участники торгов могут подавать заявки на заключение сделок фикс. Сделки, заключенные в режиме фиксинга, не учитываются в расчете средневзвешенного курса.

Режим заключения средневзвешенных сделок – режим торгов, в котором Участники торгов могут подавать заявки на заключение средневзвешенных сделок. Сделки, заключенные в режиме средневзвешенных сделок, не учитываются в расчете средневзвешенного курса.

Режим исполнения обязательств по поставочным срочным контрактам – режим торгов, в котором в целях исполнения обязательств по поставочным фьючерсным контрактам, заключенным Участниками торгов на срочном рынке Биржи (далее – поставочные срочные кон-

тракты), заключаются сделки спот с иностранной валютой/драгоценным металлом, являющимся базисным активом соответствующих поставочных срочных контрактов, заключенных Участниками торгов.

Сделка своп – две взаимосвязанные сделки спот. По условиям сделки своп Участник торгов, заключая сделку спот по покупке иностранной валюты/драгоценного металла одновременно заключает другую сделку спот по продаже иностранной валюты/драгоценного металла с совпадающей валютой лота и совпадающей сопряженной валютой, и наоборот, заключая сделку спот по продаже иностранной валюты/драгоценного металла одновременно заключает другую сделку спот по покупке иностранной валюты/драгоценного металла с совпадающей валютой лота и совпадающей сопряженной валютой. При этом сумма в валюте лота обеих сделок совпадает.

В случае если обязательство по сделке спот по продаже иностранной валюты/драгоценного металла является обязательством с более поздней датой исполнения, то сделка своп имеет направленность «покупка/продажа». В случае если обязательство по сделке спот по покупке иностранной валюты/драгоценного металла является обязательством с более поздней датой исполнения, то сделка своп имеет направленность «продажа/покупка».

Сделка спот – сделка купли-продажи иностранной валюты/драгоценного металла, при заключении которой Участник торгов покупает/продает валюту лота за сопряженную валюту на условиях, определяемых в соответствующей спецификации.

Сделка фикс – заключаемая в режиме фиксинга сделка спот с иностранной валютой, по условиям заключения которой Участник торгов покупает/продает валюту лота за сопряженную валюту по курсу фиксинга Московской Биржи в порядке, предусмотренном настоящими Правилами торгов. Инструменты, по которым допускается заключение сделок фикс, определены в списке параметров соответствующих сделок.

Система Рейтер (Рейтер) – программно-аппаратный комплекс, предоставляемый компанией «Томсон Рейтер», предназначенный для передачи информационных сообщений в ходе заключения сделок на организованных торгах Участниками торгов.

Системный режим торгов – режим торгов, проводимых на условиях двойного непрерывного встречного аукциона, при котором Участники торгов могут подавать безадресные заявки (за исключением заявок на заключение безадресных сделок типа «всем»), а также заявки на заключение сделок фикс и средневзвешенных сделок без указания конечных контрагентов. Заявки, подаваемые в системном режиме торгов, попадают в очередь заявок.

Сопряженная валюта – валюта, за которую производится покупка или продажа лотов инструмента.

Спецификация – каждый из утверждаемых Биржей по согласованию с Клиринговым центром документов, определяющих совокупность условий заключения сделок спот (в т.ч. сделок фикс и средневзвешенных сделок), сделок своп, своп контрактов или поставочных фьючерсных контрактов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ПАО Московская Биржа, а также иные положения в соответствии с нормативными актами в сфере финансовых рынков.

Средневзвешенный курс по инструменту (средневзвешенный курс) – величина, определяемая в ходе торгов по соответствующим сделкам спот, численно равная отношению суммарного объема заключенных Участниками торгов сделок в сопряженной валюте к суммарному объему сделок в валюте лота. Для сделок своп и своп контрактов средневзвешенный курс определяется как отношение разницы вторых и первых частей сделок своп/своп контрактов в сопряженной валюте к объему сделок своп/своп контрактов в валюте лота.

Курс иностранной валюты определяется по каждому инструменту с такой иностранной валютой, являющемуся сделкой спот, в порядке, установленном для определения средневзвешенного курса.

Средневзвешенная сделка – заключаемая в режиме заключения средневзвешенных сделок сделка спот с иностранной валютой, по условиям заключения которой Участник торгов покупает/продает валюту лота за сопряженную валюту по средневзвешенному курсу в порядке, предусмотренном настоящими Правилами торгов. Инструменты, по которым допускается заключение средневзвешенных сделок, определены в списке параметров соответствующих сделок.

Срочный контракт – договор, являющийся производным финансовым инструментом, как он определен в правилах клиринга клирингового центра, регламентирующих порядок осуществления клиринга на срочном рынке Биржи.

Технический доступ к ПТК ТЦ (технический доступ) – техническая возможность использования Участником торгов необходимого ему набора функций одной или нескольких подсистем ПТК ТЦ.

Технический центр (ТЦ) – организация, обеспечивающая поддержку и функционирование ПТК ТЦ и предоставляющая Участникам торгов комплекс услуг интегрированного технологического сервиса. Техническим центром является ПАО Московская Биржа.

Торговый идентификатор Участника торгов (торговый идентификатор, логин) – уникальный буквенно-цифровой код, присваиваемый Техническим центром Участнику торгов. Торговый идентификатор формируется на основе Идентификатора Участника торгов, что подтверждает соответствие торгового идентификатора Идентификатору Участника торгов и позволяет однозначно идентифицировать Участника торгов.

Торговая система (ТС) – подсистема ПТК ТЦ, предназначенная для заключения сделок с иностранной валютой и драгоценными металлами Участниками торгов, а также подготовки документов по итогам торгов в соответствии с Правилами торгов.

Торгово-клиринговый счет (ТКС) – регистрируемый в порядке, предусмотренном Правилами клиринга, Торгово-клиринговый счет 1-го уровня / Торгово-клиринговый счет 2-го уровня / Торгово-клиринговый счет 3-го уровня, информация о котором становится доступной Бирже от Клирингового центра посредством ПТК ТЦ.

Торговый день – день, в который Биржа проводит организованные торги иностранной валютой и/или драгоценными металлами.

Торги иностранной валютой и (или) драгоценными металлами проводятся ежедневно, кроме установленных в соответствии с законодательством Российской Федерации выходных и праздничных нерабочих дней. Биржа по согласованию с Клиринговым центром вправе принять решение об отмене проведения торгов (в том числе по отдельным инструментам) в установленный в соответствии с законодательством Российской Федерации рабочий день и/или о проведении торгов (в том числе по отдельным инструментам) в установленный в соответствии с законодательством Российской Федерации выходной или праздничный нерабочий день.

Уполномоченный представитель Биржи – лицо, надлежащим образом уполномоченное Биржей совершать от ее имени действия, предусмотренные настоящими Правилами торгов.

Участники торгов – Банк России, Клиринговый центр и организации, допущенные к организованным торгам после выполнения установленных Биржей условий допуска.

Положения настоящих Правил торгов об Участниках торгов применяются к Банку России и Клиринговому центру, если настоящими Правилами торгов и (или) договором(-ами), заключенным между Биржей и (или) Банком России и (или) Клиринговым центром не предусмотрено специальных положений.

Цена своп контракта – величина, указываемая Участником торгов при подаче заявки на заключение своп контракта в качестве его условия и определяющая разницу между базовым курсом своп контракта и итоговым курсом своп контракта, определенным на момент его заключения.

Цена сделки своп – величина, указываемая Участниками торгов при подаче заявки на заключение сделки своп в качестве ее условия и используемая при расчете итогового курса сделки своп. Цена сделки своп численно равна разнице между итоговым и базовым курсом сделки своп (своп разница).

При подаче Участником торгов заявки на заключение сделки типа «аукцион» цена сделки своп может указываться как в виде своп разницы, так и в виде рублевой процентной ставки, рассчитанной в соответствии с формулой расчета величины своп разницы по сделкам валютный своп Банка России, размещенной на официальном сайте Банка России в сети интернет.

Фиксинг Московской Биржи (фиксинг) – курс иностранной валюты одной страны, выраженный в денежной единице другой страны, определяемый в соответствии с внутренним документом Биржи, устанавливающим методику расчета фиксинга Московской Биржи.

Шаг цены – минимально возможная разница между ценами, указанными в заявках одинаковой направленности.

Термины, специально не определенные в настоящих Правилах торгов, используются в значениях, установленных в Правилах допуска, Правилах клиринга, спецификациях и иных документах, утверждаемых Биржей.

2. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

2.1 Принципы заключения сделок на организованных торгах

2.1.1 Настоящие Правила торгов определяют порядок заключения сделок с иностранной валютой и драгоценными металлами на валютном рынке и рынке драгоценных металлов Биржи, а также общий порядок взаимодействия Биржи с Участниками торгов.

Настоящие Правила торгов, все изменения и дополнения в них, а также дата и порядок вступления в силу Правил торгов утверждаются уполномоченным органом Биржи.

Утвержденные уполномоченным органом Биржи Правила торгов, а также изменения и дополнения в них, в том числе Правила торгов в новой редакции, раскрываются на сайте Биржи в сети интернет и вступают в силу не ранее чем через пять дней после дня раскрытия информации. Дата вступления в силу Правил торгов, изменений и дополнения в них, в том числе Правил торгов в новой редакции, также раскрывается на сайте Биржи в сети интернет.

Дополнительно информация об утверждении и вступлении в силу настоящих Правил торгов, а также всех изменений и дополнений в них доводится до Клирингового центра и Участников торгов не позднее, чем за три рабочих дня до даты вступления их в силу путем направления информационного сообщения любым из следующих способов:

- а) в электронной форме через Торговую систему;
- б) в форме электронного документа по электронной почте;
- в) иным способом.

2.1.2 Биржа проводит организованные торги иностранной валютой и/или драгоценными металлами, в ходе которых Участниками торгов заключаются сделки в соответствии с настоящими Правилами торгов.

Банк России заключает сделки с иностранной валютой/драгоценными металлами в порядке, предусмотренном Правилами торгов, Правилами клиринга и договором о взаимодействии, заключаемым между Банком России, Биржей и Клиринговым центром.

2.1.3 Клиринг по итогам организованных торгов на Бирже осуществляется с участием центрального контрагента, которым является Клиринговый центр. Клиринговый центр является стороной по всем сделкам, заключенным в соответствии с настоящими Правилами торгов.

2.1.4 Биржа по согласованию с Клиринговым центром устанавливает время проведения торгов по каждому из инструментов во Временном регламенте, раскрываемом Участникам торгов на сайте Биржи в сети интернет.

Обо всех изменениях, касающихся дня и/или времени проведения торгов (в том числе по отдельным инструментам), Биржа извещает Участников торгов не позднее, чем за три рабочих дня до даты введения указанных изменений в действие путем раскрытия информации на сайте Биржи в сети интернет (если иной срок не установлен решением Биржи).

2.1.5 В ходе проведения организованных торгов ПТК ТЦ обеспечивает защищенность и целостность заявок/алгоритмических пакетов заявок Участников торгов в ПТК ТЦ в результате применения комплекса организационных и технических мер, включающих в себя, в том числе:

- использование Участником торгов торгового идентификатора и пароля для аутентификации Участника торгов, получающего технический доступ к ПТК ТЦ;
- наличие специальной процедуры передачи Участнику торгов сведений о присвоенном торговом идентификаторе, обеспечивающей защиту данной информации от несанкционированного доступа;
- использование специальной технологии регистрации в ПТК ТЦ заявок/алгоритмических пакетов заявок, исключающей возможность изменения условий заявок после их регистрации в ПТК ТЦ (при условии строгого соблюдения Биржей, ТЦ и Участниками торгов положений настоящих Правил торгов);
- использование специализированных программно-аппаратных средств, обеспечивающих однозначную идентификацию в промышленной сети связи Биржи рабочего места Участника торгов по IP-адресу;
- использование средств криптографической защиты информации Системы электронного документооборота Биржи для обеспечения контроля целостности и защиты информации от несанкционированного доступа при передаче ее по сети связи общего пользования.

2.1.6 Порядок использования Участниками торгов рабочих мест Участников торгов при подаче ими заявок и заключении сделок на организованных торгах посредством РМ Рейтер устанавливается внутренними документами Биржи, в которых указаны требования к оформлению сообщений при подаче заявок Участником торгов посредством РМ Рейтер.

2.1.7 Биржа в соответствии с настоящими Правилами торгов вправе принять решение о приостановке торгов:

- при необходимости изменения параметров, установленных в ПТК ТЦ;
- в случаях, предусмотренных п. 3.7 настоящих Правил торгов.

Биржа обязана приостановить или прекратить торги в случаях, порядке и сроки, предусмотренные соответствующими нормативными актами в сфере финансовых рынков, а также в

случаях, установленных федеральными законами, и в случаях получения соответствующего предписания Банка России о приостановлении или прекращении торгов иностранной валютой/драгоценными металлами.

При возобновлении торгов торги проводятся до окончания времени проведения торгов, за исключением случаев, предусмотренных п. 3.7 настоящих Правил торгов, а также если иное не установлено соответствующими нормативными актами в сфере финансовых рынков, федеральными законами или предписанием Банка России. При этом Участники торгов повторно выполняют все процедуры, необходимые для их аутентификации в ПТК ТЦ.

Информация о приостановлении, прекращении и возобновлении торгов раскрывается на сайте Биржи в сети интернет, если иное не предусмотрено соответствующими нормативными актами в сфере финансовых рынков.

2.1.8 Настоящие Правила торгов, а также все вытекающие из Правил торгов права и обязанности Биржи и Участников торгов толкуются в соответствии с законодательством Российской Федерации. Сделки с иностранной валютой/драгоценными металлами, заключаемые на организованных торгах между Участниками торгов и Клиринговым центром, а также все вытекающие из указанных сделок права и обязанности Биржи, Клирингового центра и Участников торгов регулируются законодательством Российской Федерации.

2.2 Общий порядок взаимодействия Биржи с Участниками торгов

2.2.1 Порядок взаимодействия Биржи с Участниками торгов регулируется настоящими Правилами торгов и Правилами допуска.

2.2.2 Биржа обеспечивает допуск Участников торгов к организованным торгам иностранной валютой и/или драгоценными металлами и предоставляет отчетные документы.

2.2.3 Участник торгов вправе:

- а) подавать заявки/алгоритмические пакеты заявок и заключать на организованных торгах сделки от своего имени и за свой счет (права и обязанности по таким сделкам возникают у Участника торгов);
- б) подавать заявки/алгоритмические пакеты заявок и заключать на организованных торгах сделки от своего имени в интересах и за счет клиента (права и обязанности по таким сделкам возникают у Участника торгов);
- в) подавать заявки/алгоритмические пакеты заявок и заключать на организованных торгах сделки от имени в интересах и за счет клиента, являющегося Участником клиринга (права и обязанности по таким сделкам возникают у Участника клиринга);
- г) подавать заявки/алгоритмические пакеты заявок и заключать на организованных торгах сделки с указанием клирингового брокера (права и обязанности по таким сделкам возникают у клирингового брокера).

Положения подпунктов «а» и «б» настоящего пункта распространяются только на Участников торгов, являющихся Участниками клиринга.

Участники торгов, заключающие сделки с драгоценными металлами в интересах и за счет клиентов, и не являющиеся брокерами, имеющими лицензию профессионального участника рынка ценных бумаг, включаются Биржей в соответствующий список, условия и порядок включения в который, а также условия и порядок исключения из которого устанавливаются Биржей.

При этом Участники торгов обязаны обеспечивать соответствие содержания заявок/алгоритмических пакетов заявок, подаваемых от своего имени и за свой счет, а также от своего имени

и по поручению клиентов, требованиям нормативных правовых актов, регламентирующего порядок заключения сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами.

2.2.4 В целях обеспечения бесперебойного функционирования ПТК ТЦ Биржа вправе принять решение о приостановке возможности подачи, изменения и снятия заявок/алгоритмического пакета заявок с использованием отдельного торгового идентификатора в день торгов, в течение которого на протяжении установленного Биржей периода времени превышалось:

- установленное внутренними документами Биржи, в которых установлены параметры заявок, среднее допустимое количество действий в секунду, выполняемых в ТС с использованием соответствующего торгового идентификатора, или
- установленное внутренними документами Биржи, в которых установлены параметры заявок, среднее допустимое количество сообщений об ошибке в секунду, формируемых в ТС вследствие ошибочных действий, выполняемых с использованием соответствующего торгового идентификатора.

При этом для целей настоящего пункта Правил торгов под действием, выполняемым с использованием торгового идентификатора в ТС, понимается: подача заявки, снятие заявки или изменение заявки.

Возможность подачи, изменения и снятия заявок/алгоритмических пакетов заявок с использованием торгового идентификатора приостанавливается до получения Биржей уведомления от Участника торгов об исправлении ошибок программного обеспечения, используемого Участником торгов (форма уведомления утверждается Биржей и раскрывается на сайте Биржи в сети интернет), а при повторном достижении критериев в течение данного дня торгов – до окончания данного дня торгов.

В случае приостановки возможности подачи, изменения и снятия заявок/алгоритмических пакетов заявок активные заявки/алгоритмические пакеты заявок, ранее поданные с использованием соответствующего торгового идентификатора, могут быть сняты по требованию Участника торгов в порядке, предусмотренном п. 3.6.2 настоящих Правил торгов. При этом указание Участником торгов номеров активных заявок/алгоритмического пакета заявок, поданных с использованием соответствующего торгового идентификатора, не требуется.

2.2.5 Участник торгов уплачивает Бирже вознаграждение, которое рассчитывается и взимается Клиринговым центром в пользу Биржи на основании договора о взаимодействии, заключенного между Биржей и Клиринговым центром, и в соответствии с Правилами клиринга в отношении сделок, заключенных с использованием присвоенного Участнику торгов Идентификатора Участника торгов. Участник клиринга, определенный в соответствии с Правилами клиринга, исполняет за Участника торгов обязательства по уплате вознаграждений Бирже и Техническому центру.

Банк России уплачивает Бирже вознаграждение в порядке, установленном договором о взаимодействии, заключенным между Банком России, Биржей и Клиринговым центром.

Клиринговый центр уплачивает Бирже вознаграждение в соответствии с договором о взаимодействии, заключенным между Клиринговым центром и Биржей.

2.2.6 Биржа предоставляет Участникам торгов информацию, в том числе биржевую информацию, в объеме и порядке, как это предусмотрено законодательством Российской Федерации и настоящими Правилами торгов. Биржа является обладателем всей информации, связанной с ходом и итогами торгов на Бирже.

Биржа вправе предоставлять Участникам торгов биржевую информацию за плату, если иное не предусмотрено законодательством Российской Федерации. Тарифы на услуги по предоставлению биржевой информации и порядок оплаты таких услуг определяются Биржей.

Раскрытие информации, содержащейся в реестре заявок и реестре сделок, не относящейся к инсайдерской информации и/или служебной информации и/или коммерческой тайне Биржи, осуществляется только Участникам торгов, за исключением случаев, когда предоставление такой информации должно быть осуществлено в силу требований законов и иных нормативных правовых актов Российской Федерации.

2.2.7 В отношении информации, ставшей доступной Участнику торгов при использовании ТС и не являющейся биржевой информацией, Участник торгов обязан соблюдать режим конфиденциальности, в том числе не передавать данную информацию своим клиентам, если иное не предусмотрено отдельным договором Участника торгов с Биржей и/или настоящими Правилами торгов и/или законодательством Российской Федерации.

Биржа вправе требовать от Участника торгов возмещения убытков, возникших у Биржи в связи с нарушением Участником торгов режима конфиденциальности информации, ставшей доступной Участнику торгов при использовании ТС.

2.2.8 Участник торгов обязан:

- а) не раскрывать информацию, связанную с работой ТС, ставшую доступной Участнику торгов в процессе участия в торгах;
- б) предоставлять информацию, относящуюся к конкретному клиенту, только непосредственно этому клиенту;
- в) использовать биржевую информацию исключительно в целях участия в торгах (принятия решения о подаче заявок/алгоритмических пакетов заявок и совершения сделок) на Бирже;
- г) заключать договоры с Биржей для использования биржевой информации в случаях Non-display использования, как оно определено в Порядке использования Биржевой информации, предоставляемой ПАО Московская Биржа;
- д) заключать договоры с Биржей для использования биржевой информации в любых иных целях, не связанных с участием в торгах (принятием решения о подаче заявок/алгоритмических пакетов заявок и заключения сделок), включая использование биржевой информации для расчета производных показателей (цифровые данные, в том числе индексы и индикаторы, рассчитанные на основе биржевой информации), с целью их дальнейшего распространения; данное требование не относится к биржевой информации новостного и уведомительного характера (новости, объявления, информация о событиях и мероприятиях);
- е) в случае предоставления клиенту биржевой информации предупреждать клиента в письменной форме (под подпись об ознакомлении), что он может использовать биржевую информацию только в целях принятия решения о подаче поручений Участнику торгов для заключения сделок на Бирже, а также о мерах ответственности за нарушения при использовании биржевой информации, предусмотренных п. 2.2.11 настоящих Правил торгов;
- ж) в письменной форме (под подпись об ознакомлении) информировать клиента, подключающегося к ПТК ТЦ с использованием ИСД, о необходимости ознакомиться с документами Биржи, регулирующими порядок использования биржевой информации, и соблюдать установленные такими документами требования;
- з) соблюдать требования настоящих Правил торгов, Правил допуска, документов, регулирующих порядок использования биржевой информации, и иных внутренних документов Биржи, которые содержат положения, обязательные для выполнения Участником торгов.

2.2.9 В случае распространения Участником торгов биржевой информации или использования этой информации для расчета производных показателей (цифровых данных, в том числе индексов и индикаторов, рассчитанных на основе биржевой информации), с целью их дальнейшего распространения, или в иных целях, не предусмотренных настоящими Правилами торгов, без заключения договора с Биржей, Участник торгов несет ответственность в порядке, предусмотренном в п. 2.2.10 настоящих Правил торгов. Положения настоящего абзаца не относятся к биржевой информации новостного и уведомительного характера (новости, объявления, информация о событиях и мероприятиях).

Не является распространением биржевой информации и не влечет применение мер ответственности в соответствии с настоящим пунктом предоставление Участником торгов своему клиенту биржевой информации в объеме, необходимом для принятия решения о подаче поручений Участнику торгов для заключения сделок на Бирже, а также об итогах торгов в отношении сделок, заключенных в интересах этого клиента.

2.2.10 В случае распространения и/или предоставления Участником торгов биржевой информации третьим лицам, не являющимся клиентами, неисполнения обязанности, предусмотренной п. 2.2.11 настоящих Правил торгов, а также использования Участником торгов биржевой информации с нарушением порядка, предусмотренного настоящими Правилами торгов и/или иными документами Биржи, регулирующими порядок использования биржевой информации, к Участнику торгов может быть применена одна из следующих мер ответственности:

- предупреждение о нарушении в письменном виде;
- штраф в размере 250 000 (Двести пятьдесят тысяч) рублей;
- приостановление допуска к участию в торгах на срок до шести месяцев;
- прекращение допуска к участию в торгах.

2.2.11 В случае использования клиентом биржевой информации в целях, отличных от целей принятия решения о подаче поручений Участнику торгов для заключения сделок на Бирже, а также в случае нарушения клиентом требований документов Биржи, регулирующих порядок использования биржевой информации, Участник торгов обязан применить к клиенту одну из следующих мер ответственности:

- предупреждение о нарушении в отношении использования биржевой информации в письменном виде;
- приостановка предоставления клиенту биржевой информации до устранения допущенных клиентом нарушений в отношении использования биржевой информации.

2.2.12 Биржа или лицо, действующее от имени Биржи, вправе осуществлять действия по проверке корректности использования Участником торгов биржевой информации, предоставленной ему Биржей (далее – информационный аудит).

Информационный аудит проводится с предварительным уведомлением Участника торгов в порядке, исключающем создание каких-либо препятствий в осуществлении им своей профессиональной деятельности.

Условия и процедура проведения информационного аудита определены в документе, определяющем порядок использования биржевой информации, раскрываемом на официальном сайте ПАО Московская Биржа в сети интернет.

2.2.13 Биржа осуществляет контроль за Участниками торгов в порядке, предусмотренном настоящими Правилами торгов, Правилами допуска, в документе, определяющем порядок использования биржевой информации. В случае нарушения Участником торгов требований настоящих Правил торгов, Правил допуска, документа, определяющего порядок использования биржевой информации, к Участникам торгов, в отношении которых осуществляется контроль, за нарушения, установленные указанными документами, за нарушения, касающиеся порядка участия в торгах, в т.ч. в случаях нарушения порядка подачи заявок/алгоритмических

пакетов заявок и заключения сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами могут быть применены следующие меры воздействия:

- официальное предупреждение;
- наложение штрафа в размере рублевого эквивалента 300 долларов США за первый установленный факт нарушения. Размер штрафа увеличивается на 50% за каждое повторное нарушение, но не свыше 3000 долларов США в рублевом эквиваленте;
- приостановление допуска к участию в торгах;
- прекращение допуска к участию в торгах.

2.2.14 Следующие нарушения настоящих Правил торгов относятся Биржей к существенным (значительным) нарушениям:

- нарушение Участником торгов порядка использования и/или распространения и/или предоставления биржевой информации (кроме случаев неисполнения Участником торгов требований, предусмотренных подпунктами «е» – «ж» пункта 2.2.8 и пунктом 2.2.11 настоящих Правил торгов);
- неоднократное, в течение трех календарных месяцев, неисполнение Участником торгов заключенных сделок;
- неуплата Участником торгов в установленные сроки и в установленных размерах штрафов Бирже;
- осуществление Участником торгов действий, которые создают или могут создать угрозу нормальному ходу проведения торгов и осуществления клиринга;
- нарушение Участником торгов правил поведения сторон при разрешении споров в соответствии с разделом 7 настоящих Правил торгов.

2.2.15 Для случаев, когда Участник торгов является Участником торгов, совпадающим в одном лице с Участником клиринга, Участник торгов соглашается, что Биржа передает Клиринговому центру информацию о кратких кодах клиентов данного Участника торгов, информацию, полученную Биржей от Участника торгов для регистрации клиентов, а также информацию об имеющемся разрешении/запрете совершения кросс-сделок на основании заявок, поданных за счет одного и того же Участника торгов/клиента Участника торгов. Переданная в соответствии с настоящим положением информация может использоваться Клиринговым центром для определения факта подачи предложений на заключение внебиржевых сделок в Клиринговой системе за счет и в интересах одного и того же лица.

2.3 Общий порядок взаимодействия Биржи с Клиринговым центром

2.3.1 Порядок взаимодействия Биржи и Клирингового центра при проведении организованных торгов и исполнении обязательств по итогам клиринга регулируется настоящими Правилами торгов, Правилами клиринга, а также договорами, заключаемыми между Клиринговым центром и Биржей.

2.3.2 Клиринговый центр вправе направлять Бирже уведомления о необходимости приостановления возможности подачи Участником торгов заявок, а также уведомления о снятии всех или части заявок Участника торгов в случаях и порядке, установленных Правилами клиринга. При получении указанных уведомлений Клирингового центра Биржа соответственно приостанавливает возможность как подачи заявок, так и алгоритмических пакетов заявок, а также снимает зарегистрированные в ПТК ТЦ заявки и алгоритмические пакеты заявок (в случае, если в алгоритмическом пакете заявок находятся заявки еще не поданные в ТС).

3. ПРОВЕДЕНИЕ ТОРГОВ

3.1 Общие положения

3.1.1 Заключение Участниками торгов сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами на организованных торгах допускается только при условии положительного результата проверки возможности заключения каждой такой сделки. Указанная проверка осуществляется Клиринговым центром в соответствии с Правилами клиринга.

3.1.2 В ходе торгов проверка возможности заключения сделок на торгах Участником торгов осуществляется Клиринговым центром на основании информации, доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

3.1.3 Иностранная валюта/драгоценный металл допускаются к организованным торгам на Бирже путем введения в действие спецификации и (или) списка параметров, содержащей инструмент (инструменты) по соответствующей валюте/драгоценному металлу.

Допуск иностранной валюты/драгоценного металла к организованным торгам на Бирже прекращается на основании решения уполномоченного органа Биржи с даты, предусмотренной соответствующим решением, или с даты прекращения действия всех спецификаций и (или) списка параметров, содержащих инструменты по соответствующей валюте/драгоценному металлу.

3.1.4 Биржа не позднее одного торгового дня, следующего за днем принятия решения о прекращении организованных торгов, раскрывает на своем сайте в сети интернет информацию о прекращении торгов торгуемыми инструментами.

Биржа раскрывает на своем сайте в сети интернет информацию о прекращении организованных торгов всеми торгуемыми инструментами на валютном рынке и рынке драгоценных металлов или всеми торгуемыми инструментами в отдельном режиме торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов не позднее, чем за один месяц до даты прекращения оказания соответствующих услуг с одновременным направлением данной информации в Банк России.

3.1.5 Заключение сделок, являющихся производными финансовыми инструментами, на валютном рынке и рынке драгоценных металлов Биржи возможно начиная с даты введения в действие спецификации соответствующего производного финансового инструмента, если иное не установлено решением Биржи.

Заключение сделок, являющихся производными финансовыми инструментами, на валютном рынке и рынке драгоценных металлов Биржи прекращается с даты прекращения действия спецификации соответствующего производного финансового инструмента, если иное не установлено решением Биржи.

При возникновении обстоятельств, которые приводят к существенному изменению условий или к прекращению обращения базисного актива, в связи с чем становится невозможным исполнение сделки, являющейся производным финансовым инструментом в установленном порядке, Биржа вправе принять решение о приостановлении или прекращении заключения соответствующих сделок.

После прекращения (устранения) обстоятельств, приведших к существенному изменению условий или к прекращению обращения базисного актива, в связи с чем было приостановлено или прекращено заключение сделок, являющихся производными финансовыми инструментами, Биржа вправе принять решение о возобновлении заключения сделок с производными финансовыми инструментами с данным базисным активом.

3.1.6 Заявки/алгоритмические пакеты заявок Участника торгов, зарегистрированные в ПТК ТЦ и подписанные АСП Участника торгов, признаются электронными документами, равнозначными документам, совершенным в письменной форме.

3.1.7 При подаче электронных сообщений, подписанных АСП Участника торгов, Биржа осуществляет идентификацию лица, подписавшего электронное сообщение, путем проверки соответствия АСП Участника торгов, содержащегося в электронном сообщении, торговому идентификатору, присвоенному Техническим центром Участнику торгов.

Сведения о присвоенном торговом идентификаторе относятся к конфиденциальным. Участники торгов, Биржа и Технический центр обеспечивают соблюдение требований о конфиденциальности.

3.1.8 Условия заключения сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами (лот, точность указания цены заявок, шаг цены и др.) устанавливаются в соответствующих спецификациях.

3.1.9 Биржа извещает Участников торгов о введении в действие, прекращении действия спецификаций, о внесении в спецификации изменений не позднее, чем за три рабочих дня до даты введения спецификаций в действие, прекращении действия спецификаций, вступления в силу изменений в спецификации.

3.2 Аутентификация участников торгов и клиентов, использующих ИСД

3.2.1 Аутентификация Участников торгов, принимающих участие в торгах посредством РМ УРМ, проводится перед началом торгов в соответствии со следующей процедурой:

3.2.1.1 В ТС Участником торгов вводится торговый идентификатор и пароль. Пароль устанавливается непосредственно Участником торгов на его рабочем месте.

3.2.1.2 В ходе аутентификации Биржа проверяет соответствие торгового идентификатора Идентификатору Участника торгов.

3.2.2 Аутентификация Участников торгов, принимающих участие в торгах посредством РМ Рейтер, производится в момент подачи заявки путем проверки Биржей соответствия торгового идентификатора уникальному символьному коду, закрепленному за Участниками торгов в системе Рейтер, соответствующему Идентификатору Участника торгов.

3.2.3 Аутентификация РМ ВПТС Участника торгов, производится перед началом торгов путем проверки Биржей соответствия торгового идентификатора Идентификатору Участника торгов.

3.2.4 Идентификация клиента Участника торгов, подключающегося к подсистеме обработки поручений посредством РМК с использованием ИСД, проводится в соответствии со следующей процедурой:

3.2.4.1 Клиент при подключении к подсистеме обработки поручений вводит ИСД, переданный ему Участником торгов, и пароль. Пароль устанавливается непосредственно клиентом на РМК;

3.2.4.2 В ходе идентификации клиента Биржа проверяет соответствие ИСД Идентификатору Участника торгов.

3.2.5 Клиент Участника торгов, прошедший идентификацию в порядке, предусмотренном в настоящей статье, вправе подавать Участнику торгов с использованием РМК поручения на совершение сделок на торгах Биржи в интересах данного клиента.

3.3 Порядок заключения сделок на торгах

3.3.1 Заключение сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами на торгах осуществляется путем подачи Участниками торгов заявок (в том числе заявок из алгоритмических пакетов заявок) в ТС посредством электронных сообщений, подписанных АСП Участ-

ника торгов, с использованием рабочих мест Участников торгов (за исключением РМ Рейтер). Заявка (в том числе заявка из алгоритмического пакета заявок) признается электронным документом, равнозначным документу, подписанному собственноручной подписью Участника торгов.

Заключение сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами на организованных торгах осуществляется путем обмена электронными документами посредством электронной связи, позволяющей установить, что указанные в настоящем пункте документы исходят от Участника торгов.

Местом заключения сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами на организованных торгах Биржи является город Москва Российской Федерации.

3.3.2 До начала торгов по каждому инструменту Биржа осуществляет контроль наличия, а в случае необходимости - ввод следующих параметров в ТС: время начала и окончания торгов, размер лота.

3.3.3 До начала торгов и в ходе торгов Биржа осуществляет взаимодействие с Банком России, выполняя следующие функции:

- получение и выполнение письменных предписаний (распоряжений) Банка России, касающихся проведения торгов. Письменные предписания (распоряжения) передаются по факсу с дублированием по телефону и последующей передачей Бирже оригинала соответствующего письменного распоряжения, за исключением случая, предусмотренного п. 3.4.1;
- информирование Клирингового центра о полученных распоряжениях Банка России по телефону с последующим письменным уведомлением.

3.3.4 С момента начала торгов и после аутентификации Участники торгов имеют право подавать в ТС заявки на заключение сделок, а также снимать и изменять ранее поданные ими и зарегистрированные в ТС заявки, неисполненные полностью или частично, подавать в ПТК ТЦ сообщения, являющиеся алгоритмическими пакетами заявок, а также сообщения на снятие алгоритмического пакета заявок (в случае, если в алгоритмическом пакете заявок находятся заявки еще не поданные в ТС).

При регистрации и снятии заявок/алгоритмического пакета заявок в ПТК ТЦ фиксируется время совершения соответствующего действия.

Участник торгов, подавший заявку (в том числе заявку из алгоритмического пакета заявок) на заключение сделки в соответствии с Правилами торгов, действующими на день подачи такой заявки (в том числе заявки из алгоритмического пакета заявок), приобретает все права и обязанности, предусмотренные Правилами торгов, действующими на день подачи такой заявки (в том числе заявки из алгоритмического пакета заявок).

3.3.5 Участник торгов, получивший поручение клиента, вправе подать в ТС заявку на заключение сделки. Участник торгов формирует заявку на основании поручения и подписывает ее АСП Участника торгов.

Перед подачей в ТС поручение проходит проверку на соответствие ограничениям, установленным для конкретного ИСД и/или группы ИСД Участником торгов, от имени которого может быть подана заявка на основании такого поручения. Участник торгов средствами ТС сообщает Бирже о составе и параметрах следующих ограничений:

- возможное отклонение цены в поручении от цены последней сделки по соответствующему инструменту, в процентах;
- максимальный объем поручения на подачу Участником торгов лимитированной заявки, в единицах валюты лота;

- максимальный объем поручения на подачу Участником торгов лимитированной заявки, в сопряженной валюте в рублях (объем поручения в сопряженной валюте, отличной от рублей, пересчитывается в рубли по курсу Банка России на дату подачи поручения);
- максимальный объем поручения на подачу Участником торгов рыночной заявки, в единицах валюты лота;
- максимальный суммарный объем поручений, подаваемых с использованием данного ИСД за торговый день, в сопряженной валюте в рублях (объем поручения в сопряженной валюте, отличной от рублей, пересчитывается в рубли по курсу Банка России на дату подачи поручения);
- список режимов торгов, на заключение сделок в которых разрешена либо запрещена подача поручений с использованием данного ИСД либо любого из ИСД, входящего в данную группу;
- список инструментов, поручения на заключение сделок с которыми могут быть поданы либо не могут быть поданы с использованием данного ИСД либо любого из ИСД, входящего в данную группу;
- максимальная нетто-позиция на покупку и на продажу, в рублях (объем поручения в сопряженной валюте, отличной от рублей, пересчитывается в рубли по курсу Банка России на дату подачи поручения);
- максимальная брутто-позиция на покупку и на продажу, в рублях (объем поручения в сопряженной валюте, отличной от рублей, пересчитывается в рубли по курсу Банка России на дату подачи поручения);
- максимальная нетто-позиция по инструменту на покупку и на продажу, в единицах валюты лота;
- максимальная брутто-позиция по инструменту на покупку и на продажу, в единицах валюты лота.

В случае если поручение успешно проходит проверку на соответствие требованиям настоящего пункта Правил торгов, а также проверку на соответствие ограничениям, установленным Участником торгов, Участник торгов, получивший поручение клиента, вправе подать в ТС заявку на заключение сделки. Участник торгов формирует заявку на основании поручения и подписывает ее АСП Участника торгов.

Заявка должна соответствовать условиям, предусмотренным настоящими Правилами торгов, а также должна содержать ИСД клиента, подавшего поручение и краткий код данного клиента.

Заявки, подаваемые в соответствии с настоящим пунктом, проходят все необходимые проверки, предусмотренные Правилами торгов и Правилами клиринга, а также дополнительную проверку на соответствие ИСД, указанного в заявке, торговому идентификатору и Идентификатору Участника торгов, указанному в заявлении о выдаче данного ИСД.

Регистрация, снятие, исполнение заявок, поданных в соответствии с настоящим пунктом, осуществляется в порядке, предусмотренном Правилами торгов.

3.3.6 Участник торгов, получивший поручение клиента на подачу алгоритмического пакета заявок, вправе подать в ПТК ТЦ алгоритмический пакет заявок. Участник торгов формирует алгоритмический пакет заявок на основании поручения на подачу алгоритмического пакета заявок и подписывает его АСП Участника торгов.

В ПТК ТЦ заявки из алгоритмического пакета заявок, сформированного на основании поручения на подачу алгоритмического пакета заявок, проходят проверку на соответствие ограничениям, установленным для конкретного ИСД и/или группы ИСД Участником торгов, от

имени которого могут быть поданы заявки на основании такого пакета заявок. Участник торгов средствами ТС сообщает Бирже о составе и параметрах следующих ограничений:

- возможное отклонение цены в заявках из алгоритмического пакета заявок от цены последней сделки по соответствующему инструменту, в процентах;
- максимальный объем лимитированной заявки поданной Участником торгов из алгоритмического пакета заявок, в единицах валюты лота;
- максимальный объем поданной Участником торгов лимитированной заявки из алгоритмического пакета заявок, в сопряженной валюте в рублях (объем такой заявки в сопряженной валюте, отличной от рублей, пересчитывается в рубли по курсу Банка России на дату подачи такой заявки);
- максимальный объем поданной Участником торгов рыночной заявки на основании поручения из алгоритмического пакета заявок, в единицах валюты лота;
- максимальный суммарный объем подаваемых с использованием данного ИСД заявок из алгоритмического пакета заявок за торговый день, в сопряженной валюте в рублях (объем таких заявок в сопряженной валюте, отличной от рублей, пересчитывается в рубли по курсу Банка России на дату подачи таких заявок);
- список режимов торгов, на заключение сделок в которых разрешена либо запрещена подача заявок из алгоритмического пакета заявок с использованием данного ИСД либо любого из ИСД, входящего в данную группу;
- список инструментов, заявки из алгоритмического пакета заявок на заключение сделок с которыми могут быть поданы либо не могут быть поданы с использованием данного ИСД либо любого из ИСД, входящего в данную группу;
- максимальная нетто-позиция на покупку и на продажу, в рублях (объем заявок из алгоритмического пакета заявок в сопряженной валюте, отличной от рублей, пересчитывается в рубли по курсу Банка России на дату подачи таких заявок);
- максимальная брутто-позиция на покупку и на продажу, в рублях (объем из алгоритмического пакета заявок в сопряженной валюте, отличной от рублей, пересчитывается в рубли по курсу Банка России на дату подачи таких заявок);
- максимальная нетто-позиция по инструменту на покупку и на продажу, в единицах валюты лота;
- максимальная брутто-позиция по инструменту на покупку и на продажу, в единицах валюты лота.

В случае если заявка из алгоритмического пакета заявок, сформированного на основании поручения на подачу алгоритмического пакета заявок, успешно проходит проверку на соответствие требованиям настоящего пункта Правил торгов, а также проверку на соответствие ограничениям, установленным Участником торгов, такая заявка считается зарегистрированной в ТС.

Заявки из алгоритмического пакета заявок, сформированного на основании поручения на подачу алгоритмического пакета заявок, подаваемые в соответствии с настоящим пунктом, проходят все необходимые проверки, предусмотренные Правилами торгов и Правилами клиринга, а также дополнительную проверку на соответствие ИСД, указанного в алгоритмическом пакете заявок, торговому идентификатору и Идентификатору Участника торгов, указанному в заявлении о выдаче данного ИСД.

Регистрация, снятие, исполнение заявок из алгоритмического пакета заявок, сформированного на основании поручения на подачу алгоритмического пакета заявок, поданных в соответствии с настоящим пунктом, осуществляется в порядке, предусмотренном Правилами торгов.

3.3.7 Всякий раз, когда Участник торгов подает в ТС заявку на заключение сделки, заявка посредством ПТК ТЦ становится доступной Клиринговому центру. Клиринговый центр осуществляет в ходе торгов проверку возможности регистрации в ТС заявки в порядке, определенном Правилами клиринга.

3.3.8 Информация о результатах проверки Клиринговым центром возможности регистрации в ТС заявки в ходе торгов посредством ПТК ТЦ становится доступной Бирже.

Если результат проверки Клиринговым центром возможности регистрации в ТС заявки отрицательный, то Биржа не регистрирует в ТС такую заявку. Порядок проведения Клиринговым центром проверки возможности регистрации заявок определяется в Правилах клиринга.

Если результат проверки возможности регистрации в ТС заявки положительный, то Биржа регистрирует в ТС такую заявку.

3.3.9 Биржа имеет право отказать в регистрации заявки в ТС в соответствии с пунктами 3.3.30, 3.3.31, 3.3.42, 3.3.43 и 3.3.50, а также по следующим причинам:

- неверный формат заявки;
- недопустимые реквизиты заявки;
- недопустимые реквизиты заявки маркет-мейкера;
- недопустимый краткий код клиента;
- недопустимая комбинация реквизитов заявки в конкретных режимах/периодах;
- отказ в регистрации допустимой встречной заявки с недопустимыми условиями заявки;
- ошибки, связанные с полномочиями Участника торгов/торгового идентификатора Участника торгов;
- превышен максимальный объем заявки;
- получен отчет от Клирингового центра о невозможности регистрации заявки;
- торги по данному инструменту не проводятся;
- недопустимый псевдоним торгового идентификатора/ИСД.

3.3.10 Заявки Участников торгов регистрируются в ТС путем внесения записи в реестр заявок, формируемый в соответствии с п. 4.1 настоящих Правил торгов.

3.3.11 Каждая заявка, зарегистрированная в ТС, проверяется Биржей посредством ТС на наличие в очереди допустимых встречных заявок. По результатам проверки определяются две допустимые встречные заявки, которыми признаются зарегистрированная заявка и допустимая встречная к ней заявка.

3.3.12 Сделка на торгах считается заключенной в момент определения в ТС двух допустимых встречных заявок путем внесения Биржей записи о заключении сделки в реестр договоров (далее – реестр сделок), за исключением случаев, предусмотренных настоящими Правилами торгов.

Цена каждой из сделок (курс сделки) равна цене, указанной в допустимой встречной заявке, которая стоит первой в очереди заявок. Объем каждой из сделок равен минимальному объему из указанных в двух допустимых встречных заявках.

3.3.13 В момент определения среди стоящих в очереди заявок двух допустимых встречных заявок либо при наличии двух зарегистрированных в ТС допустимых встречных заявок на заключение адресной сделки Биржа вносит в реестр сделок записи о заключении двух сделок между каждым из Участников торгов и Клиринговым центром. Информация о каждой из двух зарегистрированных сделках посредством ПТК ТЦ становится доступной Клиринговому центру.

После заключения каждых двух безадресных сделок текущая цена последних двух сделок и текущее значение средневзвешенного курса автоматически обновляется. Информация о новом значении цены последних двух сделок и новом значении средневзвешенного курса посредством ПТК ТЦ становится доступной Клиринговому центру.

Реестр сделок формируется в соответствии с п. 4.2 настоящих Правил торгов. При внесении в реестр сделок записей о каждых двух заключенных сделках объем каждой из заявок, являющихся допустимыми встречными заявками, уменьшается в ТС на объем заключенной сделки.

Указанная последовательность осуществляемых в ТС действий повторяется до тех пор, пока либо вновь зарегистрированная заявка, являющаяся допустимой встречной заявкой, не будет исполнена полностью, либо в очереди заявок не останется ни одной допустимой встречной заявки.

Две зарегистрированные в ТС допустимые встречные заявки на заключение адресной сделки (за исключением заключаемой в системном режиме торгов сделки фикс и средневзвешенной сделки без указания конечного контрагента) исполняются немедленно и полностью по цене, указанной в заявках.

При отсутствии в очереди допустимых встречных заявок вновь зарегистрированная заявка целиком ставится в очередь или удаляется из ТС в зависимости от вида и типа заявки.

3.3.14 Если вновь зарегистрированная заявка, являющаяся допустимой встречной заявкой, после заключения сделок на основании всех находящихся в очереди допустимых встречных заявок в соответствии с процедурой, описанной в п. 3.3.13 настоящих Правил торгов, исполнена частично, то ее остаток остается в очереди или удаляется из очереди. Остаток исполненной частично заявки удаляется из очереди заявок в следующих случаях:

- исполненная частично заявка имеет тип «снять остаток»;
- исполненная частично заявка является рыночной или лимитированной заявкой типа «поставить в очередь» и имеет цену не большую, чем цена покупки (не меньшую, чем цена продажи), указанная во встречной заявке, стоящей первой в очереди. При этом заключение сделки на основании исполненной частично заявки и встречной заявки, стоящей первой в очереди, приведет к заключению недопустимых кросс-сделок.

Информация о наличии или отсутствии в очереди неисполненных заявок посредством ПТК ТЦ становится доступной Клиринговому центру.

При обработке заявки типа «полностью или отклонить» описанная в п. 3.3.13 настоящих Правил торгов процедура заключения сделок при наличии в очереди допустимых встречных заявок повторяется до полного исполнения указанной заявки.

3.3.15 Для рыночных заявок типов «полностью или отклонить» и «снять остаток» осуществляется контроль величины отклонения цен допустимых встречных заявок от лучшей цены допустимой встречной заявки, стоящей в очереди в момент подачи таких рыночных заявок.

Рыночная заявка типа «полностью или отклонить» регистрируется и исполняется в ТС в случае, если величина отклонения наихудшей цены допустимой встречной заявки, необходимой для ее полного исполнения, от лучшей цены допустимой встречной заявки не превышает установленного значения. Если величина отклонения наихудшей цены допустимой встречной заявки, необходимой для полного исполнения рыночной заявки типа «полностью или отклонить», от лучшей цены допустимой встречной заявки превышает установленное значение, то такая рыночная заявка отклоняется.

Рыночная заявка типа «снять остаток» регистрируется и исполняется в ТС до тех пор, пока величина отклонения цены допустимой встречной заявки от лучшей цены допустимой встречной заявки не превышает установленного значения. Если величина отклонения цены

допустимой встречной заявки от лучшей цены допустимой встречной заявки превышает установленное значение, то исполнение такой рыночной заявки прекращается, а неисполненный остаток снимается.

Величина максимального отклонения, период времени торгов, в течение которого осуществляется контроль величины отклонения цен допустимых встречных заявок от лучшей цены допустимой встречной заявки, а также список инструментов и режимов торгов, для которых осуществляется такой контроль, устанавливается внутренними документами Биржи.

3.3.16 Клиринговый центр в целях урегулирования случаев неисполнения или ненадлежащего исполнения обязательств по сделкам с иностранной валютой/драгоценными металлами и/или в случаях, когда это необходимо в целях исполнения Клиринговым центром своих обязательств на других рынках, на которых Клиринговый центр осуществляет функции клиринговой организации и/или центрального контрагента, либо в иных случаях, установленных Правилами торгов или Правилами клиринга, вправе в порядке, установленном Правилами клиринга, заключать сделки как с подачей заявок, так и без подачи заявок.

3.3.17 В целях исполнения обязательств, возникающих из поставочных срочных контрактов, базисным активом которых является иностранная валюта/драгоценный металл, предусматривающих исполнение обязательств по поставке путем заключения сделок с соответствующей иностранной валютой/драгоценным металлом, на валютном рынке и рынке драгоценных металлов Биржи заключаются сделки спот с инструментом, указанным в соответствующей спецификации поставочного срочного контракта.

Сделки спот, предусмотренные в настоящем пункте, заключаются без подачи заявок путем заключения между Клиринговым центром и Участником торгов, являющимся стороной соответствующего поставочного срочного контракта (или Участником торгов, имеющим право подавать заявки с указанием Участника клиринга, являющегося стороной соответствующего поставочного срочного контракта), сделок спот в порядке и на условиях, определенных в правилах клиринга Клирингового центра, регламентирующих порядок осуществления клиринга на срочном рынке Биржи, и спецификации соответствующего инструмента.

Для заключения сделок спот, предусмотренных настоящим пунктом, Клиринговый центр направляет Бирже уведомление о необходимости заключения сделок спот в целях исполнения обязательств по поставочным срочным контрактам, содержащее информацию и условия заключаемых сделок, предусмотренные правилами клиринга Клирингового центра, регламентирующими порядок осуществления клиринга на срочном рынке Биржи.

Сделки спот, предусмотренные в настоящем пункте, считаются заключенными в момент получения Биржей от Клирингового центра уведомления о необходимости заключения сделок спот путем внесения записи о заключении сделок в реестр сделок.

3.3.18 Процедура снятия заявки происходит в следующем порядке: при полностью исполненной заявке Участник торгов информируется о невозможности ее снятия; если же неисполненная полностью или частично заявка находится в очереди, то такая заявка снимается Участником торгов и удаляется из очереди.

3.3.19 Процедура снятия алгоритмического пакета заявок происходит в следующем порядке: в случае, если все заявки из алгоритмического пакета заявок были поданы в ТС Участник торгов информируется о невозможности снятия алгоритмического пакета заявок; если же в алгоритмическом пакете заявок находится хотя бы одна неподанная в ТС заявка, то такой алгоритмический пакет заявок снимается Участником торгов. Информация о снятии заявки/алгоритмического пакета заявок посредством ПТК ТЦ становится доступной Клиринговому центру. Процедура изменения заявки происходит в следующем порядке: при полностью исполненной заявке Участник торгов информируется о невозможности ее изменения; если же неисполненная полностью или частично заявка находится в очереди, то для ее изменения та-

кая заявка снимается Участником торгов и удаляется из очереди, после чего Участником торгов вновь подается в ТС заявка с измененными условиями (цена и объем) в соответствии с порядком, предусмотренном п.п. 3.3.22 и 3.3.23 настоящих Правил торгов, обработка заявок осуществляется в соответствии с п.п. 3.3.7– 3.3.11 настоящих Правил торгов.

Процедура изменения алгоритмического пакета заявок происходит в следующем порядке: в случае, если все заявки из алгоритмического пакета заявок были поданы в ТС, Участник торгов информируется о невозможности его изменения; если же в алгоритмическом пакете заявок находится хотя бы одна неподанная в ТС заявка, то для его изменения такой алгоритмический пакет заявок снимается Участником торгов, после чего Участником торгов вновь подается в ПТК ТЦ алгоритмический пакет заявок с измененными условиями в соответствии с порядком, предусмотренном п.п. 3.3.50 настоящих Правил торгов, обработка поручений на подачу алгоритмических пакетов заявок осуществляется в соответствии с п.п. 3.3.6 - 3.3.11 настоящих Правил торгов.

3.3.20 В случае, когда Участник торгов является Участником торгов, совпадающим в одном лице с Участником клиринга, Бирже в ходе торгов посредством ПТК ТЦ доступна следующая сформированная Клиринговым центром информация в отношении такого Участника торгов:

- о размере обеспечения в каждой валюте/каждом драгоценном металле;
- о размере единого лимита по расчетному коду;
- о минимальном допустимом значении оценки в российских рублях обеспечения, учитываемого при расчете единого лимита по расчетному коду (в случае, если такое значение установлено);
- о значении нетто-обязательства и/или нетто-требования в каждой валюте/каждом драгоценном металле и с каждой датой исполнения;
- об обязательствах по уплате вариационной маржи;
- о сумме обеспечения в каждой валюте/каждом драгоценном металле, недостающего для исполнения нетто-обязательства в соответствующей валюте/соответствующем драгоценном металле с наступившей датой исполнения;
- о поданных поручениях на управление риском;
- о наличии/отсутствии маржинального требования, о сумме маржинального требования в российских рублях (в случае наличия);
- о наличии/отсутствии задолженности перед Клиринговым центром, о сумме задолженности (в случае наличия);
- иная информация, предусмотренная Правилами клиринга.

Указанная выше информация доступна Участнику торгов, совпадающему в одном лице с Участником клиринга, посредством рабочего места Участника торгов. В случае необходимости указанная информация может быть предоставлена такому Участнику торгов уполномоченным представителем Биржи.

3.3.21 В случае, когда Участник торгов является Участником торгов, не совпадающим в одном лице с Участником клиринга, Бирже в ходе торгов посредством ПТК ТЦ доступна следующая сформированная Клиринговым центром информация в отношении Участника клиринга, являющегося стороной по сделкам, заключаемым таким Участником торгов, в части, относящейся к указанному Участнику торгов:

- о размере обеспечения в каждой валюте / каждом драгоценном металле;
- о размере единого лимита по расчетному коду;

- о минимальном допустимом значении оценки в российских рублях обеспечения, учитываемого при расчете единого лимита по расчетному коду (в случае, если такое значение установлено);
- о значении нетто-обязательства и/или нетто-требования в каждой валюте / каждом драгоценном металле и с каждой датой исполнения;
- об обязательствах по уплате вариационной маржи;
- о размере обеспечения в каждой валюте / каждом драгоценном металле, недостающего для исполнения нетто-обязательства в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле с наступившей датой исполнения;
- иная информация, предусмотренная Правилами клиринга.

Указанная выше информация доступна Участнику торгов, не совпадающему в одном лице с Участником клиринга, посредством рабочего места Участника торгов. В случае необходимости указанная информация может быть предоставлена такому Участнику торгов уполномоченным представителем Биржи.

3.3.22 Срок действия заявки, зарегистрированной в ТС, ограничивается временем торгов по данному инструменту в соответствующем режиме.

Срок действия алгоритмического пакета заявок, зарегистрированного в ПТК ТЦ, ограничивается периодом времени, в течение которого заявки из алгоритмического пакета заявок должны подаваться в ТС, в рамках времени торгов по инструменту в соответствующем режиме.

3.3.23 Подача Участником торгов заявки на заключение сделки спот (в т.ч. сделки фикс и средневзвешенной сделки)/ поставочного фьючерса осуществляется в ТС посредством электронного сообщения, подписанного АСП Участника торгов и содержащего, в том числе, следующие данные (условия заявки):

- краткий код клиента (при подаче Участником торгов заявки на заключение сделки в интересах клиента);
- ТКС (при подаче заявки Участником торгов, не совпадающим в одном лице с Участником клиринга (в т.ч. заявки на заключение сделки, стороной по которой является клиринговый брокер), указывается торгово-клиринговый счет, соответствующий торгово-клиринговому счету Участника клиринга, являющегося стороной по данной сделке (в т.ч. клирингового брокера));
- идентификатор Участника клиринга;
- наименование сделки спот (в т.ч. сделки фикс, средневзвешенной сделки)/ поставочного фьючерса;
- направленность заявки: на продажу или на покупку;
- количество лотов (за исключением заявки из алгоритмического пакета заявок);
- дату исполнения обязательств (в соответствии со спецификацией);
- вид заявки из возможных стандартных видов;
- тип заявки из возможных стандартных типов;
- в случае лимитированной заявки – предельную цену продажи или покупки, указываемую в сопряженной валюте с точностью, установленной в спецификации соответствующего инструмента;
- в случае заявки со средневзвешенной ценой – максимальную средневзвешенную цену покупки (минимальную средневзвешенную цену продажи), указываемую в сопряженной валюте с точностью, установленной в спецификации соответствующего инструмента (только по сделкам спот);

- в случае заявки на заключение сделки фикс указывается, что в качестве цены продажи/покупки будет использован курс фиксинга Московской Биржи, рассчитанный на дату, определенную в соответствии с параметрами этой сделки фикс;
- в случае заявки на заключение средневзвешенной сделки указывается, что в качестве цены продажи/покупки будет использован средневзвешенный курс, рассчитанный на дату и время, определенные в соответствии с параметрами соответствующей средневзвешенной сделки.

3.3.24 Подача Участником торгов заявки на заключение сделки своп/своп контракта осуществляется в ТС посредством электронного сообщения, подписанного АСП Участника торгов и содержащего, в том числе, следующие данные (условия заявки):

- краткий код клиента (при подаче Участником торгов заявки на заключение сделки в интересах клиента);
- ТКС (при подаче заявки Участником торгов, не совпадающим в одном лице с Участником клиринга (в т.ч. заявки на заключение сделки, стороной по которой является клиринговый брокер), указывается торгово-клиринговый счет, соответствующий торгово-клиринговому счету Участника клиринга, являющегося стороной по данной сделке (в т.ч. клирингового брокера));
- идентификатор Участника клиринга;
- наименование сделки своп/своп контракта;
- направленность заявки: на продажу/покупку или на покупку/продажу;
- количество лотов (за исключением заявки из алгоритмического пакета заявок);
- даты исполнения обязательств по сделкам спот, входящим в сделку своп, даты исполнения обязательств по своп контракту (в соответствии со спецификацией);
- цену продажи/покупки или покупки/продажи.

3.3.25 В ходе торгов Участники торгов вправе заключать адресные сделки. Обработка всех заявок на заключение безадресных сделок типа «всем» и заявок на заключение адресных сделок (за исключением заключаемых в системном режиме торгов сделок фикс и средневзвешенных сделок без указания конечного контрагента), подаваемых в ТС, производится в соответствии с п.п. 3.3.7 – 3.3.10 настоящих Правил торгов. Заявки на заключение указанных в настоящем п. 3.3.25 адресных сделок не включаются в очередь заявок.

Каждая заявка на заключение адресной сделки, а также заявка на заключение безадресной сделки типа «всем», вновь регистрируемая в ТС после прохождения процедуры контроля ограничений в ходе торгов по соответствующей валюте проверяется Биржей посредством ТС на наличие допустимых встречных заявок.

3.3.26 Заключение адресных сделок осуществляется в порядке, предусмотренном п.п. 3.3.13 настоящих Правил торгов.

3.3.27 Подача Участником торгов заявки на заключение адресной сделки спот (в т.ч. заявки на заключение сделки фикс, средневзвешенной сделки с указанием конечного контрагента), поставочного фьючерса или безадресной сделки типа «всем» осуществляется в ТС посредством электронного сообщения, подписанного АСП Участника торгов и содержащего, в том числе, следующие данные (условия заявки):

- краткий код клиента (при подаче Участником торгов заявки на заключение сделки в интересах клиента);
- ТКС (при подаче заявки Участником торгов, не совпадающим в одном лице с Участником клиринга (в т.ч. заявки на заключение сделки, стороной по которой является

- клиринговый брокер), указывается торгово-клиринговый счет, соответствующий торгово-клиринговому счету Участника клиринга, являющегося стороной по данной сделке (в т.ч. клирингового брокера));
- идентификатор Участника клиринга;
 - наименование сделки спот (в т.ч. сделки фикс, средневзвешенной сделка)/поставочного фьючерса;
 - направленность заявки: на продажу или на покупку;
 - количество лотов;
 - дату исполнения обязательств (в соответствии со спецификацией);
 - идентификатор Участника торгов в качестве конечного контрагента по адресной сделке либо специальный код «всем» в заявке на заключение безадресной сделки типа «всем»;
 - цену продажи или покупки по сделке спот/поставочному фьючерсу.
 - в случае заявки на заключение сделки фикс указывается, что в качестве цены продажи/покупки будет использован курс фиксинга Московской Биржи, рассчитанный на дату и время, определенные в соответствии с параметрами этой сделки фикс;
 - в случае заявки на заключение средневзвешенной сделки указывается, что в качестве цены продажи/покупки будет использован средневзвешенный, рассчитанный на дату и время, определенные в соответствии с параметрами соответствующей средневзвешенной сделки.

3.3.28 Подача Участником торгов заявки на заключение адресной сделки своп или внесистемного своп контракта или безадресной сделки типа «всем» осуществляется в ТС посредством электронного сообщения, подписанного АСП Участника торгов и содержащего, в том числе, следующие данные (условия заявки):

- краткий код клиента (при подаче Участником торгов заявки на заключение сделки в интересах клиента);
- ТКС (при подаче заявки Участником торгов, не совпадающим в одном лице с Участником клиринга (в т.ч. заявки на заключение сделки, стороной по которой является клиринговый брокер), указывается торгово-клиринговый счет, соответствующий торгово-клиринговому счету Участника клиринга, являющегося стороной по данной сделке (в т.ч. клирингового брокера));
- идентификатор Участника клиринга;
- наименование сделки своп/своп контракта;
- направленность заявки: на продажу/покупку или на покупку/продажу;
- количество лотов;
- даты исполнения обязательств по сделкам спот, входящим в сделку своп, даты исполнения обязательств по своп контракту (в соответствии со спецификацией);
- цену продажи/покупки или покупки/продажи;
- идентификатор Участника торгов в качестве конечного контрагента по адресной сделке своп/своп контракту.

3.3.29 В адресной заявке, помимо указания краткого наименования или идентификатора Участника торгов, которому адресована заявка/Участника торгов, заявка которого может быть признана допустимой встречной, допускается указание псевдонима торгового идентификатора/ИСД, присвоенного соответствующему идентификатору в соответствии с порядком, установленным Правилами допуска.

3.3.30 В случае получения Биржей от Клирингового центра уведомления о проведении ранних расчетов по указанному в таком уведомлении ТКС с момента получения такого уведомления или с момента времени, указанного в уведомлении, прекращается до окончания торгов текущего дня проведения торгов возможность подачи заявок/алгоритмических пакетов заявок, направленных на заключение сделок по инструментам со сроком исполнения обязательств в день проведения торгов, с указанием данного ТКС. При этом срок действия всех неисполненных к указанному времени заявок/алгоритмических пакетов заявок с указанием такого ТКС прекращается и такие заявки/алгоритмические пакеты заявок снимаются уполномоченным представителем Биржи. Участникам торгов, которые вправе подавать заявки/алгоритмические пакеты заявок с указанием ТКС, указанного в уведомлении о проведении ранних расчетов, выдаются отчетные документы в соответствии с настоящими Правилами торгов.

Участник торгов вправе возобновить участие в торгах, подав соответствующий запрос в адрес Клирингового центра в соответствии с Правилами клиринга.

3.3.31 В случае получения Биржей от Клирингового центра уведомления о раннем завершении заключения сделок с Клиринговым центром по указанному в таком уведомлении ТКС с момента получения такого уведомления или с момента времени, указанного в уведомлении, прекращается до окончания торгов текущего дня проведения торгов возможность подачи заявок/алгоритмических пакетов заявок с указанием данного ТКС. При этом срок действия всех неисполненных к указанному времени заявок/алгоритмических пакетов заявок с указанием такого ТКС прекращается и такие заявки/алгоритмические пакеты заявок снимаются уполномоченным представителем Биржи и удаляются из очереди заявок/алгоритмических пакетов заявок. Участникам торгов, которые вправе подавать заявки/алгоритмические пакеты заявок с указанием ТКС, указанного в уведомлении о раннем завершении заключения сделок с Клиринговым центром, выдаются отчетные документы в соответствии с настоящими Правилами торгов.

Участник торгов вправе возобновить участие в торгах, подав соответствующий запрос в адрес Клирингового центра в соответствии с Правилами клиринга.

3.3.32 В случае получения Биржей от Клирингового центра уведомления об установлении в отношении определенного Расчетного кода Режимы урегулирования с момента получения такого уведомления прекращается возможность подачи заявок/алгоритмического пакета заявок с указанием данного ТКС. Возможность подачи заявок/алгоритмического пакета заявок по указанному ТКС возобновляется Биржей после получения от Клирингового центра уведомления о снятии Режимы урегулирования в отношении данного ТКС. Участникам торгов, которые вправе подавать заявки/алгоритмического пакета заявок с указанием такого ТКС, выдаются отчетные документы в соответствии с настоящими Правилами торгов.

Срок действия активной заявки/алгоритмического пакета заявок, поданной с указанием ТКС, в отношении которого Биржей получено от Клирингового центра уведомления об установлении для Расчетного кода, входящего в состав такого ТКС Режимы урегулирования в случаях, установленных Правилами клиринга, прекращается и такие заявки/алгоритмического пакета заявок снимаются уполномоченным представителем Биржи и удаляются из очереди заявок.

3.3.33 В случае приостановления допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга в ходе торгового дня, Клиринговый центр направляет Бирже уведомление о приостановлении клирингового обслуживания данного Участника клиринга с указанием времени, начиная с которого в рамках текущего торгового дня приостанавливается клиринговое обслуживание соответствующего Участника клиринга.

3.3.34 В случае получения Биржей от Клирингового центра уведомления о приостановлении клирингового обслуживания Участника клиринга, совпадающим в одном лице с Участником торгов, в ходе торгов торгового дня, и приостановления Биржей допуска к торгам такого

Участника торгов, активные заявки/алгоритмические пакеты заявок, поданные этим Участником торгов, снимаются Биржей с момента приостановления допуска Участника торгов к торгам; при этом не допускается подача новых заявок/алгоритмических пакетов заявок до момента возобновления допуска к торгам данного Участника торгов.

В случае получения Биржей от Клирингового центра уведомления о приостановлении в ходе торгов торгового дня клирингового обслуживания Участника клиринга (в том числе клирингового брокера), который является стороной по сделкам, заключаемым Участником торгов, не совпадающим в одном лице с Участником клиринга, активные заявки/алгоритмические пакеты заявок, поданные данным Участником торгов с указанием такого Участника клиринга в качестве стороны по сделке снимаются Биржей с указанного в уведомлении момента приостановления клирингового обслуживания Участника клиринга, при этом не допускается подача новых заявок/алгоритмических пакетов заявок до момента возобновления клирингового обслуживания данного Участника клиринга.

3.3.35 В случае получения Биржей от Клирингового центра уведомления о необходимости установления запрета на подачу Участником торгов, являющимся базовым Участником клиринга, или клиентом базового Участника клиринга – клирингового брокера, заявок/алгоритмических пакетов заявок на заключение сделок с указанием расчетного кода, за которым закреплен обособленный клиент, Биржа снимает соответствующие активные заявки/алгоритмические пакеты заявок и устанавливает запрет на подачу новых заявок и алгоритмических пакетов заявок до получения от Клирингового центра уведомления о снятии запрета.

3.3.36 Помимо информации, предоставляемой в соответствии с п.п. 3.3.20 и 3.3.21 настоящих Правил торгов, Биржа предоставляет Участнику торгов посредством рабочего места Участника торгов во время и по окончании торгов биржевую информацию и следующую информацию, относящуюся непосредственно к данному Участнику торгов:

- о поданных данным Участником торгов заявках/алгоритмических пакетах заявок, зарегистрированных в ПТК ТЦ и находящихся в очереди, заявках на заключение адресных сделок, а также заявках на заключение безадресных сделок типа «всем», зарегистрированных в ТС, а также о заявках/алгоритмических пакетах заявок, по которым заключены сделки;
- о заключенных данным Участником торгов сделках.

3.3.37 В ходе торгов Участники торгов вправе заключать сделки своп в режиме торгов «Аукцион с Банком России».

Заявки на заключение сделок своп в режиме торгов «Аукцион с Банком России» могут подаваться только Участниками торгов, являющимися кредитными организациями и подающими заявки от своего имени и за свой счет.

3.3.38 Каждый рабочий день, в который Банком России заключаются сделки своп в режиме торгов «Аукцион с Банком России», не позднее времени, установленного договором о взаимодействии, заключаемым между Банком России, Биржей и Клиринговым центром, Банк России направляет Бирже посредством электронных документов, сформированных в соответствии с Правилами ЭДО, следующую информацию:

- временной регламент проведения торгов в режиме торгов «Аукцион с Банком России»;
- даты исполнения сделок своп для режима торгов «Аукцион с Банком России»;
- минимальная процентная ставка по рублям в процентах годовых;
- процентные ставки по долларам США/евро в процентах годовых.

На основании значений процентных ставок, указанных Банком России, Биржа рассчитывает минимальные цены заявок на заключение сделок своп в соответствии с формулой расчета

величины своп разницы по сделкам валютный своп Банка России, размещенной на официальном сайте Банка России в сети интернет.

3.3.39 Биржа посредством ТС информирует Участников торгов о времени и параметрах заключения сделок своп в режиме торгов «Аукцион с Банком России», полученных от Банка России, и рассчитанных Биржей в соответствии с п. 3.3.38 настоящих Правил торгов.

3.3.40 В установленное Банком России время Участники торгов имеют право вводить в ТС и снимать неограниченное число заявок на заключение сделок типа «аукцион».

3.3.41 Подача Участником торгов заявки на заключение сделки типа «аукцион» осуществляется в ТС посредством электронного сообщения, подписанного АСП Участника торгов и содержащего, в том числе, следующие данные (условия заявки):

- ТКС (при подаче заявки Участником торгов, не совпадающим в одном лице с Участником клиринга (в т.ч. заявки на заключение сделки, стороной по которой является клиринговый брокер), указывается торгово-клиринговый счет, соответствующий торгово-клиринговому счету Участника клиринга, являющегося стороной по данной сделке (в т.ч. клирингового брокера));
- идентификатор Участника клиринга;
- наименование сделки своп;
- направление заявки;
- количество лотов;
- даты исполнения по первой и второй частям сделки своп (формируется в ТС, исходя из наименования сделки своп, выбранной Участником торгов);
- специальный код «аукцион»;
- цену сделки своп.

3.3.42 Обработка всех заявок на заключение сделок типа «аукцион», подаваемых в ТС, производится в соответствии с п.п. 3.3.7– 3.3.10 настоящих Правил торгов. При этом на основании значения минимальной процентной ставки по рублям осуществляется проверка каждой заявки Участника торгов на соответствие ставки, указанной в заявке, минимальной процентной ставке по рублям, указанной Банком России. Заявка с ценой сделки своп, соответствующей процентной ставке по рублям ниже минимальной процентной ставки по рублям, указанной Банком России, не принимается.

3.3.43 Прием и снятие заявок Участников торгов на заключение сделок своп в режиме торгов «Аукцион с Банком России» прекращается после окончания периода приема заявок на заключение сделок своп в режиме торгов «Аукцион с Банком России».

3.3.44 После окончания периода сбора заявок Участников торгов в режиме торгов «Аукцион с Банком России» Биржа в виде электронного документа, сформированного в соответствии с Правилами ЭДО, направляет Банку России сводный реестр заявок (Аукцион с Банком России).

3.3.45 Банк России в ответ на зарегистрированные в ТС заявки Участников торгов на заключение сделок своп в режиме торгов «Аукцион с Банком России» формирует перечень встречных заявок с указанием объемов сделок своп. Цены заявок на заключение сделок своп во встречных заявках, подаваемых Банком России, равны ценам заявок Участников торгов на заключение сделок своп в режиме торгов «Аукцион с Банком России», зарегистрированных в ТС.

3.3.46 Банк России информирует Биржу и Участников торгов посредством ТС о результатах проведения торгов в режиме «Аукцион с Банком России», в том числе о случаях признания торгов в режиме «Аукцион с Банком России» несостоявшимися.

3.3.47 Одновременно с регистрацией в ТС встречных заявок Банка России в ответ на удовлетворяемые заявки Участников торгов на заключение сделок своп в ходе аукциона с Банком России в ТС производится регистрация соответствующих сделок своп в порядке, предусмотренном п.п. 3.3.11 – 3.3.13 настоящих Правил торгов.

3.3.48 По окончании аукциона с Банком России в ТС автоматически снимаются все неудовлетворенные заявки Участников торгов на заключение сделок своп в режиме торгов «Аукцион с Банком России».

3.3.49 В ходе торгов Участники торгов вправе заключать сделки фикс и средневзвешенные сделки. Обработка всех заявок на заключение сделок фикс и средневзвешенных сделок производится в соответствии с п.п. 3.3.7 - 3.3.11 настоящих Правил торгов.

Заключение сделок фикс и средневзвешенных сделок осуществляется в порядке, предусмотренном п.п. 3.3.13 - 3.3.14 настоящих Правил торгов.

3.3.50 В ходе торгов Участники торгов вправе подавать алгоритмические пакеты заявок. Заявки, содержащиеся в алгоритмическом пакете заявок, автоматически подаются в ТС в течение заданного им периода времени. Заявки из алгоритмического пакета заявок могут подаваться только в системном режиме торгов (за исключением режима фиксинга и режима заключения средневзвешенных сделок).

Подача Участником торгов алгоритмического пакета заявок осуществляется посредством электронного сообщения, подписанного АСП Участника торгов и содержащего, в том числе, следующие параметры (условия алгоритмического пакета заявок):

- краткий код клиента (при подаче Участником торгов алгоритмического пакета заявок на заключение сделок спот/сделок своп в интересах клиента);
- ТКС (при подаче алгоритмического пакета заявок Участником торгов, не совпадающим в одном лице с Участником клиринга (в т.ч. алгоритмического пакета, содержащего заявки на заключение сделок спот/сделок своп/своп-контрактов, стороной по которым является клиринговый брокер), указывается торгово-клиринговый счет, соответствующий торгово-клиринговому счету Участника клиринга, являющегося стороной по данным сделкам (в т.ч. клирингового брокера));
- идентификатор Участника клиринга;
- наименование сделок в пакете заявок: сделки спот/сделки своп/своп-контракты;
- направленность заявок, подаваемых в рамках алгоритмического пакета заявок: на продажу или на покупку (для сделок спот), на продажу/покупку или на покупку/продажу (для сделок своп и своп-контрактов);
- суммарное количество лотов всех заявок, содежащихся в алгоритмическом пакете заявок;
- дату исполнения обязательств по сделкам спот (в соответствии со спецификацией), даты исполнения обязательств по сделкам своп, входящим в сделку своп (в соответствии со спецификацией), даты исполнения обязательств по своп контрактам (в соответствии со спецификацией);
- вид заявок в рамках алгоритмического пакета заявок: рыночные или лимитированные;
- для алгоритмического пакета, содержащего лимитированные заявки: предельную цену продажи или покупки (для сделок спот), цену продажи/покупки или покупки/продажи (для сделок своп и своп-контрактов);

- максимальное допустимое отклонение от текущей лучшей цены покупки/продажи встречной заявки;
- тип ограничения предельной цены (для заявок типа «снять остаток»):
 - процентный – максимальное допустимое отклонение цены заявки, подаваемой в ТС, в процентах от текущей лучшей цены покупки/продажи встречной заявки,
 - курсовой – максимальное допустимое отклонение цен заявки, подаваемой в ТС, в абсолютных значениях курса от текущей лучшей цены покупки/продажи встречной заявки;
- период времени, в течение которого заявки из алгоритмического пакета заявок должны подаваться в ТС; количество заявок, определяемое следующим образом:
 - путем указания Участником торгов конкретного числа заявок в пакете заявок или
 - путем деления указанного Участником торгов периода времени подачи заявок на указанный им временной интервал, с которым заявки, входящие в алгоритмический пакет заявок, должны подаваться в ТС;
- коэффициент случайного отклонения временного интервала в рамках установленного периода времени и объема заявок, входящих в алгоритмический пакет заявок.

Параметры максимально допустимых отклонений от текущей лучшей цены покупки/продажи встречной заявки и коэффициента случайного отклонения временного интервала в рамках периода времени и объема заявок устанавливаются внутренними документами Биржи.

Подавая в ПТК ТЦ подписанный АСП алгоритмический пакет заявок Участник торгов выражает не требующего дополнительного подтверждения согласие на подачу в ТС заявок, содержащихся в алгоритмическом пакете заявок, на установленных в нем в условиях в соответствии с настоящими Правилами торгов.

Каждая заявка, содержащаяся в алгоритмическом пакете заявок, содержит условия, предусмотренные настоящими Правилами торгов для заявок на заключение сделок по соответствующему инструменту с учетом вида и типа заявки.

Количество лотов в каждой заявке из алгоритмического пакета заявок в момент подачи пакета заявок не указывается, а определяется в момент подачи заявки в ТС в порядке, установленном внутренними документами Биржи.

При наступлении указанного в алгоритмическом пакете заявок периода времени, заявки, содержащиеся в пакете заявок, посредством ПТК ТЦ подаются в ТС с учетом установленных в условиях данного пакета заявок количества заявок, интервалов и иных параметров.

3.3.51 Заявки/алгоритмические пакеты заявок, поданные в ПТК ТЦ с нарушением настоящих Правил торгов, в том числе в результате технических сбоев и/или ошибок в работе средств проведения торгов (включая сбой в работе программного обеспечения), программно-технических средств, информационно-коммуникационных средств связи, с помощью которых обеспечивается проведение организованных торгов, не регистрируются в ПТК ТЦ.

Сделки с иностранной валютой/драгоценными металлами, заключенные с нарушением настоящих Правил торгов, в т.ч. в результате технических сбоев и/или ошибок в работе средств проведения торгов (включая сбой в работе программного обеспечения), программно-технических средств, информационно-коммуникационных средств связи, с помощью которых обеспечивается проведение организованных торгов, могут быть признаны незаключенными.

3.4 Порядок проведения дискретного аукциона

3.4.1 На основании предписания Банка России, получаемого Биржей в ТС посредством рабочего места Банка России, Биржа приостанавливает торги по инструменту(-ам), указанному

в списках параметров соответствующих сделок, и проводит торги путем сбора заявок в течение определенного Биржей по согласованию с Банком России периода времени с последующим заключением сделок по цене, определенной в порядке, установленном в Параметрах дискретного аукциона (далее – дискретный аукцион).

3.4.2 Проведение дискретного аукциона осуществляется в следующем порядке:

3.4.2.1 Биржа снимает все неисполненные/частично исполненные заявки Участников торгов, поданные до начала дискретного аукциона в течение основной сессии по инструменту, по которому будет проводиться дискретный аукцион. С момента начала проведения дискретного аукциона в ТС принимаются лимитированные заявки.

Заявки типа «скрыть количество» с ненулевым скрытым объемом не принимают участия в дискретном аукционе.

3.4.2.2 Дискретный аукцион проводится в течение времени, определенного в соответствии с Параметрами дискретного аукциона.

3.4.3 Подача Участником торгов заявки на заключение сделки в режиме дискретного аукциона осуществляется в соответствии с п. 3.3.23 настоящих Правил торгов с указанием специального кода «дискретный аукцион».

3.4.4 Цена, по которой заключаются сделки в результате дискретного аукциона (цена дискретного аукциона), определяется в порядке, установленном в соответствии с Параметрами дискретного аукциона.

3.4.5 Клиринг по сделкам, заключенным в ходе дискретного аукциона, осуществляется в соответствии с Правилами клиринга.

3.4.6 В течение торгового дня на Бирже может проводиться несколько дискретных аукционов. Время начала последнего дискретного аукциона не может быть позднее времени, установленного во Временном регламенте.

3.4.7 Участник торгов во время дискретного аукциона имеет доступ к информации обо всех заявках, поданных в ТС.

3.5 Особенности заключения сделок на торгах с использованием РМ Рейтер

3.5.1 Для Участников торгов, принимающих участие в торгах с использованием РМ Рейтер, подача/прием заявок на заключение сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами осуществляется путем обмена текстовыми сообщениями между Участниками торгов и Биржей в соответствии с требованиями настоящих Правил торгов, а также требованиями к оформлению сообщений при подаче заявок Участником торгов посредством системы передачи информации Рейтер. Данные требования и изменения к ним утверждаются решением Биржи.

Текстовые сообщения, полученные от Участника торгов с использованием РМ Рейтер, транслируются в ТС в виде заявок на заключение сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами.

Участники торгов несут полную ответственность за подаваемые с использованием РМ Рейтер заявки на заключение сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами.

3.5.2 Подтверждением подачи/приема заявки на заключение сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами с использованием РМ Рейтер является протокол, содержащий текст переговоров между Участником торгов и Биржей по системе Рейтер, который выражает не требующее дополнительного подтверждения согласие Участника торгов на заключение

сделки в соответствии с настоящими Правилами торгов, а также иными внутренними документами Биржи, в которых указаны требования к оформлению сообщений при подаче заявок Участником торгов посредством РМ Рейтер.

3.5.3 При заключении сделок на торгах с использованием РМ Рейтер заявка Участника торгов считается поданной в ТС с момента получения таким Участником торгов подтверждения от Биржи о приеме данной заявки.

3.5.4 После подачи заявки в ТС с использованием РМ Рейтер производится обработка такой заявки в соответствии с п.п. 3.3.7–3.3.10 настоящих Правил торгов.

3.5.5 Заключение сделок по заявкам, поданным в ТС с использованием РМ Рейтер, осуществляется в порядке, предусмотренном п.п. 3.3.11 – 3.3.15 настоящих Правил торгов.

3.6 Порядок действий при неработоспособности рабочего места Участника торгов/рабочего места клиента Участника торгов, подключенного к подсистеме обработки поручений ПТК ТЦ с использованием ИСД. Порядок действий при прекращении доступа к ТС или отсутствии технологической возможности осуществления доступа к ТС.

3.6.1 Под неработоспособностью рабочего места Участника торгов/рабочего места клиента Участника торгов, подключенного к ПТК ТЦ с использованием ИСД (далее по тексту настоящей статьи – рабочее место клиента Участника торгов), подразумеваются обстоятельства, возникшие при эксплуатации программно-технических средств на удаленном рабочем месте Участника торгов/рабочем месте клиента Участника торгов и повлекшие за собой невозможность дальнейшего участия в торгах Участника торгов/подачи поручений клиентом Участника торгов в течение какого-либо периода времени при отсутствии приостановки торгов.

3.6.2 В случае неработоспособности рабочего места Участника торгов/рабочего места клиента Участника торгов или в случае приостановки возможности подачи, изменения и снятия заявок/алгоритмического пакета заявок с использованием отдельного торгового идентификатора в соответствии с п. 2.2.4 настоящих Правил торгов Участник торгов может подать Бирже заявление на снятие его активных заявок (заявок, поданных на основании поручений клиента, подключенного к подсистеме обработки поручений с использованием ИСД, а также алгоритмических пакетов заявок, поданных на основании поручений клиента на подачу алгоритмического пакета заявок, подключенного к подсистеме обработки поручений с использованием ИСД) с использованием телефонной связи (далее – Заявление на снятие заявок/алгоритмического пакета заявок).

От имени Участника торгов Заявление на снятие заявок/алгоритмического пакета заявок может быть подано единоличным исполнительным органом, контролером Участника торгов или сотрудником, курирующим вопросы осуществления операций на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, при условии, что данные о вышеуказанных лицах содержатся в Анкете юридического лица, предоставляемой в соответствии с Правилами допуска.

Заявление Участника торгов на снятие его активных заявок/алгоритмического пакета заявок должно содержать следующие реквизиты:

- а) фамилию, имя, отчество (при наличии) и контактный номер телефона лица, обращающегося за снятием заявок;
- б) кодовое слово, совпадающее с кодовым словом для снятия заявок, указанном в Анкете юридического лица;
- в) торговый идентификатор Участника торгов и ИСД его клиента (в случае неработоспособности рабочего места клиента Участника торгов);
- г) Идентификатор Участника торгов или код, закрепленный за Участником торгов в системе Рейтер;

- д) номера активных заявок, поданных Участником торгов посредством ПТК ТЦ с использованием Идентификатора Участника торгов или кода, закрепленного за Участником торгов в системе Рейтер, которые нужно снять, или указание на то, что нужно снять активные заявки, поданные Участником торгов посредством ПТК ТЦ с использованием Идентификатора Участника торгов, или кода, закрепленного за Участником торгов в системе Рейтер, а также код клиента, по поручению или в интересах которого подана заявка (заявки), которую нужно снять, либо параметры подлежащих снятию заявок:
- все заявки;
 - по направлению заявок (покупка/продажа);
 - по режиму торгов;
 - по инструменту;
 - по торговому идентификатору;
 - по ТКС;
 - по коду клиента;
 - по курсу и условию поиска по курсу (меньше, больше, равно заданному значению);
- е) номера алгоритмических пакетов заявок (если же в алгоритмическом пакете заявок находится хотя бы одна неподанная в ТС заявка), поданных Участником торгов посредством ПТК ТЦ с использованием Идентификатора Участника торгов, которые нужно снять, или указание на то, что нужно снять алгоритмические пакеты заявок, поданные Участником торгов посредством ПТК ТЦ с использованием Идентификатора Участника торгов, а также код клиента, по поручению или в интересах которого подан алгоритмический пакет заявок (алгоритмические пакеты заявок), который нужно снять, либо параметры подлежащих снятию алгоритмических пакетов заявок:
- все алгоритмические пакеты заявок;
 - по направлению заявок (покупка/продажа);
 - по режиму торгов;
 - по инструменту;
 - по торговому идентификатору;
 - по ТКС;
 - по коду клиента;
 - по курсу и условию поиска по курсу (меньше, больше, равно заданному значению).

В случае если реквизиты Заявления на снятие заявок/алгоритмического пакета заявок корректны Биржа при наличии технической возможности снимает активные заявки/алгоритмические пакеты заявок в соответствии с Заявлением на снятие заявок/алгоритмического пакета заявок. В случае отсутствия такой возможности Биржа с использованием телефонной связи уведомляет лицо, подавшее Заявление о снятии заявок/алгоритмического пакета заявок, о невозможности снятия активных заявок/алгоритмического пакета заявок.

В случае если реквизиты Заявления на снятие заявок/алгоритмического пакета заявок некорректны такое Заявление на снятие заявок/алгоритмического пакета заявок отклоняется, о чем уполномоченный представитель Биржи информирует лицо, подавшее Заявление на снятие заявок/алгоритмического пакета заявок посредством телефонной связи. Биржа не несет ответственности за убытки, которые могут возникнуть у Участника торгов при исполнении Заявления на снятие заявок/алгоритмического пакета заявок или при неисполнении данного заявления в случае, если номера активных заявок/алгоритмического пакета заявок, указанных в

заявлении, не совпадают с номерами активных заявок/алгоритмического пакета заявок, поданных Участником торгов и находящихся в ПТК ТЦ, и/или в случаях, когда реквизиты Заявления на снятие заявок/алгоритмического пакета заявок некорректны. При рассмотрении споров Биржа и Участник торгов вправе использовать запись телефонных переговоров в качестве доказательства.

3.6.3 В случае неработоспособности рабочего места Участника торгов по причине сбоя в системе Рейтер заявки, принятые до возникновения неработоспособности рабочего места Участника торгов, не аннулируются. Исполнение Участником торгов своих обязательств по сделкам, заключенным на основании заявок, поданных им с использованием РМ Рейтер до возникновения неработоспособности рабочего места Участника торгов, осуществляется в соответствии с Правилами клиринга.

3.6.4 Участник торгов может подать постоянный запрос на проверку работоспособности рабочего места Участника торгов/рабочего места клиента Участника торгов, проверку наличия доступа к ПТК ТЦ с использованием логина Участника торгов и автоматическое удаление активных заявок (заявок, поданных на основании поручений клиента, подключенного к подсистеме обработки поручений с использованием ИСД), кроме заявок из алгоритмического пакета заявок, (далее – постоянный запрос) на случай неработоспособности рабочего места Участника торгов/рабочего места клиента Участника торгов (за исключением РМ Рейтер), на случай прекращения доступа к ПТК ТЦ или отсутствия технологической возможности осуществления доступа к ПТК ТЦ Участника торгов или на случай приостановки возможности подачи, изменения и снятия заявок с использованием отдельного торгового идентификатора/заявок с указанием отдельного ИСД.

После получения постоянного запроса Биржа в течение трех рабочих дней активирует для Участника торгов функционал проверки работоспособности и автоматического удаления активных заявок при условии соответствия программно-технических средств Участника торгов/программно-технических средств клиента, подключенного к подсистеме обработки поручений с использованием ИСД, требованиям, установленным Биржей и раскрываемым на сайте Биржи в сети Интернет.

После активации Биржей для Участника торгов данного функционала Биржа вправе автоматически удалять активные заявки из ТС в ходе торгов в случае невозможности подтверждения работоспособности рабочего места Участника торгов/рабочего места клиента Участника торгов и/или приостановки возможности подачи, изменения и снятия заявок с использованием отдельного торгового идентификатора/заявок с указанием отдельного ИСД. Проверка работоспособности рабочего места осуществляется в порядке, установленном Биржей и раскрываемом на сайте Биржи в сети интернет.

В случае если до момента автоматического удаления Биржей активных заявок такие заявки уже исполнены, они не могут быть удалены Биржей.

Не допускается автоматическое удаление Биржей активных заявок, поданных в режиме дискретного аукциона, после окончания сбора заявок в соответствии с Параметрами дискретного аукциона.

Участник торгов вправе подать запрос на отключение функционала проверки работоспособности и автоматического удаления активных заявок, который исполняется Биржей в течение трех рабочих дней.

3.6.5 В случае отсутствия возможности выполнения запроса/постоянного запроса Участника торгов уполномоченный представитель Биржи уведомляет о невозможности снятия заявок Участника торгов, направившего такой запрос/постоянный запрос, с использованием одного из средств связи.

3.6.6 Биржа не несет ответственности за убытки, которые могут возникнуть у Участника торгов/клиента, подключенного к подсистеме обработки поручений с использованием ИСД, при исполнении Биржей запроса/постоянного запроса Участника торгов о снятии активных заявок.

3.6.7 Если работоспособность рабочего места участника торгов/рабочего места клиента Участника торгов может быть восстановлена Участником торгов/клиентом Участника торгов, подключенного к подсистеме обработки поручений с использованием ИСД, самостоятельно, то Участник торгов может повторно авторизоваться в ПТК ТЦ/клиент Участника торгов может повторно подключиться к подсистеме обработки поручений.

3.6.8 В случае, если в ходе торгов у Участника торгов по техническим причинам прекратился доступ к ТС с использованием торгового идентификатора или отсутствует технологическая возможность осуществления доступа к ТС с использованием торгового идентификатора, Биржа вправе производить технологическое принудительное прекращение подключения такого логина в целях дальнейшего его переподключения и восстановления доступа к ТС. Для этого Участник торгов должен предоставить Бирже заявление о принудительном прекращении технического доступа Участника торгов в форме телефонного сообщения (далее – Заявление о принудительном прекращении технического доступа).

От имени Участника торгов Заявление о принудительном прекращении технического доступа может быть подано единоличным исполнительным органом, контролером Участника торгов или сотрудником, курирующим вопросы осуществления операций на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, при условии, что данные о вышеуказанных лицах содержатся в Анкете юридического лица, предоставляемой в соответствии с Правилами допуска.

Заявление Участника торгов о принудительном прекращении технического доступа должно содержать следующие реквизиты:

- а) фамилию, имя, отчество (при наличии) и контактный номер телефона лица, обращающегося за принудительным прекращением технического доступа;
- б) кодовое слово, совпадающее с кодовым словом для снятия заявок, указанном в Анкете юридического лица;
- в) торговый идентификатор Участника торгов, технический доступ которого следует принудительно прекратить.

В случае если реквизиты Заявления о принудительном прекращении технического доступа корректны, Биржа при наличии технической возможности принудительно прекращает технический доступ к ТС в соответствии с Заявлением о принудительном прекращении технического доступа, а также снимает все активные заявки Участника торгов при наличии постоянного запроса, указанного в п. 3.6.4. В случае отсутствия такой возможности Биржа с использованием телефонной связи уведомляет лицо, подавшее Заявление о принудительном прекращении технического доступа, о невозможности принудительного прекращения технического доступа к ТС.

В случае если реквизиты Заявления о принудительном прекращении технического доступа некорректны, такое Заявление о принудительном прекращении технического доступа отклоняется, о чем уполномоченный представитель Биржи информирует лицо, подавшее Заявление о принудительном прекращении технического доступа посредством телефонной связи.

Биржа не несет ответственности за убытки, которые могут возникнуть у Участника торгов при исполнении Заявления о принудительном прекращении технического доступа или при неисполнении данного заявления в случае, когда реквизиты Заявления о принудительном прекращении технического доступа некорректны.

При рассмотрении споров Биржа и Участник торгов вправе использовать запись телефонных переговоров в качестве доказательства.

3.7 Порядок приостановления, прекращения и возобновления торгов

3.7.1 Под приостановкой торгов в рамках настоящего п. 3.7 Правил торгов понимается приостановка торгов в ходе их проведения, а также отсрочка начала проведения торгов.

Настоящий пункт Правил торгов регулирует порядок приостановления, прекращения и возобновления торгов в случае возникновения обстоятельств, нарушающих или могущих нарушить нормальный порядок проведения торгов.

3.7.2 Биржа приостанавливает торги при возникновении технических сбоев в работе средств проведения торгов в период проведения торгов, влияющих или которые могут повлиять на ход проведения торгов в отношении большинства активных Участников торгов.

Биржа вправе приостановить торги также в иных случаях, в т.ч. в случаях технических сбоев в работе средств проведения торгов, не указанных в абзаце первом настоящего п. 3.7.2 (включая сбой в работе программного обеспечения), сбоев в работе систем связи, электроснабжения; обстоятельств непреодолимой силы; невозможности надлежащего функционирования Клирингового центра и/или иных организаций, деятельность которых влияет на возможность проведения торгов.

3.7.3 Приостановление торгов возможно:

- в связи с фактической невозможностью проведения торгов;
- по решению Биржи.

Торги могут быть приостановлены полностью или частично.

3.7.4 Сроки раскрытия информации о приостановлении торгов:

- в случае если торги были приостановлены в результате технического сбоя в работе средств проведения торгов, Биржа обязана раскрыть информацию об этом не позднее чем через 15 (пятнадцать) минут после обнаружения технического сбоя;
- при приведении в рабочее состояние средств проведения торгов и обнаружении технических сбоев в работе средств проведения торгов Биржа обязана раскрыть информацию об этом не менее чем за 15 (пятнадцать) минут до начала проведения торгов;
- в случае если торги были приостановлены по решению Биржи (за исключением случаев приостановки торгов в результате технического сбоя в работе средств проведения торгов), Биржа обязана раскрыть информацию об этом не позднее чем через 15 (пятнадцать) минут после принятия решения о приостановлении.

3.7.5 После прекращения обстоятельств, послуживших основанием для приостановления торгов, торги подлежат возобновлению по решению Биржи. В случае приостановления торгов, вызванного техническим сбоем в работе средств проведения торгов, Биржа раскрывает информацию о времени возобновления торгов и предоставляет Участникам торгов возможность снять активные заявки/алгоритмические пакеты заявок посредством средств проведения торгов не менее чем за 15 (пятнадцать) минут до возобновления торгов.

В случае невозможности снятия активных заявок/алгоритмических пакетов заявок посредством средств проведения торгов, Участник торгов может предоставить Бирже заявление на снятие активных заявок/алгоритмического пакета заявок с использованием телефонной или факсимильной связи. Биржа после получения заявления посредством телефонной или факсимильной связи снимает (при наличии такой возможности) активные заявки/алгоритмические пакеты заявок данного Участника торгов. При рассмотрении споров Биржа и Участник торгов вправе использовать запись телефонных переговоров в качестве доказательства факта направления Участником торгов указанного заявления на снятие активных заявок/алгорит-

мических пакетов заявок. Заявление Участника торгов о снятии его активных заявок/алгоритмических пакетов заявок должно содержать информацию аналогичную указанной в п. 3.6.2 настоящих Правил торгов.

3.7.6 В случае если обстоятельства, повлекшие приостановку торгов, не прекращаются до окончания основной торговой сессии данного торгового дня, Биржа не возобновляет торги в данный торговый день.

При условии устранения обстоятельств, повлекших приостановку торгов, к началу следующего торгового дня торги открываются в обычном режиме и отдельное решение о возобновлении торгов в этом случае Биржей не принимается.

3.7.7 Информация обо всех случаях приостановления, прекращения и возобновления торгов, предусмотренных настоящим п. 3.7 Правил торгов, раскрывается на сайте Биржи в сети интернет. Информация о возникновении технического сбоя также доводится до сведения Участников торгов (при наличии такой возможности) иным доступным способом.

3.7.8 Если в течение текущего торгового дня приостановленные торги были возобновлены менее чем за один час до окончания основной сессии, Биржа вправе продлить основную сессию после истечения времени, предусмотренного настоящими Правилами торгов для ее проведения. Информация о продлении основной сессии раскрывается на сайте Биржи в сети интернет.

4. ОФОРМЛЕНИЕ ЗАРЕГИСТРИРОВАННЫХ ЗАЯВОК И ЗАКЛЮЧЕННЫХ СДЕЛОК

4.1 В ходе торгов все зарегистрированные в ТС заявки, в том числе из алгоритмического пакета заявок, поданные Участниками торгов, отражаются в реестре заявок. Реестр заявок формируется Биржей в электронном виде.

Информация о заявках, не прошедших регистрацию в ТС в соответствии с пунктом 3.3.9 настоящих Правил торгов, сохраняется в ТС в реестре транзакций, не отображаясь при этом в реестре заявок.

Не позднее 10:00 текущего торгового дня, Биржа может формировать для Участника торгов выписку из реестра заявок за основную сессию предыдущего торгового дня.

По итогам основной сессии Участнику торгов по его требованию предоставляется выписка из реестра заявок.

Выписка из реестра заявок за основную сессию в виде электронного документа, сформированного в соответствии с Правилами ЭДО, утвержденными уполномоченным органом Биржи, и подписанного уполномоченным представителем Биржи, направляется Участнику торгов в соответствии с внутренними документами Биржи, регулирующими электронный документооборот между Участниками торгов и Биржей. Форма и структура электронного документа утверждается уполномоченным органом Биржи.

В выписке из реестра заявок в отношении заявок из алгоритмического пакета заявок содержится информация о соответствующем алгоритмическом пакете заявок.

Информация о поручениях, подаваемых в подсистему обработки поручений, сохраняется в ТС в реестре транзакций ИСД, не отображаясь при этом в реестре заявок.

Не позднее 10:00 текущего торгового дня, Биржа может формировать для Участника торгов выписку из реестра транзакций за основную сессию предыдущего торгового дня, а также выписку из реестра транзакций ИСД за основную сессию предыдущего торгового дня.

По итогам основной сессии Участнику торгов по его требованию предоставляется выписка из реестра транзакций и/или выписка из реестра транзакций ИСД.

Выписка из реестра транзакций, а также выписка из реестра транзакций ИСД в виде электронных документов, сформированных в соответствии с Правилами ЭДО и подписанных уполномоченным представителем Биржи, направляются Участнику торгов в соответствии с Правилами ЭДО. Форма и структура электронных документов утверждается Биржей.

В выписке из реестра транзакций, а также в выписке из реестра транзакций ИСД в отношении заявок из алгоритмического пакета заявок содержится информация о соответствующем алгоритмическом пакете заявок.

Биржа обеспечивает хранение поручений, поданных клиентами Участника торгов посредством подсистемы обработки поручений, в той форме, в которой они были приняты, в течение 5 лет с даты их подачи. По запросу Участника торгов Биржа передает Участнику торгов поданные клиентами поручения в той форме, в которой они были приняты.

4.2 В ходе торгов все зарегистрированные в соответствии с п.п. 3.3.13, 3.3.14 и 3.3.16 настоящих Правил торгов сделки отражаются в реестре сделок. Реестр сделок формируется Биржей в электронном виде.

4.3 По итогам торгов по каждому инструменту Биржа посредством ПТК ТЦ получает от Клирингового центра и вносит в реестр сделок информацию о комиссионном вознаграждении за организацию торгов в российских рублях и о комиссии Клирингового центра за клиринговое обслуживание.

4.4 В соответствии с Временным регламентом в день проведения торгов Биржа формирует для Участника торгов с учетом требований п.п. 4.2 и 4.3 настоящих Правил торгов выписку из реестра сделок, зарегистрированных в соответствии с п.п. 3.3.13, 3.3.14 и 3.3.16 настоящих Правил торгов. В соответствии с Временным регламентом на следующий торговый день Биржа формирует для Участника торгов с учетом требований п.п. 4.2 и 4.3 настоящих Правил торгов выписку из реестра сделок, зарегистрированных в соответствии с п.п. 3.3.13, 3.3.14 и 3.3.16 настоящих Правил торгов с момента составления предыдущей выписки из реестра сделок за основную сессию предыдущего торгового дня.

Выписка из реестра сделок в виде электронного документа, сформированного в соответствии с Правилами ЭДО и подписанного уполномоченным представителем Биржи, направляется Участнику торгов в соответствии с Правилами ЭДО. Форма и структура электронного документа утверждается Биржей.

В выписке из реестра сделок в отношении сделок, заключенных на основании заявок из алгоритмического пакета заявок содержится информация о соответствующем алгоритмическом пакете заявок.

Участник торгов может получать от Биржи выписку из реестра сделок в виде письменного документа на бумажном носителе, подписанного уполномоченным представителем Биржи. Выписка из реестра сделок на бумажном носителе предоставляется Биржей уполномоченному лицу Участника торгов.

4.5 Не позднее 10:00 текущего торгового дня, Биржа может формировать для Участника торгов с учетом требований п.п. 4.2 и 4.3 настоящих Правил торгов выписку из реестра сделок по сделкам своп и своп контрактам без указания сделок, входящих в данные сделки, а также по сделкам фикс, средневзвешенным сделкам (далее – выписка из реестра сделок (сделки аналитического учета)), зарегистрированным в соответствии с п.п. 3.3.13, 3.3.14 и 3.3.16 настоящих Правил торгов, за основную сессию предыдущего торгового дня.

По итогам основной сессии Участнику торгов по его требованию предоставляется выписка из реестра сделок (сделки аналитического учета).

4.6 Выписка из реестра сделок (сделки аналитического учета) в виде электронного документа, сформированного в соответствии с Правилами ЭДО, утвержденными уполномоченным органом Биржи, и подписанного уполномоченным представителем Биржи, направляется Участнику торгов в соответствии с внутренними документами Биржи, регулирующими электронный документооборот между Участниками торгов и Биржей. Форма и структура электронного документа утверждается уполномоченным органом Биржи.

4.7 В случае, когда в течение торгового дня происходили технические сбои, приведшие к невозможности предоставления Биржей выписок из реестра сделок в сроки, предусмотренные Временным регламентом, Биржа предоставляет Участникам торгов выписки из реестра сделок, формируемые в соответствии с п. п. 4.4 и 4.5 настоящих Правил торгов, не позднее 1 часа после восстановления возможности предоставления выписок из реестра сделок.

4.8 В случае продления торгов по одному или нескольким инструментам Биржа выдает Участникам торгов выписки из реестра сделок, формируемые в соответствии с п. п. 4.4 и 4.5 настоящих Правил торгов, при наличии такой возможности, но не ранее чем через 15 (пятнадцать) минут после окончания торгов по соответствующему инструменту.

4.9 Документы, предоставляемые Участникам торгов по итогам каждой основной сессии, являются отчетными документами.

5. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО СДЕЛКАМ С ИНОСТРАННОЙ ВАЛЮТОЙ/ДРАГОЦЕННЫМИ МЕТАЛЛАМИ

5.1 Общие принципы определения обязательств

5.1.1 Порядок исполнения обязательств Участниками клиринга, Клиринговым центром и Банком России по сделкам с иностранной валютой/драгоценными металлами, заключенным на организованных торгах, регламентируется Правилами клиринга. Временные рамки исполнения указанных обязательств определяются Правилами клиринга.

5.1.2 На основании выписки из реестра сделок, полученной от Биржи, Клиринговым центром в ходе клиринга определяются итоговые нетто-требования и/или итоговые нетто-обязательства Участников клиринга в каждой валюте/каждом драгоценном металле, а также обязательства по уплате/требования по получению вариационной маржи в соответствии с Правилами клиринга.

5.1.3 По итогам клиринга по всем заключенным сделкам Участники клиринга исполняют свои итоговые нетто-обязательства в валюте/ драгоценных металлах, а также обязательства по уплате вариационной маржи и обязательства по уплате вознаграждения в пользу Клирингового центра, а также обязательства Участников торгов по уплате вознаграждения в пользу Биржи в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

6. ПОРЯДОК МОНИТОРИНГА И КОНТРОЛЯ ЗА СДЕЛКАМИ С ИНОСТРАННОЙ ВАЛЮТОЙ/ДРАГОЦЕННЫМИ МЕТАЛЛАМИ

6.1 Участник торгов не вправе использовать инсайдерскую информацию при совершении сделок на торгах, а также совершать на торгах действия, относящиеся к манипулированию рынком.

6.2 Биржа устанавливает обязательные для Участников торгов правила предотвращения, выявления и пресечения случаев неправомерного использования инсайдерской информации и/или манипулирования рынком.

6.3 При осуществлении контроля (в случае необходимости получения дополнительной информации или необходимости проведения дополнительного анализа) Биржа вправе требовать от Участников торгов представления необходимых документов, объяснений и информации.

6.4 В случае предоставления Участником торгов неудовлетворительных объяснений или не получения от Участника торгов объяснений в установленный срок, а также при наличии оснований квалифицировать в соответствии с п. 6.1 настоящих Правил торгов действия Участника торгов как нарушение Правил торгов Биржа имеет право применить к Участнику торгов меры ответственности, установленные в соответствии с п.2.2.13.

6.5 Порядок мониторинга и контроля за сделками, заключаемыми на торгах и Участниками торгов, устанавливается Биржей.

7. ПОРЯДОК РАССМОТРЕНИЯ КОНФЛИКТНЫХ СИТУАЦИЙ

7.1 В связи с заключением сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами на организованных торгах возможно возникновение конфликтных ситуаций, связанных с регистрацией заявок/алгоритмических пакетов заявок Биржей в ПТК ТЦ, изменением информации в заявках/алгоритмических пакетах заявок после подачи их Участником торгов в ПТК ТЦ, а именно:

- оспаривание Участником торгов факта регистрации заявки/алгоритмического пакета заявок Биржей в ПТК ТЦ;
- заявление Участника торгов об изменении информации в поданной им заявке/алгоритмическом пакете заявок при регистрации Биржей заявки/алгоритмического пакета заявок в ПТК ТЦ;
- заявление Участника торгов о неисполнении поданной заявки (в том числе заявки из алгоритмического пакета заявок) при наступлении условий ее исполнения;
- заявление Участника торгов о снятии ранее поданных ими и зарегистрированных в ПТК ТЦ заявок/алгоритмических пакетов заявок, неисполненных полностью или частично;
- иные случаи возникновения конфликтных ситуаций, связанных с заключением сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами на организованных торгах, за исключением конфликтных ситуаций, связанных с использованием АСП Участника торгов, порядок разрешения которых определяется в п. 7.10 настоящих Правил торгов.

7.2 В случае возникновения конфликтной ситуации Участник торгов должен незамедлительно, но не позднее чем в течение трех рабочих дней или в иной более короткий срок после возникновения конфликтной ситуации направить уведомление о конфликтной ситуации Бирже.

7.3 Уведомление о конфликтной ситуации должно содержать информацию о существовании конфликтной ситуации и обстоятельствах, которые, по мнению Участника торгов - уведомителя, свидетельствуют о наличии конфликтной ситуации. В уведомлении должны быть указаны фамилия, имя и отчество, должность, контактные телефоны, факс, адрес электронной почты лица или лиц, уполномоченных вести переговоры по урегулированию конфликтной ситуации. Уведомление о наличии конфликтной ситуации составляется в письменной форме

и направляется с нарочным либо иным способом, обеспечивающим подтверждение вручения корреспонденции адресату.

7.4 Биржа обязана незамедлительно, однако не позднее чем в течение следующего рабочего дня, проверить наличие обстоятельств, свидетельствующих о возникновении конфликтной ситуации, и направить Участнику торгов информацию о результатах проверки и, в случае необходимости, о мерах, принятых для разрешения возникшей конфликтной ситуации.

7.5 Конфликтная ситуация признается разрешенной в рабочем порядке в случае, если Участник торгов удовлетворен информацией, полученной от Биржи. В ином случае для рассмотрения конфликтной ситуации формируется техническая комиссия.

7.6 Не позднее чем на следующий рабочий день после того, как принято решение о необходимости сформировать техническую комиссию, или не позднее, чем на шестой рабочий день после получения уведомления о конфликтной ситуации в случае, если конфликтная ситуация не была урегулирована в рабочем порядке, техническая комиссия должна быть сформирована.

7.7 Если Участник торгов и Биржа, являющиеся сторонами в конфликтной ситуации, не договорятся об ином, в состав технической комиссии входит равное количество, но не менее чем по одному уполномоченному представителю каждой из конфликтующих сторон. Полномочия представлять в технической комиссии соответствующую сторону должно подтверждаться доверенностью, выданной каждому представителю на срок работы технической комиссии.

7.8 Сформированная техническая комиссия при рассмотрении конфликтной ситуации устанавливает на технологическом уровне наличие или отсутствие фактических обстоятельств, свидетельствующих о факте и времени формирования и подачи заявки/алгоритмического пакета заявок Участником торгов в ПТК ТЦ, ее регистрации в ПТК ТЦ и отсутствии изменений условий заявки/алгоритмического пакета заявок после ее регистрации в ПТК ТЦ.

7.9 Все действия, предпринимаемые технической комиссией для выяснения фактических обстоятельств, а также выводы, сделанные комиссией, заносятся в Протокол работы технической комиссии. Протокол работы технической комиссии должен содержать следующие данные:

- состав комиссии с указанием сведений о квалификации каждого из членов комиссии;
- краткое изложение обстоятельств возникшей конфликтной ситуации;
- мероприятия, проводимые комиссией для установления причин и последствий возникшей конфликтной ситуации, с указанием даты времени и места их проведения;
- выводы, к которым пришла комиссия в результате проведенных мероприятий;
- подписи всех членов комиссии.

Протокол составляется в двух экземплярах на бумажном носителе, по одному экземпляру для Участника торгов и Биржи.

7.10 Конфликтная ситуация, которая может возникнуть в связи с использованием АСП Участника торгов, в случае невозможности ее разрешения в рабочем порядке подлежит разрешению путем проведения технической комиссией технической экспертизы в соответствии с изложенными ниже правилами:

7.10.1 Для проведения технической экспертизы необходимы:

- информация от уведомителя о конфликтной ситуации (Участника торгов или Клирингового центра) о параметрах заявки/алгоритмического пакета заявок, в отношении которой проводится техническая экспертиза:
 - дата и время формирования заявки/алгоритмического пакета заявок;
 - номер заявки/алгоритмического пакета заявок, зарегистрированной в ПТК ТЦ;
 - параметры заявки/алгоритмического пакета заявок, необходимые для рассмотрения уведомления о конфликтной ситуации;
- архив регистрации транзакций ТС на указанную дату (файл TransLog и начальные файлы данных ТС на указанную дату торгов);
- рабочее место, позволяющее просматривать и распечатывать информацию из файла TransLog в удобном для восприятия членами технической комиссии виде;
- отчетные документы, подтверждающие направление в установленном порядке уведомления о присвоении торгового идентификатора уведомителю о конфликтной ситуации (Участнику торгов);
- в случае если заявка подавалась посредством РМ Рейтер, протокол, переговоров между Участником торгов и Биржей по системе Рейтер.

7.10.2 Проведение технической экспертизы включает в себя выполнение следующих действий:

- распечатку на бумажном носителе электронного сообщения, содержащего параметры соответствующей заявки/алгоритмического пакета заявок, в отношении которой проводится техническая экспертиза;
- повтор (имитацию) технологического процесса торгов на указанную дату путем «прогона» файла TransLog на рабочем месте, имеющем доступ к текущей версии программного обеспечения ТС, с целью получения результатов, подтверждающих целостность файла TransLog и соответствие результатов «прогона» результатам торгов на указанную дату;
- проверку соответствия результатов повтора (имитации) торгов на указанную дату информации, содержащейся в протоколе торгов, выписка из которого (операционный лист) предоставляется по требованию Участника торгов;
- фиксирование результатов «прогона» в протоколе работы технической комиссии;
- в случае если заявка подавалась посредством РМ Рейтер, проверку соответствия параметров заявки, зарегистрированной в ТС, параметрам заявки, содержащимся в протоколе переговоров между Участником торгов и Биржей по системе Рейтер;
- фиксирование результатов проверки в протоколе работы технической комиссии;
- проверку соответствия АСП Участника торгов в копии электронного сообщения на бумажном носителе, который содержит параметры заявки/алгоритмического пакета заявок, торговому идентификатору, присвоенному Техническим центром Участнику торгов;
- фиксирование результатов проверки в протоколе работы технической комиссии.

7.10.3 В случае, если:

- заявка/алгоритмический пакет заявок, в отношении которой проводится техническая экспертиза, найдена в файле TransLog;
- результаты повтора (имитации) основной сессии на указанную дату путем «прогона» файла TransLog через ТС соответствуют информации, содержащейся в протоколе торгов, выписка из которого (операционный лист) предоставляется по требованию Участника торгов;

- заявка подавалась посредством РМ Рейтер и установлено соответствие параметров заявки, зарегистрированной в ТС, параметрам заявки, содержащимся в протоколе переговоров между Участником торгов и Биржей по системе Рейтер;
- установлено соответствие АСП Участника торгов в копии электронного сообщения на бумажном носителе, который содержит параметры заявки, торговому идентификатору, присвоенному Техническим центром Участнику торгов;

считается установленным, что:

- заявка/алгоритмический пакет заявок, в отношении которой возникла конфликтная ситуация, были сформированы в соответствии с Правилами торгов Участником торгов/Клиринговым центром;
- после подачи указанной заявки/алгоритмического пакета заявок Участником торгов в ПТК ТЦ не было изменено ни одного параметра заявки/алгоритмического пакета заявок и в ТС зарегистрирована сделка в соответствии с параметрами, указанными в заявке (в том числе заявка из алгоритмического пакета заявок).

7.10.4 По результатам проведения технической экспертизы техническая комиссия составляет протокол в соответствии с п.7.9 настоящих Правил торгов.

7.11 В случае, если по результатам рассмотрения конфликтной ситуации технической комиссией она остается неурегулированной, то такая конфликтная ситуация подлежит рассмотрению в порядке, предусмотренном в Разделе 8 настоящих Правил торгов.

8. ПОРЯДОК РАЗРЕШЕНИЯ СПОРОВ

8.1 Все споры и разногласия, возникшие в связи применением, нарушением, толкованием настоящих Правил торгов, признанием недействительными Правил торгов или их части, в том числе, но не исключительно, споры, касающиеся исполнения обязательств, вытекающих из настоящих Правил торгов, а также споры, касающиеся заключения, изменения и прекращения сделок, заключенных в соответствии с настоящими Правилами торгов, признания сделок недействительными или незаключенными, подлежат рассмотрению и разрешению в порядке арбитража (третейского разбирательства), администрируемого Арбитражным центром при Общероссийской общественной организации «Российский союз промышленников и предпринимателей» (далее – Арбитражный центр) в соответствии с его Регламентом и правилами, действующим на момент подачи искового заявления.

8.2 Решения Арбитражного центра являются окончательными и обязательными для исполнения. Неисполненное добровольно решение Арбитражного центра подлежит принудительному исполнению в соответствии с законодательством Российской Федерации или законодательством страны места принудительного исполнения и международными соглашениями.