

Открытое акционерное
общество «Белорусская валютно-
фондовая биржа»
(ОАО «Белорусская
валютно-фондовая биржа»)

УТВЕРЖДЕНО
Протокол заседания
Правления
07.10.2021 № 62

ПРАВИЛА

заключения сделок купли-
продажи ценных бумаг в
ОАО «Белорусская валютно-
фондовая биржа»

ГЛАВА 1 ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1. Правила заключения сделок купли-продажи ценных бумаг в ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» (далее – Правила) разработаны в соответствии с Законом Республики Беларусь от 5 января 2015 г. № 231-3 «О рынке ценных бумаг» и иными нормативными правовыми актами (далее – законодательство), Уставом ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа», Условиями допуска к торгам в ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» (фондовый рынок) (далее – Условия допуска), Правилами листинга ценных бумаг в ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» (далее – Правила листинга), Правилами осуществления клиринговой деятельности на рынке ценных бумаг в ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» (далее – Правила клиринга), иными локальными правовыми актами ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» (далее – биржа).

2. Правила определяют порядок заключения сделок с ценными бумагами в торговой системе биржи.

3. Для целей настоящих Правил применяются следующие основные термины и их определения:

автоматизированное рабочее место участника торгов (далее – АРМ-участника торгов) – программное обеспечение, используемое для технического доступа к торговой системе биржи;

валюта формирования цены – денежная единица, в которой формируется (указывается) цена ценной бумаги в заявке;

ведущий торгов – лицо, состоящее в штате биржи, действующее на основании доверенности, выданной Председателем Правления биржи, имеющее квалификационный аттестат специалиста рынка ценных бумаг 1-й категории и уполномоченное на управление торговой системой биржи, проведение, приостановление и возобновление торгов, взаимодействие с трейдерами, подачу информационных сообщений в торговую систему биржи и на совершение других действий, предусмотренных Правилами;

встречные заявки – заявки противоположного направления с одинаковыми

кодами расчетов и валютой формирования цен, поданные в одном и том же режиме торгов по одной и той же ценной бумаге;

заявка – предложение (оферта) на покупку (продажу) ценных бумаг, содержащее все существенные условия сделки и означающее безусловное согласие участника торгов, подавшего заявку, совершить сделку на указанных в ней условиях;

клиринговая организация – профессиональный участник рынка ценных бумаг, осуществляющий клиринговую деятельность;

код расчетов – параметр сделки, однозначно определяющий порядок исполнения обязательств по сделке и условия проведения расчетов по ней;

направление заявки – реквизит заявки, который может принимать значение покупка или продажа. Две заявки считаются заявками с противоположным направлением, если направлением одной из них является продажа, а другой покупка;

простой аукцион – режим торгов, в котором заключаются сделки с кодами расчетов SCCP-T0, S-T0, S-T+n, NS, и заявки на продажу (простой аукцион по продаже ценных бумаг) или на покупку (простой аукцион по покупке ценных бумаг) может подавать только один участник торгов;

расчетный депозитарий – депозитарий, осуществляющий операции по переводу ценных бумаг по результатам клиринга в целях исполнения обязательств по сделкам купли-продажи ценных бумаг, заключенных в торговой системе биржи;

расчетная организация – банк, небанковская кредитно-финансовая организация, осуществляющие операции по перечислению денежных средств по результатам клиринга в целях исполнения обязательств по сделкам купли-продажи ценных бумаг, заключенных в торговой системе биржи;

режим торгов – совокупность алгоритмов и условий проведения торгов, определяющих порядок подачи участниками торгов заявок и порядок заключения сделок в торговой системе биржи;

сделки – сделки купли-продажи ценных бумаг, заключенные в торговой системе биржи в порядке, определенном настоящими Правилами;

сделка с кодом расчетов NS – сделка, заключенная между участниками торгов, по которой продавец обязуется передать ценные бумаги, а покупатель – оплатить их в согласованном сторонами сделки и непротиворечащем законодательству порядке, а также в сроки, установленные участниками торгов в момент заключения сделки. Расчеты по данной сделке участники торгов проводят самостоятельно, без участия клиринговой организации, расчетной организации и расчетного депозитария;

сделка с кодом расчетов SCCP-T0 – сделка, заключенная между участником торгов и центральным контрагентом, подлежащая исполнению в день ее заключения. Клиринг по данной сделке осуществляется клиринговой организацией в порядке, определенном Правилами клиринга, расчеты по ценным бумагам – расчетным депозитарием, расчеты по денежным средствам – расчетной организацией;

сделка с кодом расчетов SREPO – сделка купли-продажи ценных бумаг

(первая часть сделки РЕПО), заключенная между участниками торгов, с обязательством через определенный сторонами в момент заключения такой сделки срок (срок РЕПО = n) для продавца по первой части сделки последующей покупки (обратный выкуп), для покупателя по первой части сделки последующей продажи (обратная продажа) ценных бумаг того же выпуска в том же количестве (вторая часть сделки РЕПО) и по цене, определяемой сторонами в момент заключения сделки, в соответствии с требованиями главы 6 настоящих Правил. Обязательства по первой части сделки с кодом расчетов SREPO подлежат исполнению в день ее заключения, обязательства по второй части сделки с кодом расчетов SREPO подлежат исполнению в день, отстоящий от даты исполнения обязательств по первой части сделки на n дней. Клиринг по данной сделке осуществляется клиринговой организацией, в порядке, определенном Правилами клиринга, расчеты по ценным бумагам – расчетным депозитарием, расчеты по денежным средствам – расчетной организацией;

сделка с кодом расчетов SCCPREPO – сделка купли-продажи ценных бумаг (первая часть сделки РЕПО), заключенная между участником торгов и центральным контрагентом, с обязательством через определенный сторонами в момент заключения такой сделки срок (срок РЕПО = n) для продавца по первой части сделки РЕПО последующей покупки (обратный выкуп), для покупателя по первой части сделки последующей продажи (обратная продажа) ценных бумаг того же выпуска в том же количестве (вторая часть сделки РЕПО) и по цене, определяемой сторонами в момент заключения сделки, в соответствии с требованиями главы 6 настоящих Правил. Обязательства по первой части сделки с кодом расчетов SCCPREPO подлежат исполнению в день ее заключения, обязательства по второй части сделки с кодом расчетов SCCPREPO подлежат исполнению в день, отстоящий от даты исполнения обязательств по первой части сделки на n дней. Клиринг по данной сделке осуществляется клиринговой организацией, в порядке, определенном Правилами клиринга, расчеты по ценным бумагам – расчетным депозитарием, расчеты по денежным средствам – расчетной организацией;

сделка РЕПО – сделка с кодом расчетов SREPO или SCCPREPO;

сделка с кодом расчетов S-T0 – сделка, заключенная между участниками торгов, подлежащая исполнению в день ее заключения. Клиринг по данной сделке осуществляется клиринговой организацией в порядке, определенном Правилами клиринга, расчеты по ценным бумагам – расчетным депозитарием, расчеты по денежным средствам – расчетной организацией;

сделка с кодом расчетов S-T+n – сделка, заключенная между участниками торгов, подлежащая исполнению через установленный участниками торгов в момент заключения сделки срок в порядке, определенном настоящими Правилами. Клиринг по данной сделке осуществляется клиринговой организацией в порядке, определенном Правилами клиринга, расчеты по ценным бумагам – расчетным депозитарием, расчеты по денежным средствам – расчетной организацией;

сделка с кодом расчетов SCCP-T+n – сделка, заключенная между участником торгов и центральным контрагентом, подлежащая исполнению через

установленный участником торгов в момент заключения сделки срок в порядке, определенном настоящими Правилами. Клиринг по данной сделке осуществляется клиринговой организацией в порядке, определенном Правилами клиринга, расчеты по ценным бумагам – расчетным депозитарием, расчеты по денежным средствам – расчетной организацией;

система электронного документооборота (далее – СЭД) – совокупность программно-технических средств биржи, включая средства электронно-цифровой подписи, баз данных, телекоммуникационных средств и другого оборудования, предназначенного для выработки, проверки электронно-цифровой подписи, создания, обработки, передачи, учета и хранения электронных документов;

срок РЕПО – период времени, исчисляемый в календарных днях от дня исполнения первой части сделки РЕПО до дня исполнения ее второй части включительно. Для расчета срока РЕПО день исполнения первой части и день исполнения второй части сделки РЕПО считаются одним днем;

лот – минимально допустимое количество ценных бумаг в одной заявке (количество лотов в заявке задается целым числом, объем заявки в штуках и объем сделки, заключенной по данной заявке, всегда кратен размеру лота);

торги – процесс заключения сделок в торговой системе;

торговая система – совокупность программно-технических средств, баз данных, телекоммуникационных средств и другого оборудования биржи, на основе которых осуществляется автоматизация:

процесса приема, контроля и регистрации заявок;

процесса заключения сделок в установленных настоящими Правилами режимах;

процедур контроля достаточности денежных средств и ценных бумаг для исполнения обязательств по сделкам;

процессов исполнения обязательств участников торгов по ранее заключенным сделкам, определенным настоящими Правилами;

функций по подготовке и формированию отчетных документов по итогам торгов и исполнения обязательств по ранее заключенным сделкам;

процессов хранения, обработки и раскрытия информации, необходимой для заключения и исполнения сделок;

иных функций, сопутствующих процессу совершения сделок;

торговый агент – участник торгов, которому в соответствии с локальными правовыми актами биржи предоставлено право при проведении простого аукциона по покупке (продаже) подавать заявки на покупку (продажу) соответственно;

торговый день – день проведения торгов;

трейдер – физическое лицо, уполномоченное участником торгов осуществлять действия, связанные с совершением сделок, и допущенное к участию в торгах в соответствии с Условиями допуска;

уникальный регистрационный код заявки – уникальный цифровой код, автоматически присваиваемый заявке в момент ее ввода в торговую систему и приема в обработку;

уникальный регистрационный код клиента (далее – УРК) – уникальный цифровой код, автоматически присваиваемый клиенту (группе клиентов, фонду при исполнении участником торгов функций доверительного управляющего) участника торгов в момент его (ее) регистрации в торговой системе;

ценные бумаги – ценные бумаги, допущенные к обращению и (или) размещению на бирже в порядке, установленном Правилами листинга;

шаг цены – минимально возможная разница между ценами, указанными в заявках на покупку и (или) продажу ценных бумаг (цена, указанная в заявке, должна быть кратна шагу цены).

4. Термины и их определения, не указанные в настоящих Правилах, используются в значениях, установленных законодательством, Правилами внутреннего контроля, Условиями допуска и другими локальными правовыми актами биржи. Сделки считаются заключенными в месте нахождения биржи.

5. Содержание и продолжительность торгового дня устанавливаются Регламентом торгового дня по сделкам купли-продажи ценных бумаг в ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» (далее – Регламент торгового дня). Регламент торгового дня может содержать особенности заключения и исполнения сделок, не урегулированные настоящими Правилами. Регламент торгового дня согласовывается с республиканским органом государственного управления, осуществляющим государственное регулирование рынка ценных бумаг, утверждается решением Правления биржи и не позднее десяти рабочих дней до даты вступления в силу, если иное не установлено решением Правления биржи, доводится до сведения участников торгов общим извещением с использованием подсистемы «Почтовые сообщения» торговой системы, размещается на едином информационном ресурсе рынка ценных бумаг, а также на официальном сайте биржи в глобальной компьютерной сети Интернет (www.bcse.by) (далее – сайт биржи).

6. Порядок допуска к торгам лиц, имеющих право в соответствии с законодательством совершать сделки, его прекращение и приостановление определяются Условиями допуска.

7. Участник торгов может участвовать в торгах только с использованием АРМ-участника торгов.

8. Участнику торгов в порядке, определенном Условиями допуска и (или) Типовыми условиями размещения и обращения ценных бумаг в ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» (далее – Типовые условия обращения), может быть предоставлено право на заключение сделок:

8.1. от своего имени и за свой счет;

8.2. от своего имени и за счет клиента;

8.3. от своего имени и в интересах клиента (группы клиентов) и (или) вверителей фонда в качестве доверительного управляющего.

9. Биржа осуществляет регистрацию клиентов участников торгов (групп клиентов участников торгов) и (или) фондов с указанием их реквизитов в торговой системе в порядке, определенном Условиями допуска, присваивает им УРК и ведет единый учетный электронный реестр клиентов участников торгов.

10. Участник торгов получает право на заключение сделок за счет (в интересах) клиента только после регистрации клиента в торговой системе.

11. При заключении сделок за счет клиентов участники торгов указывают, за счет кого проводятся такие операции. При заключении сделок от своего имени и в интересах клиента (группы клиентов, вверителей фонда) участник торгов указывает, что он действует в качестве доверительного управляющего.

12. Участники торгов вправе заключать в торговой системе сделки с использованием денежных средств и (или) ценных бумаг, предоставленных участником торгов своему клиенту взаем (далее – маржинальные сделки).

Виды ценных бумаг, которые могут быть предметом маржинальных сделок в торговой системе, разрешенные режимы торгов и коды расчетов, допустимые для данных сделок, определяются Типовыми условиями обращения.

13. Участник торгов несет предусмотренную законодательством ответственность по обязательствам, вытекающим из сделок, заключенных за счет клиента или в интересах клиента (группы клиентов) и (или) вверителей фонда.

14. От имени участника торгов сделки на бирже совершают трейдеры.

15. Участник торгов несет ответственность за все действия, совершаемые его трейдерами в торговой системе. Биржа не несет ответственности за результаты ошибочных или несанкционированных действий трейдера.

16. Для обеспечения информационной безопасности торговых процессов, защиты от несанкционированного доступа к торговой системе, биржей используются системы идентификации и аутентификации участников торгов и трейдеров, шифрование информации в каналах передачи данных, могут применяться средства криптографической защиты информации и электронной подписи, а также другие меры, не противоречащие законодательству.

17. Со стороны биржи полномочия по ведению торгов и контролю за надлежащим выполнением требований настоящих Правил возлагаются на ведущего торгов.

18. Ведущий торгов осуществляет:

18.1. подготовку и управление торговой системы;

18.2. взаимодействие с трейдерами;

18.3. координацию действий представителей структурных подразделений биржи, задействованных в проведении торгов;

18.4. иные действия, определенные настоящими Правилами и другими локальными правовыми актами биржи.

19. Ведущий торгов имеет следующие права:

19.1. требовать неукоснительного соблюдения участниками торгов настоящих Правил;

19.2. делать официальные объявления и сообщения по вопросам, связанным с порядком проведения торгов;

19.3. прекращать или приостанавливать допуск участников торгов и трейдеров к торгам в случаях и порядке, предусмотренных настоящими Правилами, Условиями допуска и иными локальными правовыми актами биржи;

19.4. снимать неудовлетворенные заявки в порядке и в случаях, определенных настоящими Правилами и другими локальными правовыми актами биржи;

19.5. принимать решение о признании простого аукциона несостоявшимся в случаях, определенных настоящими Правилами и другими локальными правовыми актами биржи;

19.6. пользоваться иными правами предоставленными ему настоящими Правилами и другими локальными правовыми актами биржи.

20. Все изменения к настоящим Правилам согласовываются с республиканским органом государственного управления, осуществляющим государственное регулирование рынка ценных бумаг, и утверждаются Правлением биржи.

21. Настоящие Правила, все изменения к настоящим Правилам не позднее чем за десять дней до даты вступления в силу доводятся до сведения участников торгов общим извещением с использованием подсистемы «Почтовые сообщения» торговой системы, размещаются на едином информационном ресурсе рынка ценных бумаг, а также на сайте биржи.

ГЛАВА 2

ОБЩИЕ ПРИНЦИПЫ ЗАКЛЮЧЕНИЯ СДЕЛОК

22. В торговой системе заключаются сделки со следующими кодами расчетов: S-T0, SCCP-T0, S-T+n, SCCP-T+n, NS, SREPO и SCCPREPO.

23. Сделки с кодом расчетов S-T0, SCCP-T0 заключаются только в режимах «дискретный аукцион», «непрерывный двойной аукцион» или «простой аукцион».

24. Сделки с кодом расчетов S-T+n заключаются только в режимах «дискретный аукцион», «форвардные сделки» или «простой аукцион».

25. Сделки с кодом расчетов SCCP-T+n заключаются только в режиме «форвардные сделки».

26. Сделки с кодом расчетов NS заключаются только в режимах «форвардные сделки» или «простой аукцион». Ответственность за соблюдение требований законодательства, настоящих Правил и иных локальных правовых актов биржи при проведении расчетов по сделкам с кодом расчетов NS несут участники торгов, заключившие данную сделку.

27. Сделки с кодом расчетов SREPO и SCCPREPO заключаются только в режиме «РЕПО».

28. Расчеты по сделкам с кодами расчетов S-T0, SCCP-T0, S-T+n, SCCP-T+n, SREPO и SCCPREPO осуществляются расчетной организацией и расчетным депозитарием в порядке, установленном законодательством, Правилами клиринга и другими локальными правовыми актами биржи. Расчеты по сделкам с кодом расчетов NS продавец и покупатель проводят самостоятельно в согласованном сторонами сделки и не противоречащем законодательству порядке, а также в сроки, установленные участниками торгов в момент заключения сделки.

29. Разрешенные режимы торгов и допустимые коды расчетов для каждой ценной бумаги устанавливаются Типовыми условиями обращения. Типовые условия обращения могут разрабатываться для конкретной ценной бумаги или группы ценных бумаг и определять дополнительные по отношению к настоящим Правилам условия размещения и обращения ценных бумаг на бирже.

30. В течение времени, установленного Регламентом торгового дня, Национальный банк может проводить операции для заключения сделок, в том числе и за счет своих клиентов. Форма проведения операций и механизм заключения данных сделок устанавливаются законодательством, Регламентом торгового дня и другими локальными правовыми актами биржи.

31. Сделки с ценными бумагами заключаются на основании поданных участниками торгов в торговую систему заявок на покупку (продажу) ценных бумаг.

32. Цены в заявках формируются в белорусских рублях, иностранной валюте или в процентах к номинальной стоимости ценной бумаги. Допустимые варианты формирования цен и валюты формирования цены устанавливаются для каждой ценной бумаги Типовыми условиями обращения или параметрами простого аукциона.

33. Виды и реквизиты заявок, подаваемых в торговую систему, зависят от режима торгов и определяются в главах 4, 5, 6, 7 настоящих Правил.

34. При подаче заявки на заключение маржинальной сделки в реквизите заявки «признак операции» указывается «маржинальная сделка». В реквизите заявки «количество ценных бумаг в залог (заем)» указывается:

34.1. для заявок на покупку – количество ценных бумаг, передаваемых клиентом участнику торгов в залог в качестве обеспечения исполнения обязательств клиента по займу по маржинальной сделке;

34.2. для заявок на продажу – количество ценных бумаг, предоставляемых участником торгов своему клиенту в заем по маржинальной сделке.

35. Для заявок, подаваемых в торговую систему, устанавливаются шаг цены и лот.

36. Величина шага цены и количество ценных бумаг в лоте (далее – размер лота) и порядок их определения для каждой ценной бумаги, каждого допустимого кода расчетов устанавливаются Типовыми условиями обращения, параметрами простого аукциона. Величина шага цены и размер лота, а также порядок их определения может устанавливаться отдельно для каждого режима торгов и допустимого кода расчетов.

37. При подаче заявки торговая система осуществляет контроль правильности ее оформления. В случае отсутствия в заявке какого-либо обязательного реквизита заявка в торговую систему не принимается и возвращается трейдеру с указанием недостающей информации для корректировки.

38. В случае, если законодательством или локальными правовыми актами биржи установлены предельно допустимые границы колебания цен ценных бумаг (далее – лимиты изменения цены) или лимиты на совокупные или нетто-объемы сделок (далее – объемы сделок), заключенных участником торгов от

своего имени и за свой счет, от своего имени и за счет клиента и (или) от своего имени и в интересах клиента (группы клиентов, вверителей фонда) (далее – лимиты на объемы сделок), заявка, поданная участником торгов с нарушением установленных лимитов изменения цены и (или) приводящая в результате ее исполнения к нарушению лимитов на объемы сделок, в торговую систему не принимается.

39. При приеме каждой заявки торговая система автоматически фиксирует время ее ввода, присваивает ей уникальный регистрационный код и производит ее регистрацию в едином учетном электронном реестре заявок с отражением всех ее реквизитов.

40. Реквизиты и время ввода в торговую систему заявки, зарегистрированной в едином учетном электронном реестре заявок, используются для разрешения спорных ситуаций, следствием которых стало заключение сделок.

41. Неудовлетворенные заявки, находящиеся в торговой системе, могут быть сняты или изменены, если Регламентом торгового дня, Типовыми условиями обращения, параметрами простого аукциона или Регламентом простого аукциона не установлено иное. Изменение реквизитов заявки в торговой системе рассматривается в торговой системе как снятие первоначальной заявки и подача новой с новым временем подачи.

42. При снятии заявки торговая система автоматически фиксирует факт и время ее снятия и производит соответствующие записи в едином учетном электронном реестре заявок.

43. Сделка считается заключенной в момент удовлетворения заявки, поданной участником торгов. О заключении сделки трейдер информируется торговой системой.

44. При удовлетворении каждой пары встречных заявок с кодом расчетов SCCP-T0, SCCPREPO или SCCP-T+n на их основе в торговой системе регистрируется пара сделок на покупку и продажу ценных бумаг с одинаковыми кодами (далее – связанная пара сделок).

45. Каждая сделка с кодом расчетов S-T0, S-T+n, NS, SREPO и каждая связанная пара сделок с кодами расчетов SCCP-T0, SCCPREPO, SCCP-T+n регистрируется и отражается в едином учетном электронном реестре сделок, получает код и хранится в едином учетном электронном реестре сделок постоянно.

46. Регистрация сделки/связанной пары сделок в едином учетном электронном реестре сделок служит доказательством заключения сделок в торговой системе и является основанием для осуществления расчетов.

47. В соответствии с единым учетным электронным реестром сделок для каждого участника торгов, заключившего сделки, оформляются протоколы о результатах торгов. Каждому протоколу о результатах торгов присваивается индивидуальный регистрационный номер.

48. Форма, порядок оформления и подписания протоколов о результатах торгов для каждого вида сделок и режима торгов определяется Положением о документообороте по итогам торгов ценными бумагами в

ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» (далее – Положение о документообороте), Регламентами простого аукциона, разрабатываемыми согласно подпункту 116.19 пункта 116 настоящих Правил и Положением об электронном документообороте в ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» (далее – Положение об электронном документообороте).

49. Протокол о результатах торгов является основанием для отражения результатов сделки в документах бухгалтерского учета.

50. Оформление сделок в торговой системе может осуществляться с использованием СЭД. При использовании СЭД документы по итогам торгов оформляются в виде электронных документов, форматы которых (содержание структуры электронного документа) определяются Положением о документообороте, Регламентами простых аукционов и Положением об электронном документообороте.

ГЛАВА 3 ФОРМИРОВАНИЕ И УЧЕТ ИЗМЕНЕНИЯ ПОЗИЦИЙ ПО ДЕНЕЖНЫМ СРЕДСТВАМ И ЦЕННЫМ БУМАГАМ

51. Торговая система в ходе торгов ведет для каждого участника торгов по каждому виду (выпуску) ценных бумаг учет изменений начальных, текущих и плановых позиций по денежным средствам и по ценным бумагам.

52. Каждой начальной позиции по денежным средствам соответствует определенный счет (раздел счета), используемый для расчетов по денежным средствам при исполнении обязательств по оплате ценных бумаг по итогам заключенных сделок. Каждой начальной позиции по ценным бумагам соответствует определенный счет (раздел счета) «депо», используемый для расчетов по ценным бумагам при исполнении обязательств по передаче ценных бумаг по итогам заключенных сделок.

53. Каждой начальной позиции по ценным бумагам и денежным средствам присваивается регистрационный код (далее – идентификатор). Аналогичный идентификатор присваивается соответствующей текущей и плановой позиции.

54. Начальная позиция по денежным средствам представляет собой сумму денежных средств, зарезервированную участником торгов для обеспечения исполнения обязательств по оплате ценных бумаг по ранее заключенным и (или) планируемым сделкам.

55. Начальная позиция по ценным бумагам представляет собой количество ценных бумаг, зарезервированных участником торгов для обеспечения исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по ранее заключенным и (или) планируемым сделкам.

56. Резервирование денежных средств (ценных бумаг) для обеспечения исполнения обязательств по оплате (передаче) ценных бумаг по ранее заключенным и (или) планируемым сделкам осуществляется в порядке, установленном законодательством, локальными правовыми актами биржи.

57. Начальная позиция по денежным средствам увеличивается при учете в торговой системе дополнительно зарезервированных денежных средств и уменьшается при выводе денежных средств из торговой системы.

58. Начальные позиции по денежным средствам увеличиваются или уменьшаются при подаче участником торгов в торговую систему распоряжения на управление начальными позициями по денежным средствам на сумму денежных средств, указанную в распоряжении. Распоряжение на управление начальными позициями по денежным средствам должно содержать следующие обязательные реквизиты:

58.1. идентификатор позиции, подлежащей уменьшению;

58.2. идентификатор позиции, подлежащей увеличению;

58.3. сумма денежных средств.

59. Начальная позиция по ценным бумагам увеличивается при учете в торговой системе дополнительно зарезервированных ценных бумаг и уменьшается при выводе ценных бумаг из торговой системы.

60. Начальные позиции по ценным бумагам увеличиваются или уменьшаются при подаче участником торгов в торговую систему распоряжения на управление начальными позициями по ценным бумагам на количество ценных бумаг, указанное в распоряжении. Распоряжение на управление начальными позициями по ценным бумагам должно содержать следующие обязательные реквизиты:

60.1. идентификатор позиции, подлежащей уменьшению;

60.2. идентификатор позиции, подлежащей увеличению;

60.3. количество ценных бумаг.

61. Позиции, управление которыми допускается в торговой системе, определяются Условиями допуска.

62. Текущая позиция по денежным средствам рассчитывается по следующей формуле:

текущая позиция = начальная позиция – сумма денежных средств, необходимая для исполнения обязательств по оплате ценных бумаг по сделкам с кодом расчетов S-T0, SCCP-T0 и по первым частям сделок с кодом расчетов SREPO и SCCPREPO, – сумма денежных средств, необходимая для исполнения обязательств по оплате ценных бумаг по сделкам с кодом расчетов S-T+n, SCCP-T+n и по вторым частям сделок с кодом расчетов SREPO и SCCPREPO с наступившими сроками исполнения, + сумма денежных средств, которую участник торгов получил в результате исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по сделкам с кодом расчетов S-T0, SCCP-T0 и по первым частям сделок SREPO и SCCPREPO, + сумма денежных средств, которую участник торгов получил в результате исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по сделкам с кодом расчетов S-T+n и SCCP-T+n и по вторым частям сделок с кодом расчетов SREPO и SCCPREPO с наступившими сроками исполнения.

63. Текущая позиция по ценным бумагам рассчитывается по следующей формуле:

текущая позиция = начальная позиция – количество ценных бумаг, необходимое для исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по сделкам с кодом расчетов S-T0, SCCP-T0 и первым частям сделок с кодом расчетов SREPO и SCCPREPO – количество ценных бумаг, подлежащих передаче в результате исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первым частям сделок с кодом расчетов SREPO, SCCPREPO и сделкам с кодом расчетов S-T+n, SCCP-T+n и по вторым частям сделок с кодом расчетов SREPO и SCCPREPO с наступившими сроками исполнения + количество ценных бумаг, которое участник торгов получил в результате исполнения обязательств по оплате ценных бумаг по сделкам с кодом расчетов S-T0, SCCP-T0 и первым частям сделок с кодом расчетов SREPO и SCCPREPO + количество ценных бумаг, которые участник получил в результате исполнения обязательств по оплате ценных бумаг по сделкам с кодом расчетов S-T+n, SCCP-T+n и по вторым частям сделок с кодом расчетов SREPO и SCCPREPO с наступившими сроками исполнения.

64. Плановые позиции по денежным средствам представляют собой текущие позиции по денежным средствам за вычетом общей суммы неудовлетворенных заявок на покупку ценных бумаг с кодами расчетов S-T0, SCCP-T0, SREPO и SCCPREPO. Сумма заявки определяется в соответствии с подпунктом 68.10 пункта 68 и пунктом 106 настоящих Правил.

65. Плановые позиции по ценным бумагам представляют собой текущие позиции по ценным бумагам за вычетом общего объема неудовлетворенных заявок на продажу ценных бумаг с кодами расчетов S-T0, SCCP-T0, SREPO и SCCPREPO. Объем заявки определяется в соответствии с подпунктом 68.10 пункта 68 и пунктом 105 настоящих Правил.

66. При подаче или снятии заявки торговая система вычисляет новое значение плановой позиции по денежным средствам (ценным бумагам).

67. При удовлетворении заявки на заключение сделки с кодами расчетов S-T0, SCCP-T0, SCCPREPO или SREPO, исполнении обязательств по ранее заключенной сделке с кодом расчетов, S-T+n, SCCP-T+n или обязательств по второй части ранее заключенной сделки РЕПО торговая система вычисляет новое значение текущих и плановых позиций по денежным средствам (ценным бумагам).

ГЛАВА 4 РЕЖИМЫ ДИСКРЕТНЫЙ И НЕПРЕРЫВНЫЙ ДВОЙНОЙ АУКЦИОН

68. Виды и порядок подачи заявок.

68.1. Заявка, поданная в течение дискретного или непрерывного двойного аукциона, представляет собой предложение заключить сделку, содержащее все существенные условия сделки, адресованное всем участникам торгов, если заявка подается на заключение сделки с кодом расчетов S-T0, S-T+n, или центральному контрагенту, если заявка подается на заключение сделки с кодом расчетов SCCP-T0.

68.2. Заявка на покупку (продажу), адресованная центральному контрагенту, удовлетворяется только при наличии в торговой системе встречной по отношению к ней заявки, адресованной центральному контрагенту, с ценой ниже или равной (выше или равной) цене, указанной в поданной заявке.

68.3. Возможны следующие виды заявок:

68.3.1. лимитные заявки с сохранением в котировках;

68.3.2. лимитные заявки без сохранения в котировках;

68.3.3. заявки периода закрытия.

68.4. Лимитная заявка с сохранением в котировках и без сохранения в котировках на покупку (продажу) ценных бумаг означает предложение участника торгов другим участникам торгов, если заявка подается на заключение сделки с кодом расчетов S-T0, S-T+n, или центральному контрагенту, если заявка подается на заключение сделки с кодом расчетов SCCP-T0 на покупку (продажу) ценных бумаг по цене, не выше (не ниже) указанной в данной заявке. Заявка периода закрытия означает предложение участника торгов другим участникам торгов, если заявка подается на заключение сделки с кодом расчетов S-T0, S-T+n, или центральному контрагенту, если заявка подается на заключение сделки с кодом расчетов SCCP-T0 купить (продать) ценные бумаги по цене, рассчитанной в соответствии с подпунктом 70.8 пункта 70 настоящих Правил.

68.5. Лимитные заявки без сохранения в котировках могут быть следующих типов:

68.5.1. делимая;

68.5.2. неделимая.

68.6. Лимитная заявка с сохранением в котировках и без сохранения в котировках должна содержать следующие обязательные реквизиты:

68.6.1. наименование участника торгов, подавшего заявку (только для заявок с кодом расчетов S-T+n);

68.6.2. вид заявки;

68.6.3. наименование ценной бумаги;

68.6.4. направление заявки (покупка или продажа);

68.6.5. количество лотов ценных бумаг, заявленных на покупку (продажу);

68.6.6. цена покупки (продажи);

68.6.7. валюта платежа;

68.6.8. курс валюты формирования цены к валюте платежа/или порядок его определения;

68.6.9. наименование клиента (если заявка выставляется за счет клиента) или указание на то, что участник торгов действует в качестве доверительного управляющего;

68.6.10. код расчетов (S-T0, SCCP-T0 или S-T+n);

68.6.11. срок исполнения, дней (только для заявок с кодом расчетов S-T+n);

68.6.12. идентификаторы позиций по ценным бумагам, в счет которых выставляется заявка;

68.6.13. идентификатор позиции по денежным средствам, в счет которой выставляется заявка;

68.6.14. признак операции;

68.6.15. количество ценных бумаг в залог (заем) (только для заявок, в которых в качестве признака операции указано «маржинальная сделка»).

68.7. В реквизите заявки «срок исполнения, дней» указывается количество календарных дней. Дата исполнения обязательств по передаче (оплате) ценных бумаг, определяется как $T+n$, где T – дата подачи заявки, n – количество календарных дней, указанное в реквизите заявки «срок исполнения, дней».

68.8. Допустимые для сделок с кодом расчетов $S-T+n$ сроки исполнения обязательств устанавливаются Типовыми условиями обращения.

68.9. Заявка периода закрытия должна содержать следующие обязательные реквизиты:

68.9.1. вид заявки;

68.9.2. наименование ценной бумаги;

68.9.3. направление заявки (покупка или продажа);

68.9.4. валюта платежа;

68.9.5. курс валюты формирования цены к валюте платежа;

68.9.6. количество лотов ценных бумаг, заявленных на покупку (продажу);

68.9.7. наименование клиента (если заявка выставляется за счет клиента) или указание на то, что участник торгов действует в качестве доверительного управляющего;

68.9.8. код расчетов ($S-T0$ или $SCCP-T0$);

68.9.9. идентификаторы позиций по ценным бумагам, в счет которых выставляется заявка;

68.9.10. идентификатор позиции по денежным средствам, в счет которой выставляется заявка;

68.9.11. признак операции;

68.9.12. количество ценных бумаг в залог (заем) (только для заявок, в которых в качестве признака операции указано «маржинальная сделка»).

68.10. Объем заявки в лотах равен количеству лотов, указанных в заявке, объем заявки в штуках ценных бумаг равен количеству лотов, указанных в заявке, умноженному на размер лота.

Сумма заявки, используемая для расчета плановой позиции по денежным средствам, определяется как произведение стоимости одного лота в валюте платежа, рассчитанной в порядке, определенном пунктом 68.11 пункта 68 настоящих Правил, на объем заявки в лотах. Стоимость одного лота в валюте платежа для расчета суммы заявки округляется в порядке, установленном Типовыми условиями обращения.

68.11. Стоимость одного лота равна:

68.11.1. цене заявки, умноженной на размер лота и курс валюты формирования цены к валюте платежа (для заявок, цены которых формируются в белорусских рублях или иностранной валюте);

68.11.2. цене заявки, умноженной на размер лота и на номинальную стоимость ценной бумаги, деленную на 100 %, умноженную на курс валюты номинальной стоимости к валюте формирования цены, умноженному на курс

валюты формирования цены к валюте платежа (для заявок, цена которых формируется в процентах от номинальной стоимости ценной бумаги).

68.12. Для определения стоимости лота в качестве цены заявки используется:

68.12.1. для лимитной заявки с сохранением в котировках и без сохранения в котировках – цена, указанная в заявке;

68.12.2. для заявки периода закрытия – цена, рассчитанная в соответствии с подпунктом 70.8 пункта 69 настоящих Правил.

68.13. Допустимые валюты платежа, курсы валюты номинальной стоимости к валютам формирования цены, курсы валюты формирования цены к валютам платежа и (или) порядок их определения устанавливаются Типовыми условиями обращения.

68.14. Ввод участником торгов заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов S-T0 и SCCP-T0 возможен только в случае, если сумма заявки не превосходит значения указанной в заявке плановой позиции участника по денежным средствам.

68.15. Ввод участником торгов заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов S-T0 и SCCP-T0 возможен только в случае, если объем заявки в штуках не превосходит значения указанной в заявке плановой позиции по ценным бумагам.

68.16. Если значение плановой позиции по денежным средствам (ценным бумагам) меньше суммы (объема) заявки с кодом расчетов S-T0 или SCCP-T0, заявка автоматически отклоняется торговой системой и возвращается трейдеру для корректировки.

69. Дискретный аукцион.

69.1. Дискретный аукцион проводится путем последовательного повторения процедур сбора и удовлетворения заявок.

69.2. В ходе периода сбора заявок участники торгов имеют право подавать только лимитные заявки с сохранением в котировках.

69.3. Для каждого дискретного аукциона (если Регламентом торгового дня или Типовыми условиями обращения не установлено иное) Председателем Правления биржи или уполномоченным им лицом определяется время периода сбора и удовлетворения заявок, единственно допустимый код расчетов (S-T0, SCCP-T0 или S-T+n) и единственно допустимый срок расчетов для сделок с кодом расчетов S-T+n.

69.4. На основании поданных участниками торгов заявок по каждой ценной бумаге происходит определение единой цены аукциона на основе следующего алгоритма:

69.4.1. выбирается цена, обеспечивающая максимальный объем сделок, выраженный в количестве ценных бумаг;

69.4.2. при наличии двух и более цен, обеспечивающих одинаковый максимальный объем сделок, выбирается цена, обеспечивающая минимальное абсолютное значение разницы между спросом и предложением (минимальный дисбаланс спроса и предложения);

69.4.3. при наличии двух цен, обеспечивающих минимальный дисбаланс спроса и предложения, единая цена определяется как среднеарифметическое этих цен.

69.5. При вводе, снятии или изменении заявок торговая система на основе алгоритма, определенного в подпункте 69.4 пункта 69 настоящих Правил, производит расчет текущей единой цены аукциона.

69.6. По окончании периода сбора заявок прием, снятие и изменение заявок по инициативе трейдеров прекращаются, торговая система на основе алгоритма, определенного в подпункте 69.4 пункта 69 настоящих Правил, производит расчет единой цены аукциона.

69.7. Если максимальная из цен заявок на покупку меньше минимальной из цен заявок на продажу или заявки отсутствуют, единая цена аукциона не определяется, аукцион признается несостоявшимся или объявляется новый период сбора заявок.

69.8. Удовлетворение лимитной заявки происходит при пересечении ее ценовых условий с единой ценой аукциона. Пересечение ценовых условий имеет место:

69.8.1. для заявки на покупку – если единая цена аукциона не превышает цены, которая указана в лимитной заявке на покупку;

69.8.2. для заявки на продажу – если единая цена аукциона не меньше цены, которая указана в лимитной заявке на продажу.

69.9. При неравенстве спроса и предложения по цене, определенной в соответствии с подпунктом 69.4 пункта 69 настоящих Правил, в первую очередь удовлетворяются заявки на покупку с большей ценой, а заявки на продажу – с меньшей ценой, а при равенстве цен (если Типовыми условиями обращения не определено иное) – заявки, поданные ранее по времени.

69.10. Участники торгов, подавшие заявки с кодом расчетов SCCP-T0, подлежащие удовлетворению согласно условиям подпункта 69.8 пункта 69 настоящих Правил, заключают сделки с центральным контрагентом по единой цене аукциона.

69.11. Если Типовыми условиями обращения не установлено иное, то по окончании дискретного аукциона все неудовлетворенные заявки с кодом расчетов S-T0, S-T+n, SCCP-T0 автоматически снимаются торговой системой.

69.12. Трейдер во время дискретного аукциона имеет доступ к следующей информации:

69.12.1. о значениях позиций участника торгов, трейдером которого он является;

69.12.2. о поданных им заявках (с указанием его заявок, которые могут быть удовлетворены на текущий момент времени);

69.12.3. о значении текущей единой цены аукциона;

69.12.4. о величине и знаке разницы между спросом и предложением по текущей единой цене аукциона;

69.12.5. о минимальной и максимальной ценах в поданных заявках;

69.12.6. о суммарном объеме всех поданных заявок;

69.12.7. о заключенных участником торгов, трейдером которого он является, сделках.

70. Непрерывный двойной аукцион.

70.1. В ходе непрерывного двойного аукциона, за исключением периода его закрытия участник торгов вправе подавать в торговую систему лимитные заявки с сохранением в котировках и без сохранения в котировках с кодом расчетов S-T0 и SCCP-T0.

70.2. Лимитные заявки с сохранением в котировках, по которым на данный момент времени отсутствует возможность удовлетворения, формируют очереди неудовлетворенных заявок по каждой ценной бумаге, коду расчетов, валюте формирования цены.

70.3. Место лимитной заявки с сохранением в котировках в очереди определяется ценой, указанной в заявке (первыми в очереди заявок на покупку (продажу) находятся заявки с большими (меньшими) ценами). Среди заявок с равными ценами первыми в очереди находятся заявки, поданные ранее по времени (если Типовыми условиями обращения не определено иное).

70.4. Лимитные заявки с сохранением и без сохранения в котировках обрабатываются в следующем порядке:

70.4.1. торговая система проверяет, есть ли неудовлетворенные заявки в очереди на продажу (покупку), цена которых меньше (больше) или равна цене обрабатываемой заявки. Если такие заявки есть, то обрабатываемая заявка удовлетворяется по цене заявок, находящихся в очереди первыми, до тех пор, пока есть такие заявки, либо пока обрабатываемая заявка не будет удовлетворена полностью;

70.4.2. если обрабатываемая лимитная заявка с сохранением в котировках удовлетворена не полностью, то она (в размере неудовлетворенной части) помещается в очередь неудовлетворенных заявок по цене, указанной в заявке;

70.4.3. если обрабатываемая делимая лимитная заявка без сохранения в котировках удовлетворена не полностью, то ее неудовлетворенная часть автоматически отклоняется торговой системой;

70.4.4. обрабатываемая лимитная неделимая заявка без сохранения в котировках в случае невозможности ее немедленного удовлетворения в полном объеме автоматически отклоняется торговой системой.

70.5. Участники торгов, подавшие заявки с кодом расчетов SCCP-T0, подлежащих удовлетворению согласно условиям подпункта 70.4 пункта 70 настоящих Правил, заключают сделки с центральным контрагентом.

70.6. Трейдеры во время непрерывного двойного аукциона обеспечиваются следующей информацией:

70.6.1. о значениях позиций участника торгов, трейдером которого он является;

70.6.2. о всех неудовлетворенных заявках (в том числе заявках с кодом расчетов SCCP-T0, адресованных центральному контрагенту);

70.6.3. о заключенных участником торгов, трейдером которого он является, сделках.

70.7. Если Регламентом торгового дня не определено иное, непрерывный двойной аукцион заканчивается периодом закрытия.

70.8. В торговой системе автоматически рассчитывается цена для заявок периода закрытия как средневзвешенная цена сделок с данной ценной бумагой с соответствующим кодом и сроком расчетов, заключенных в течение непрерывного двойного аукциона.

70.9. В период закрытия непрерывного двойного аукциона участники торгов могут подавать только заявки периода закрытия.

70.10. Заявки периода закрытия удовлетворяются по цене, рассчитанной в соответствии с пунктом 70.8 пункта 70 настоящих Правил.

70.11. При неравенстве суммы объемов всех заявок на продажу и суммы объемов всех заявок на покупку, поданных в период закрытия, в первую очередь удовлетворяются заявки, поданные ранее по времени (если Типовыми условиями обращения не определено иное).

70.12. Участники торгов, подавшие в период закрытия непрерывного двойного аукциона заявки на покупку (продажу) ценных бумаг с кодом расчетов SCCP-T0, подлежащие удовлетворению согласно условиям подпункта 70.11 пункта 70 настоящих Правил, заключают сделки на покупку (продажу) ценных бумаг с центральным контрагентом по цене, рассчитанной в соответствии с подпунктом 70.8 пункта 70 настоящих Правил.

70.13. Трейдер во время периода закрытия непрерывного двойного аукциона имеет доступ к следующей информации:

70.13.1. о значениях позиций участника торгов, трейдером которого он является;

70.13.2. о поданных им заявках;

70.13.3. о совокупных объемах заявок периода закрытия;

70.13.4. о заключенных участником торгов, трейдером которого он является сделках.

ГЛАВА 5 РЕЖИМ ФОРВАРДНЫЕ СДЕЛКИ

71. В данном режиме участники торгов имеют право подавать следующие виды заявок:

71.1. заявка на заключение сделки с кодом расчетов S-T+n;

71.2. заявка на заключение сделки с кодом расчетов NS;

71.3. заявка на заключение сделки с кодом расчетов SCCP-T+n.

72. Заявка на заключения сделки с кодом расчетов S-T+n, SCCP-T+n должна содержать следующие реквизиты:

72.1. наименование участника торгов, подавшего заявку;

72.2. вид заявки;

72.3. наименование ценной бумаги;

72.4. направление заявки (покупка или продажа);

72.5. количество лотов ценных бумаг, заявленных на покупку (продажу);

72.6. валюта платежа;

- 72.7. цена за одну ценную бумагу;
- 72.8. курс валюты формирования цены к валюте платежа или порядок его определения;
- 72.9. наименование клиента (если заявка выставляется за счет клиента) или указание на то, что участник торгов действует в качестве доверительного управляющего;
- 72.10. код расчетов (SCCP-T+n или S-T+n);
- 72.11. срок исполнения, дней;
- 72.12. идентификаторы позиций по ценным бумагам, в счет которых выставляется заявка;
- 72.13. идентификатор позиции по денежным средствам, в счет которой выставляется заявка;
- 72.14. признак операции;
- 72.15. количество ценных бумаг в залог (заем) (только для заявок, в которых в качестве признака операции указано «маржинальная сделка»).
73. В реквизите заявки на заключение сделки с кодом расчетов SCCP-T+n, S-T+n «срок исполнения, дней» указывается количество календарных дней. Дата исполнения обязательств по передаче (оплате) ценных бумаг определяется как T+n, где T – дата подачи заявки, n – количество календарных дней, указанное в реквизите заявки «срок исполнения, дней».
74. Допустимые сроки исполнения сделок с кодом расчетов S-T+n, валюты платежа, курс валюты номинальной стоимости к валюте формирования цены, курс валюты формирования цены к валюте платежа и (или) порядок их определения устанавливаются Типовыми условиями обращения.
75. Объем заявки с кодом расчетов S-T+n, SCCP-T+n, в лотах равен количеству лотов, указанных в заявке, объем заявки в штуках равен количеству лотов, указанных в заявке, умноженному на размер лота.
76. Сумма заявки с кодом расчетов S-T+n равна:
- 76.1. цене, указанной в заявке, умноженной на ее объем в штуках и курс валюты платежа по отношению к валюте формирования цены (для заявок, цены которых формируются в белорусских рублях или иностранной валюте);
- 76.2. цене, указанной в заявке, умноженной на ее объем и на номинальную стоимость ценной бумаги, деленную на 100 %, умноженную на курс валюты номинальной стоимости к валюте формирования цены и на курс валюты формирования цены к валюте платежа (для заявок, цена которых формируется в процентах от номинальной стоимости ценной бумаги).
77. Заявка на заключение сделки с кодом расчетов NS должна содержать следующие реквизиты:
- 77.1. наименование участника торгов, подавшего заявку;
- 77.2. вид заявки;
- 77.3. наименование ценной бумаги;
- 77.4. направление заявки (покупка или продажа);
- 77.5. количество лотов ценных бумаг, заявленных на покупку (продажу);
- 77.6. валюта платежа;
- 77.7. цена за одну ценную бумагу;

77.8. курс валюты формирования цены к валюте платежа или порядок его определения;

77.9. наименование клиента (если заявка выставляется за счет клиента) или указание на то, что участник торгов действует в качестве доверительного управляющего;

77.10. код расчетов (всегда NS);

77.11. срок или дата оплаты ценных бумаг;

77.12. срок или дата передачи ценных бумаг;

77.13. реквизиты счета для зачисления ценных бумаг (только для заявок на покупку);

77.14. реквизиты счета для зачисления денежных средств (только для заявок на продажу);

77.15. признак операции;

77.16. количество ценных бумаг в залог (заем) (только для заявок, в которых в качестве признака операции указано «маржинальная сделка»).

78. В реквизите заявки на заключение сделки с кодом расчетов NS «срок или дата оплаты ценных бумаг» указывается:

78.1. дата (если обязательства по оплате ценных бумаг должны быть исполнены не позднее указанной даты);

78.2. количество календарных дней с указанием момента начала их исчисления (если обязательства по оплате ценных бумаг должны быть исполнены в течение определенного срока). Моментом начала исчисления срока исполнения обязательств по оплате ценных бумаг может быть дата заключения сделки или дата передачи ценных бумаг.

79. В реквизите заявки на заключение сделки с кодом расчетов NS «срок или дата передачи ценных бумаг» указывается:

79.1. дата (если обязательства по передаче ценных бумаг должны быть исполнены не позднее указанной даты);

79.2. количество календарных дней с указанием момента начала их исчисления (если обязательства по передаче ценных бумаг должны быть исполнены в течение определенного срока). Моментом начала исчисления срока исполнения обязательств по передаче ценных бумаг может быть дата заключения сделки или дата оплаты ценных бумаг.

80. Допустимые для сделок с кодом расчетов NS сроки или даты оплаты (передачи) ценных бумаг, допустимые валюты платежа, курсы валюты номинальной стоимости к валюте формирования цены, курсы валюты формирования цены к валютам платежа и (или) порядок их определения устанавливаются Типовыми условиями обращения.

81. Объем заявки с кодом расчетов NS в лотах равен количеству лотов, указанных в заявке, объем заявки в штуках равен количеству лотов, указанных в заявке, умноженному на размер лота.

82. Сумма заявки с кодом расчетов NS равна:

82.1. цене, указанной в заявке, умноженной на ее объем в штуках и курс валюты платежа по отношению к валюте формирования цены (для заявок, цены которых формируются в белорусских рублях или иностранной валюте);

82.2. цене, указанной в заявке, умноженной на ее объем в штуках, на номинальную стоимость ценной бумаги, деленную на 100 % и умноженную на курс валюты номинальной стоимости к валюте формирования цены и на курс валюты формирования цены к валюте платежа (для заявок, цена которых формируется в процентах от номинальной стоимости ценной бумаги).

83. Удовлетворение заявки с кодом расчетов S-T+n и заключение сделки в торговой системе происходит при совпадении следующих реквизитов, указанных в двух встречных заявках:

83.1. наименование ценной бумаги;

83.2. количество лотов ценных бумаг, заявленных на покупку (продажу);

83.3. цена за одну ценную бумагу;

83.4. курс валюты формирования цены к валюте платежа или порядок его определения;

83.5. срок исполнения, дней.

84. При наличии в торговой системе двух и более встречных заявок с кодом расчетов S-T+n, у которых реквизиты, указанные в подпункте 83 пункта 83 настоящих Правил, совпадают с аналогичными реквизитами вновь подаваемой заявки, первыми удовлетворяются заявки, поданные ранее по времени (если Типовыми условиями обращения не определено иное).

85. Заявка на покупку (продажу) с кодом расчетов SCCP-T+n удовлетворяется только при наличии в торговой системе заявки на продажу (покупку) с кодом расчетов SCCP-T+n, у которой реквизиты совпадают с аналогичными реквизитами заявки на покупку (продажу):

85.1. наименование ценной бумаги;

85.2. количество лотов ценных бумаг, заявленных на покупку (продажу);

85.3. цена за одну ценную бумагу;

85.4. курс валюты формирования цены к валюте платежа или порядок его определения;

85.5. срок исполнения, дней.

86. При наличии двух и более заявок на продажу (покупку) с кодом расчетов SCCP-T+n, у которых реквизиты совпадают с аналогичными реквизитами вновь подаваемой заявки на покупку (продажу) с кодом расчетов SCCP-T+n, первыми удовлетворяются заявки на продажу, поданные ранее по времени (если Типовыми условиями обращения не определено иное).

87. Удовлетворение заявки с кодом расчетов NS и заключение сделки в торговой системе происходит при совпадении следующих реквизитов, указанных в двух встречных заявках:

87.1. наименование ценной бумаги;

87.2. количество лотов ценных бумаг, заявленных на покупку (продажу);

87.3. цена за одну ценную бумагу;

87.4. курс валюты формирования цены к валюте платежа или порядок его определения;

87.5. срок или дата оплаты ценных бумаг;

87.6. срок или дата передачи ценных бумаг

88. При наличии в торговой системе двух и более встречных заявок с кодом расчетов NS, у которых реквизиты, указанные в пункте 87 настоящих Правил, совпадают с аналогичными реквизитами вновь подаваемой заявки, первыми удовлетворяются заявки, поданные ранее по времени (если Типовыми условиями обращения не определено иное).

89. При заключении сделок в данном режиме участник торгов имеет следующие права:

89.1. формировать связанную группу заявок, подлежащих единовременному удовлетворению;

89.2. формировать справочник счетов, используемых для исполнения обязательств по оплате (передаче) ценных бумаг по сделкам с кодом расчетов NS.

90. Заявка на заключение сделки с кодом расчетов SCCP-T+n, S-T+n, NS означает предложение участника торгов другим участникам торгов, если заявка подается на заключение сделки с кодом расчетов S-T+n и NS, или центральному контрагенту, если заявка подается на заключение сделки с кодом расчетов SCCP-T+n на покупку (продажу) ценных бумаг по цене и иных условиях, определяемых на основании реквизитов, указанных в заявке.

91. Удовлетворение заявок, включенных в группу, происходит одновременно при выполнении следующих условий:

91.1. наличии в торговой системе группы, сформированной из встречных заявок (далее – встречная группа);

91.2. реквизиты заявок из группы, указанные в пунктах 83 и 85 настоящих Правил для заявок с кодом расчетов S-T+n и SCCP-T+n соответственно) или пункте 87 настоящих Правил (для заявок с кодом расчетов NS) совпадают с реквизитами заявок встречной группы.

92. В порядке, определенном Типовыми условиями обращения участникам торгов может быть предоставлена возможность формирования списка допустимых контрагентов.

93. Заключение сделки с кодом расчетов S-T+n, SCCP-T+n приводит к возникновению обязательств по передаче ценных бумаг участником-продавцом и оплате ценных бумаг участником-покупателем в день T+n.

94. Заключение сделки с кодом расчетов NS приводит к возникновению обязательств по передаче ценных бумаг участником-продавцом и оплате ценных бумаг участником-покупателем в порядке, выбранном и согласованном сторонами, и в сроки, установленные ими в момент заключения сделки.

95. Трейдеры участника торгов в режиме заключения форвардных сделок имеют доступ к следующей информации:

95.1. о значениях позиций участника торгов, трейдером которого он является;

95.2. о неудовлетворенных заявках на покупку (продажу) ценных бумаг;

95.3. о заключенных участником торгов, трейдером которого он является сделках.

РЕЖИМ «РЕПО»

96. В данном режиме участники торгов заключают сделки с кодом расчетов SREPO и SCCPREPO.

97. Для заключения сделки РЕПО участник торгов подает в торговую систему заявку, содержащую следующие обязательные реквизиты:

- 97.1. наименование участника торгов, подавшего заявку;
- 97.2. вид заявки;
- 97.3. наименование ценной бумаги;
- 97.4. направление заявки (покупка или продажа);
- 97.5. количество лотов ценных бумаг, заявленных на покупку (продажу);
- 97.6. валюта платежа;
- 97.7. курс валюты формирования цены к валюте платежа или порядок его определения;
- 97.8. цена за одну ценную бумагу по первой части сделки РЕПО;
- 97.9. ставка РЕПО, в % годовых;
- 97.10. срок РЕПО, в количестве календарных дней;
- 97.11. наименование клиента (если заявка выставляется за счет клиента) указание на то, что участник торгов действует в качестве доверительного управляющего;
- 97.12. код расчетов (SCCPREPO или SREPO);
- 97.13. идентификаторы позиций по ценным бумагам, в счет которых выставляется заявка;
- 97.14. идентификатор позиции по денежным средствам, в счет которой выставляется заявка;
- 97.15. способ возмещения промежуточных платежей по сделке РЕПО (промежуточные платежи – суммы денежных средств, полученные или подлежащие получению в результате выплаты эмитентом процентного дохода по ценным бумагам, являющимся предметом сделки). Данный реквизит указывается только в заявках на заключение сделок с облигациями, по которым предусмотрена выплата эмитентом процентного дохода.

- 97.16. признак операции;
- 97.17. количество ценных бумаг в залог (заем) (только для заявок, в которых в качестве признака операции указано «маржинальная сделка»).

98. При заполнении реквизита «способ возмещения промежуточных платежей», указанного в подпункте 97.15 пункта 97 настоящих Правил, может быть выбран один из следующих способов.

98.1. Зачет промежуточных платежей в счет суммы основного долга.

При выборе данного способа возмещения промежуточных платежей выплаты процентного дохода уменьшают сумму основного долга по сделке РЕПО (сумму первой части сделки РЕПО), на которую производится начисление процентов по указанной в заявке ставке РЕПО на сумму денежных средств, полученных покупателем по первой части сделки РЕПО в результате выплаты процентных доходов по ценным бумагам, являющимся предметом сделки.

98.2. Зачет промежуточных платежей в счет суммы обратного выкупа.

При выборе данного способа возмещения промежуточных платежей выплаты процентного дохода уменьшают сумму второй части сделки РЕПО на сумму денежных средств, полученных покупателем по первой части сделки РЕПО в результате выплаты процентных доходов по ценным бумагам, являющимся предметом сделки.

98.3. Зачет прогнозных значений промежуточных платежей в счет суммы основного долга.

При выборе данного способа возмещения промежуточных платежей на дату заключения сделки РЕПО производится расчет прогнозных промежуточных платежей, которые будут получены покупателем по первой части сделки РЕПО в результате выплаты процентных доходов по ценным бумагам, являющимся предметом сделки. Размер прогнозных промежуточных платежей определяется исходя из известных на момент заключения сделки РЕПО и последней объявленной эмитентом ставки процентного дохода. На величину прогнозных промежуточных платежей производится уменьшение суммы основного долга по сделке РЕПО (суммы первой части сделки РЕПО), на которую производится начисление процентов по указанной в заявке ставке РЕПО.

98.4. Перечисление промежуточных платежей (только для сделок с кодом расчетов SREPO).

При выборе данного способа возмещения промежуточных платежей покупатель по первой части сделки с кодом расчетов SREPO берет на себя обязательства по перечислению денежных средств, полученных им по первой части сделки с кодом расчетов SREPO в результате выплаты процентных доходов по ценным бумагам, являющимся предметом сделки.

98.5. Возмещение по методике участника торгов.

При выборе данного способа возмещения промежуточных платежей участник торгов рассчитывает цену за одну ценную бумагу по первой части сделки РЕПО и ставку РЕПО самостоятельно с учетом необходимости возмещения продавцу по первой части сделки РЕПО сумм денежных средств, полученных покупателем по первой части сделки РЕПО, в том числе в результате выплаты процентных доходов по ценным бумагам, являющимся предметом сделки, согласно собственной методике расчетов.

99. Заявка на покупку (продажу) ценных бумаг с кодом расчетов SREPO и SCCPREPO представляет собой предложение участника торгов другим участникам торгов, если заявка подается на заключение сделки с кодом расчетов SREPO, или центральному контрагенту, если заявка подается на заключение сделки с кодом расчетов SCCPREPO о покупке (продаже) в день T_0 (T_0 – дата подачи заявки) ценных бумаг в количестве и по цене, указанной в заявке (первая часть сделки РЕПО), с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) того же выпуска ценных бумаг в том же количестве (вторая часть сделки РЕПО) в день T_0+n (T_0 – дата подачи заявки, n – количество календарных дней, указанное в реквизите заявки «срок РЕПО») по цене, определяемой в соответствии с пунктом 102 настоящих Правил. Исполнение обязательств по передаче и оплате ценных бумаг, вытекающих из первой и второй частей сделки РЕПО,

производится в день T_0 (далее – дата заключения сделки РЕПО) и T_0+n (далее – дата обратного выкупа (обратной продажи)) соответственно.

100. Сумма денежных средств, которую продавец по первой части сделки РЕПО должен уплатить покупателю по первой части сделки РЕПО в дату обратного выкупа (далее – сумма обратного выкупа) определяется:

100.1. для сделок с дисконтными облигациями, а также сделок, совершенных на основании заявок, в которых реквизит «способ возмещения промежуточных платежей» принимает значение «Перечисление промежуточных платежей» или «Возмещение по методике участника торгов» в соответствии со следующей формулой:

$$S_2 = \left(P_1 + \frac{P_1 * R}{100} * \left(\frac{\Delta t_1}{365} + \frac{\Delta t_2}{366} \right) \right) * V * E,$$

где

S_2 – сумма обратного выкупа;

V – количество ценных бумаг, покупаемых (продаваемых) покупателем (продавцом) по первой части сделки РЕПО;

E – курс валюты формирования цены к валюте платежа;

P_1 – цена за одну ценную бумагу, указанная в заявке на заключение сделки с кодом расчетов SREPO в валюте формирования цены (цена первой части сделки РЕПО);

R – ставка РЕПО, в % годовых, указанная в заявке на заключение сделки с кодом расчетов SREPO;

Δt_1 – часть срока РЕПО, приходящаяся на год, состоящий из 365 дней;

Δt_2 – часть срока РЕПО, приходящаяся на год, состоящий из 366 дней;

$$t = \Delta t_1 + \Delta t_2$$

t – количество календарных дней, указанное в реквизите заявки «срок РЕПО»;

100.2. для сделок, совершенных на основании заявок, в которых реквизит «способ возмещения промежуточных платежей» принимает значение «Зачет промежуточных платежей в счет суммы основного долга», «Зачет прогнозных промежуточных платежей в счет суммы основного долга» по следующей формуле:

$$S_2 = \left(S_1 - \sum_{i=1}^n \Delta S_i * e_i \right) + S_1 * \frac{R}{100} * \left(\frac{\Delta t_0^{365}}{365} + \frac{\Delta t_0^{366}}{366} \right) + \sum_{j=1}^n \left(S_1 - \sum_{i=1}^j \Delta S_i * e_i \right) * \frac{R}{100} * \left(\frac{\Delta t_i^{365}}{365} + \frac{\Delta t_i^{366}}{366} \right)$$

$$S_2^{\text{в валюте платежа}} = S_2 * E,$$

где

R – ставка РЕПО, в % годовых, указанная в заявке на заключение сделки с кодом расчетов SREPO;

S_1 – сумма первой части сделки с кодом расчетов SREPO в валюте формирования цены;

S_2 – сумма обратного выкупа по сделке с кодом расчетов SREPO в валюте формирования цены;

$S_2^{\text{в валюте платежа}}$ – сумма обратного выкупа в валюте платежа по сделке с кодом расчетов SREPO;

E – курс валюты формирования цены к валюте платежа на день T ;

e_i – курс валюты номинальной стоимости ценной бумаги к валюте формирования цены на дату t_i , если сделка с кодом расчетов SREPO заключена на условиях зачета промежуточных платежей в счет суммы основного долга или на день T_0 , если сделка с кодом расчетов SREPO заключена на условиях зачета прогнозных значений промежуточных платежей в счет суммы основного долга;

$$\Delta S_i = S_i^{\% \text{ доход}}$$

$S_i^{\% \text{ доход}}$ – сумма денежных средств в валюте номинальной стоимости ценной бумаги, полученная покупателем по первой части сделки с кодом РЕПО в результате выплаты процентного дохода в день t_i , если сделка РЕПО заключена на условиях зачета промежуточных платежей в счет суммы основного долга или сумма денежных средств в валюте номинальной стоимости ценной бумаги, равная прогнозному значению процентного дохода, если сделка РЕПО заключена на условиях зачета прогнозных значений промежуточных платежей в счет суммы основного долга. При этом прогнозные значения процентных доходов рассчитываются в валюте номинальной стоимости ценной бумаги исходя из известных на момент заключения сделки РЕПО и последней объявленной эмитентом ставки процентного дохода;

$$\Delta t_0 = t_1 - T_0;$$

T_0 – дата исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО;

T – дата исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО (дата обратного выкупа (обратной продажи));

Δt_0^{365} – количество дней в интервале Δt_0 , приходящееся на год, состоящий из 365 дней;

Δt_0^{366} – количество дней в интервале Δt_0 , приходящееся на год, состоящий из 366 дней;

t_i – дата выплаты процентного дохода $S_i^{\% \text{ доход}}$;

$$\Delta t_i = t_{i+1} - t_i, \text{ для } i \text{ от } 1 \text{ до } n-1;$$

$$\Delta t_n = T - t_n, \text{ для } i=n;$$

Δt_i^{365} – количество дней в интервале Δt_i , приходящееся на год состоящий из 365 дней;

Δt_i^{366} – количество дней в интервале Δt_i , приходящееся на год состоящий из 366 дней;

100.3. для сделок, совершенных на основании заявок, в которых реквизит «способ возмещения промежуточных платежей» принимает значение «Зачет промежуточных платежей в счет суммы обратного выкупа» в соответствии со следующей формулой:

$$S_2 = \left(P_1 + \frac{P_1 * R}{100} * \left(\frac{\Delta t_1}{365} + \frac{\Delta t_2}{366} \right) \right) * V * E - \sum_{i=1}^n S_i^{\% \text{ доход}} * e_i,$$

где

S_2 – сумма обратного выкупа (обратной продажи);

$S_i^{\% \text{ доход}}$ – сумма денежных средств в валюте номинальной стоимости ценной бумаги, полученная покупателем по первой части сделки РЕПО в результате выплаты процентного дохода;

i – порядковый номер выплаты процентного дохода, который изменяется от 1 до n , где n – количество выплат процентного дохода, приходящиеся на период времени от T_0 до T (нумерация выплат процентного дохода в целях использования его в формуле, указанной в подпункте 100.2 пункта 100, настоящих Правил производится внутри периода времени от T_0 до T);

j – от 1 до i , где j – порядковые номера выплат процентного дохода, который изменяется от 1 до i (нумерация выплат процентного дохода в целях использования его в формуле, указанной в подпункте 100.2 пункта 100, настоящих Правил производится внутри периода времени от T_0 до T);

T_0 – дата исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО;

T – дата исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО (дата обратного выкупа (обратной продажи));

V – количество ценных бумаг по сделке РЕПО;

E – курс валюты формирования цены к валюте платежа на день исполнения второй части сделки с кодом расчетов SREPO.

e_i – курс валюты номинальной стоимости к валюте платежа на день получения суммы денежных средств $S_i^{\% \text{ доход}}$;

P_1 – цена за одну ценную бумагу, указанная в заявке на заключение сделки РЕПО в валюте формирования цены (цена первой части сделки РЕПО);

R – ставка РЕПО, в % годовых, указанная в заявке на заключение сделки РЕПО;

Δt_1 – часть срока РЕПО, приходящаяся на год, состоящий из 365 дней;

Δt_2 – часть срока РЕПО, приходящаяся на год, состоящий из 366 дней;

$$t = \Delta t_1 + \Delta t_2$$

t – количество календарных дней, указанное в реквизите заявки «срок РЕПО».

101. Исполнение обязательств по передаче и оплате ценных бумаг, вытекающих из первой и второй частей сделки РЕПО, производится в день T_0 (далее – дата заключения сделки РЕПО) и T_0+n (далее – дата обратного выкупа (обратной продажи)), соответственно.

102. Цена обратного выкупа (обратной продажи) по сделке РЕПО в валюте формирования цены рассчитывается по следующей формуле:

$$P_2 = \frac{S_2}{V}$$

где:

P_2 – цена обратного выкупа (обратной продажи) по сделке РЕПО в валюте формирования цены;

V – количество ценных бумаг по сделке РЕПО;

S_2 – сумма обратного выкупа (обратной продажи) по сделке РЕПО в валюте формирования цены.

103. Допустимые для сделок с кодом расчетов SREPO, SCCPREPO сроки РЕПО, а также допустимые способы возмещения выплат процентного дохода устанавливаются Типовыми условиями обращения.

104. Объем заявки с кодом расчетов SREPO, SCCPREPO в лотах равен количеству лотов, указанных в заявке.

105. Объем заявки с кодом расчетов SREPO, SCCPREPO в штуках равен количеству лотов, указанных в заявке, умноженному на размер лота.

106. Сумма заявки с кодом расчетов SREPO, SCCPREPO равна:

106.1. цене, указанной в заявке, умноженной на ее объем в штуках и курс валюты формирования цены к валюте платежа (для заявок, цены которых формируются в белорусских рублях или иностранной валюте);

106.2. цене, указанной в заявке, умноженной на ее объем в штуках, на номинальную стоимость ценной бумаги, деленную на 100 %, умноженную на курс валюты номинальной стоимости к валюте формирования цены и на курс валюты формирования цены к валюте платежа (для заявок, цена которых формируются в процентах от номинальной стоимости ценной бумаги).

107. Допустимые валюты платежа, курсы валюты номинальной стоимости к валютам формирования цены, курсы валюты формирования цены к валютам платежа и (или) порядок их определения устанавливаются Типовыми условиями обращения.

108. Ввод участником торгов заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов SREPO, SCCPREPO возможен только в случае, если сумма заявки не превосходит значения указанной в заявке плановой позиции участника торгов по денежным средствам.

109. Ввод участником торгов заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов SREPO, SCCPREPO возможен только в случае, если объем заявки в штуках не превосходит значения указанной в заявке плановой позиции по ценным бумагам.

110. Если значение плановой позиции по денежным средствам (ценным бумагам) меньше суммы (объема) заявки с кодом расчетов SREPO, SCCPREPO заявка автоматически отклоняется торговой системой и возвращается трейдеру для корректировки.

111. Удовлетворение заявки и заключение сделки РЕПО в торговой системе происходит при совпадении следующих реквизитов, указанных в двух встречных заявках:

111.1. вид заявки;

111.2. наименование ценной бумаги;

111.3. количество лотов ценных бумаг, заявленных на покупку (продажу);

111.4. код расчетов;

111.5. цена за одну ценную бумагу по первой части сделки РЕПО;

111.6. курс валюты формирования цены к валюте платежа или порядок его определения;

111.7. ставка РЕПО, в % годовых;

111.8. срок РЕПО, в количестве календарных дней;

111.9. способ возмещения промежуточных платежей (при наличии реквизита).

112. При наличии в торговой системе двух и более встречных заявок, у которых вышеназванные реквизиты совпадают, первыми удовлетворяются заявки, поданные ранее по времени (если Типовыми условиями обращения не определено иное).

113. При заключении сделок в данном режиме участник торгов имеет право формировать связанную группу заявок, подлежащих единовременному удовлетворению.

114. Удовлетворение заявок, включенных в группу, происходит одновременно при выполнении следующих условий:

114.1. наличия в торговой системе группы, сформированной из встречных заявок (далее – встречная группа);

114.2. реквизиты заявок из группы, указанные в пункте 111 настоящих Правил, совпадают с реквизитами заявок встречной группы.

115. Трейдеры участника торгов в режиме «РЕПО» имеют доступ к следующей информации:

115.1. о значениях позиций участника торгов, трейдером которого он является;

115.2. о неудовлетворенных заявках на покупку (продажу) ценных бумаг;

115.3. о заключенных участником торгов, трейдером которого он является, сделках.

ГЛАВА 7 ПРОСТОЙ АУКЦИОН

116. Общие положения.

116.1. Простой аукцион по ценным бумагам является режимом торгов, в котором заявки на продажу (простой аукцион по продаже ценных бумаг) или на покупку (простой аукцион по покупке ценных бумаг) может подавать только один участник торгов – торговый агент.

116.2. Участнику торгов предоставляется право на выполнение функций торгового агента в порядке, определенном Условиями допуска.

116.3. В торговой системе допускается проведение следующих видов простых аукционов:

116.3.1. стандартный с объявлением стартовой цены;

116.3.2. стандартный без объявления стартовой цены;

116.3.3. с определением единой цены с объявлением стартовой цены;

116.3.4. с определением единой цены без объявления стартовой цены.

116.4. В режиме простой аукцион участники торгов имеют право подавать следующие виды заявок:

116.4.1. лимитные заявки;

116.4.2. рыночные заявки.

116.5. Лимитная заявка должна содержать следующие обязательные реквизиты:

- 116.5.1. вид заявки;
 - 116.5.2. наименование ценной бумаги;
 - 116.5.3. направление заявки (покупка или продажа);
 - 116.5.4. количество лотов ценных бумаг, заявленных на покупку (продажу);
 - 116.5.5. валюта платежа;
 - 116.5.6. курс валюты формирования цены к валюте платежа;
 - 116.5.7. цена покупки (продажи);
 - 116.5.8. наименование клиента (если заявка выставляется за счет клиента) или указание на то, что участник торгов действует в качестве доверительного управляющего;
 - 116.5.9. код расчетов;
 - 116.5.10. срок исполнения дней (только для заявок с кодом расчетов S-T+n);
 - 116.5.11. идентификаторы позиций по ценным бумагам, в счет которых выставляется заявка (только для заявок с кодами расчетов SCCP-T0, S-T0 и S-T+n);
 - 116.5.12. идентификаторы позиций по денежным средствам, в счет которой выставляется заявка (только для заявок с кодами расчетов SCCP-T0, S-T0 и S-T+n.);
 - 116.5.13. срок или дата оплаты ценных бумаг (только для заявок с кодом расчетов NS);
 - 116.5.14. срок или дата передачи ценных бумаг (только для заявок с кодом расчетов NS);
 - 116.5.15. реквизиты счета для зачисления ценных бумаг (только для заявок на продажу с кодом расчетов NS);
 - 116.5.16. реквизиты счета для зачисления денежных средств (только для заявок на продажу с кодом расчетов NS);
 - 116.5.17. признак операции;
 - 116.5.18. количество ценных бумаг в залог (заем) (только для заявок, в которых в качестве признака операции указано «маржинальная сделка»).
- 116.6. Лимитная заявка на покупку, поданная участником торгов, означает предложение участника торгов торговому агенту, если заявка подается на заключение сделки с кодом расчетов S-T0, S-T+n, NS, или центральному контрагенту, если заявка подается на заключение сделки с кодом расчетов SCCP-T0 на покупку ценных бумаг по цене, не выше указанной в данной заявке.
- 116.7. Лимитная заявка на продажу, поданная участником торгов, означает предложение участника торгов торговому агенту, если заявка подается на заключение сделки с кодом расчетов S-T0, S-T+n, NS, или центральному контрагенту, если заявка подается на заключение сделки с кодом расчетов SCCP-T0, на продажу ценных бумаг по цене, не ниже указанной в данной заявке.
- 116.8. Рыночная заявка должна содержать следующие обязательные реквизиты:
- 116.8.1. вид заявки;
 - 116.8.2. наименование ценной бумаги;

- 116.8.3. направление заявки (покупка или продажа);
 - 116.8.4. валюта платежа;
 - 116.8.5. курс валюты формирования цены к валюте платежа;
 - 116.8.6. количество лотов ценных бумаг, заявленных на покупку (продажу);
 - 116.8.7. сумма денежных средств, направляемая на покупку ценных бумаг (только для заявок на покупку);
 - 116.8.8. наименование клиента (если заявка выставляется за счет клиента) или указание на то, что участник торгов действует в качестве доверительного управляющего;
 - 116.8.9. код расчетов;
 - 116.8.10. срок исполнения дней (только для заявок с кодом расчетов S-T+n,);
 - 116.8.11. идентификаторы позиций по ценным бумагам, в счет которых выставляется заявка (только для заявок с кодами расчетов SCCP-T0, S-T0 и S-T+n,);
 - 116.8.12. идентификатор позиции по денежным средствам, в счет которой выставляется заявка (только для заявок с кодами расчетов SCCP-T0, S-T0 и S-T+n,);
 - 116.8.13. срок или дата оплаты ценных бумаг (только для заявок с кодом расчетов NS);
 - 116.8.14. срок или дата передачи ценных бумаг (только для заявок с кодом расчетов NS);
 - 116.8.15. реквизиты счета для зачисления ценных бумаг (только для заявок на продажу с кодом расчетов NS);
 - 116.8.16. реквизиты счета для зачисления денежных средств (только для заявок на продажу с кодом расчетов NS);
 - 116.8.17. признак операции;
 - 116.8.18. количество ценных бумаг в залог (заем) (только для заявок, в которых в качестве признака операции указано «маржинальная сделка»).
- 116.9. Рыночная заявка на покупку, поданная участником торгов, означает предложение участника торгов торговому агенту, если заявка подается на заключение сделки с кодом расчетов S-T0, S-T+n, NS, или центральному контрагенту, если заявка подается на заключение сделки с кодом расчетов SCCP-T0, на покупку ценных бумаг по цене, определяемой в соответствии с подпунктом 118.9 пункта 118 настоящих Правил, на сумму, не превышающую сумму, указанную в заявке.
- 116.10. Рыночная заявка на продажу, поданная участником торгов, означает предложение участника торгов торговому агенту, если заявка подается на заключение сделки с кодом расчетов S-T0, S-T+n, NS, или центральному контрагенту, если заявка подается на заключение сделки с кодом расчетов SCCP-T0, на продажу ценных бумаг по цене, определяемой в соответствии с подпунктом 118.9 пункта 118 настоящих Правил, на сумму, не превышающую сумму, указанную в заявке.

116.11. В реквизите заявки «срок исполнения, дней» указывается количество календарных дней. Дата исполнения обязательств по передаче (оплате) ценных бумаг определяется как $T+n$ где T – дата подачи заявки, n – количество календарных дней, указанное в реквизите заявки «срок исполнения, дней».

116.12. В реквизите заявки «срок или дата оплаты ценных бумаг» указываются:

116.12.1. дата (если обязательства по оплате ценных бумаг должны быть исполнены не позднее указанной даты);

116.12.2. количество календарных дней с указанием момента начала их исчисления (если обязательства по оплате ценных бумаг должны быть исполнены в течение определенного срока). Моментом начала исчисления срока исполнения обязательств по оплате ценных бумаг может быть дата заключения сделки или дата передачи ценных бумаг.

116.13. В реквизите заявки «срок или дата передачи ценных бумаг» указывается:

116.13.1. дата (если обязательства по передаче ценных бумаг должны быть исполнены не позднее указанной даты);

116.13.2. количество календарных дней с указанием даты начала их исчисления (если обязательства по передаче ценных бумаг должны быть исполнены в течение определенного срока). Датой начала исчисления срока исполнения обязательств по передаче ценных бумаг может быть дата заключения сделки или дата оплаты ценных бумаг.

116.14. Простой аукцион состоит из периода сбора и периода удовлетворения заявок.

116.15. Торговый агент определяет основные параметры простого аукциона, предусматривающие:

116.15.1. стандартный лот;

116.15.2. шаг цены;

116.15.3. допустимые валюты платежа;

116.15.4. допустимые варианты формирования цен (в белорусских рублях, иностранной валюте или в процентах к номинальной стоимости ценной бумаги);

116.15.5. валюта формирования цены;

116.15.6. курс валюты формирования цены к валюте платежа и (или) порядок его определения;

116.15.7. курс валюты номинальной стоимости к валюте формирования цены и (или) порядок его определения;

116.15.8. вид и направление (простой аукцион по продаже или простой аукцион по покупке ценных бумаг) простого аукциона;

116.15.9. разрешенные виды заявок (рыночные и (или) лимитные);

116.15.10. условия снятия ранее поданных участниками торгов заявок;

116.15.11. допустимый процент рыночных заявок от общего объема (общей суммы) лимитных заявок, поданных участником торгов;

116.15.12. стартовая цена (данный параметр устанавливается только для простого аукциона с объявлением стартовой цены, при этом стартовая цена должна быть кратна шагу цены);

116.15.13. код расчетов;

116.15.14. срок исполнения обязательств для сделок с кодом расчетов S-T+n, сроки или даты оплаты (передачи) ценных бумаг для сделок с кодом расчетов NS;

116.15.15. размер неустойки, штрафа и пени за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств по сделкам с кодом расчетов S-T+n, или NS;

116.15.16. объем продажи, при котором аукцион признается состоявшимся (для простого аукциона на продажу);

116.15.17. объем покупки, при котором аукцион признается состоявшимся (для простого аукциона на покупку);

116.15.18. дата и время доведения биржей до сведения участников торгов параметров простого аукциона;

116.15.19. по согласованию с биржей иные параметры проведения простого аукциона, определяющие порядок допуска участников торгов к простому аукциону, заключения и исполнения сделок, оформления и подписания протоколов о результатах торгов, обеспечения исполнения обязательств по заключенным на простом аукционе сделкам, а также другие особенности проведения аукциона в части, не урегулированной настоящими Правилами и иными локальными правовыми актами биржи.

116.16. Торговый агент представляет на биржу параметры проведения простого аукциона не позднее чем за 2 рабочих дня до предполагаемой даты проведения аукциона. По согласованию с биржей на основании письменного запроса торгового агента указанный срок может быть сокращен.

116.17. Ведущий торгов отказывает торговому агенту в проведении простого аукциона, если определенные торговым агентом параметры простого аукциона не соответствуют требованиям настоящих Правил, Типовых условий обращения, Регламента торгового дня или иных локальных правовых актов биржи.

116.18. В сроки, установленные торговым агентом, параметры простого аукциона доводятся до сведения участников торгов с использованием подсистемы «Почтовые сообщения» торговой системы и размещаются на сайте биржи.

116.19. Для простых аукционов, которые торговый агент планирует проводить на постоянной основе или для которых торговым агентом в соответствии с подпунктом 116.15.19 пункта 116 настоящих Правил установлены дополнительные параметры, требующие специальных разъяснений, биржа по согласованию с торговым агентом вправе разработать Регламент простого аукциона, определяющие особенности его проведения.

116.20. Регламент простого аукциона утверждается решением Правления биржи, согласовывается с торговым агентом или иным лицом, определенным торговым агентом или законодательством. Регламент простого аукциона не

позднее чем за 1 рабочий день до даты проведения аукциона, если торговым агентом не установлено иное, доводится до сведения участников торгов общим извещением и размещается на сайте биржи.

116.21. Торговый агент вправе однократно объявить параметры для серии простых аукционов, которые предполагается проводить на одних и тех же условиях (далее – однотипные простые аукционы). Для серии аукционов дополнительно к параметрам аукционов торговый агент представляет на биржу временные условия их проведения (график проведения серии однотипных простых аукционов). В сроки, установленные торговым агентом, параметры простого аукциона, определяющие условия проведения серии однотипных простых аукционов, и график проведения серии однотипных простых аукционов доводятся до сведения участников торгов с использованием подсистемы «Почтовые сообщения» торговой системы и размещаются на сайте биржи.

116.22. В случае отмены проведения предстоящего аукциона торговый агент не позднее дня, предшествующего дню проведения аукциона, если иной срок не установлен параметрами простого аукциона, направляет в адрес биржи официальное уведомление. Информация об отмене простого аукциона на основании уведомления, представленного торговым агентом, доводится до сведения участников торгов с использованием подсистемы «Почтовые сообщения» торговой системы и размещается на сайте биржи.

116.23. Простой аукцион может быть признан несостоявшимся в следующих случаях:

116.23.1. неподача заявки торговым агентом;

116.23.2. в случаях, предусмотренных законодательством;

116.23.3. в иных случаях, предусмотренных настоящими Правилами или Регламентом простого аукциона;

116.23.4. в случае, если в период сбора подавались заявки от имени различных участников торгов, но все эти заявки были поданы за счет (в интересах) одного и того же клиента (группы клиентов, вверителей фонда);

116.23.5. возникновение технических сбоев и (или) других, предусмотренных главой 9 настоящих Правил, чрезвычайных обстоятельств, препятствующих проведению простого аукциона;

116.23.6. в случае получения биржей предписания республиканского органа государственного управления, осуществляющего государственное регулирование рынка ценных бумаг, делающего невозможным проведение простого аукциона, клиринга и (или) расчетов по заключенным на простом аукционе сделкам;

116.23.7. в случае возникновения иных оснований, делающих невозможным проведение аукционов.

116.24. Решение о признании простого аукциона несостоявшимся, если иное не установлено Регламентом простого аукциона, принимается ведущим торгов и оформляется в порядке, определенном Регламентом простого аукциона.

116.25. Торговый агент имеет право до начала периода сбора уведомить всех трейдеров и ведущего торгов посредством подсистемы «Почтовые

сообщения» торговой системы об объеме продаваемых (покупаемых) ценных бумаг на предстоящем аукционе.

116.26. Простой аукцион может быть признан состоявшимся, если иное не установлено законодательством, параметрами или регламентом простого аукциона, если в торговой системе зарегистрированы:

116.26.1. две и более заявки от одного участника торгов при соблюдении одного из следующих условий:

116.26.1.1. одна из поданных заявок подана за счет данного участника торгов, а другая за счет его клиента или в интересах его клиента (группы клиентов, вверителей фонда);

116.26.1.2. одна из поданных заявок подана за счет одного клиента (в интересах одного клиента (одной группы клиентов, вверителей одного фонда)) участника торгов, а другая за счет другого его клиента (в интересах другого клиента (другой группы клиентов, вверителей другого фонда)) участника торгов;

116.26.2. заявки, поданные двумя или более участниками торгов, за исключением случая, когда заявки всех участников торгов поданы за счет одного и того же клиента (в интересах одного и того же клиента (группы клиентов, вверителей фонда)).

116.27. Установление в качестве разрешенных заявок исключительно рыночных допускается только для простого аукциона с определением единой цены с объявлением стартовой цены.

116.28. Для стандартного простого аукциона с объявлением и без объявления стартовой цены, а также для простого аукциона с определением единой цены без объявления стартовой цены допустимый процент рыночных заявок является обязательным параметром простого аукциона.

116.29. Объем лимитной и рыночной заявки на продажу в лотах равен количеству лотов, указанных в заявке, в штуках ценных бумаг – количеству лотов, указанных в заявке, умноженному на размер лота.

116.30. Объем рыночной заявки на покупку в лотах рассчитывается как целая часть от деления суммы денежных средств в валюте платежа, направляемой на покупку ценных бумаг, на произведение цены в валюте формирования цены, по которой производится расчет объема рыночной заявки, курса валюты формирования цены к валюте платежа и размера одного лота.

116.31. Объем рыночной заявки на покупку в штуках рассчитывается как произведение объема рыночной заявки на покупку в лотах, рассчитанной в порядке, определенном подпунктом 116.30 пункта 116 настоящих Правил, на размер лота.

116.32. Сумма лимитной заявки в валюте платежа равна:

116.32.1. цене в валюте формирования цены, указанной в заявке, умноженной на ее объем и курс валюты формирования цены к валюте платежа (для заявок, цены которых формируются в белорусских рублях или иностранной валюте);

116.32.2. цене, указанной в заявке, умноженной на ее объем, на номинальную стоимость ценной бумаги, деленную на 100 %, умноженную на курс валюты номинальной стоимости к валюте формирования цены и на курс

валюты формирования цены к валюте платежа (для заявок, цена которых формируется в процентах от номинальной стоимости ценной бумаги).

116.33. Сумма рыночной заявки на покупку равна сумме денежных средств в валюте платежа, направляемой на покупку ценных бумаг, указанной в заявке.

116.34. Сумма рыночной заявки на продажу равна объему рыночной заявки на продажу в штуках, умноженному на цену, по которой рассчитывается сумма рыночной заявки.

116.35. Допустимые валюты платежа, курсы валюты номинальной стоимости к валютам формирования цены, курсы валюты формирования цены к валютам платежа и (или) порядок их определения устанавливаются параметрами простого аукциона

117. Сбор заявок.

117.1. В период сбора заявок участники торгов имеют право подавать лимитные и (или) рыночные заявки, встречные по отношению к направлению простого аукциона. При этом встречными по отношению к простому аукциону на покупку являются заявки на продажу, к аукциону на продажу – заявки на покупку ценных бумаг.

117.2. Реквизиты заявки должны соответствовать параметрам простого аукциона, установленным торговым агентом. Заявки, в которых указаны реквизиты, не соответствующие определенным торговым агентом параметрам, автоматически отклоняются торговой системой и возвращаются трейдеру для корректировки.

117.3. Ввод участником торгов заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов SCCP-T0 и S-T0 возможен только в случае, если сумма заявки не превосходит значения указанной в заявке плановой позиции участника торгов по денежным средствам.

117.4. Ввод участником торгов заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов SCCP-T0 и S-T0 возможен только в случае, если объем заявки не превосходит значения указанной в заявке плановой позиции по ценным бумагам.

117.5. Если значение плановой позиции по денежным средствам (ценным бумагам) меньше суммы (объема) заявки с кодом расчетов SCCP-T0 (S-T0), заявка автоматически отклоняется торговой системой и возвращается трейдеру для корректировки.

117.6. Общая сумма (общий объем) рыночных заявок, поданных участником торгов, не может превышать установленного торговым агентом допустимого процента рыночных заявок.

117.7. Рыночная заявка автоматически отклоняется торговой системой, если ее ввод в торговую систему приведет к нарушению установленного торговым агентом допустимого процента рыночных заявок.

117.8. Лимитная заявка не может быть снята или изменена участником торгов, если в результате ее снятия или изменения будет нарушен установленный торговым агентом допустимый процент рыночных заявок.

117.9. Лимитные заявки на покупку с ценой ниже стартовой цены и лимитные заявки на продажу с ценой выше стартовой не принимаются торговой системой и возвращаются трейдеру для корректировки.

117.10. При проведении простого аукциона по продаже ценных бумаг с объявлением стартовой цены во время сбора заявок, в случае если:

117.10.1. количество заявок на покупку, поданных участниками торгов, недостаточно для признания аукциона состоявшимся или суммарный объем заявок на покупку меньше количества выставленных на аукцион ценных бумаг, торговый агент имеет право уменьшить стартовую цену на величину, кратную шагу цены;

117.10.2. суммарный объем заявок на покупку, поданных участниками торгов, превышает количество выставленных на аукцион ценных бумаг, торговый агент имеет право увеличить стартовую цену на величину, кратную шагу цены. Объем рыночных заявок на покупку в целях определения суммарного объема заявок на покупку, поданных участниками торгов, рассчитывается в порядке, установленном под пунктом 116.30 пункта 116 настоящих Правил, при условии, что заданная цена равна стартовой.

117.11. При увеличении стартовой цены лимитные заявки, с ценой ниже вновь установленной, автоматически снимаются торговой системой. Если автоматическое снятие лимитных заявок приводит к нарушению установленного торговым агентом допустимого процента рыночных заявок, последние автоматически снимаются торговой системой в последовательности, обратной их подачи.

117.12. При проведении аукциона по покупке ценных бумаг с объявлением стартовой цены во время сбора заявок, в случае если:

117.12.1. количество заявок на продажу, поданных участниками торгов, недостаточно для признания аукциона состоявшимся или суммарный объем заявок на продажу меньше количества заявленных торговым агентом на покупку ценных бумаг, торговый агент имеет право увеличить стартовую цену на величину, кратную шагу цены;

117.12.2. суммарный объем заявок на продажу, поданных участниками торгов, превышает количество заявленных торговым агентом на покупку ценных бумаг, торговый агент имеет право уменьшить стартовую цену на величину, кратную шагу цены.

117.13. При уменьшении стартовой цены лимитные заявки с ценой, выше вновь установленной, автоматически снимаются торговой системой. Если автоматическое снятие лимитных заявок приводит к нарушению установленного торговым агентом допустимого процента рыночных заявок, последние автоматически снимаются торговой системой в последовательности, обратной их подачи.

117.14. В период сбора заявок при проведении простого аукциона, если иное не установлено параметрами простого аукциона или регламентом простого аукциона, трейдер имеет право снять или изменить реквизиты ранее введенной заявки.

117.15. По окончании периода сбора заявок в торговой системе прекращаются прием, снятие и изменение реквизитов заявок и формируется сводный электронный реестр поступивших заявок.

118. Удовлетворение заявок.

118.1. В период удовлетворения заявок торговый агент вводит в торговую систему лимитную заявку на покупку или продажу ценных бумаг в соответствии с направлением аукциона.

118.2. Лимитная заявка на покупку, поданная торговым агентом, означает предложение торгового агента участникам торгов, если заявка подается на заключение сделки с кодом расчетов S-T0, S-T+n, NS, или центральному контрагенту, если заявка подается на заключение сделки с кодом расчетов SCCP-T0 купить ценные бумаги по цене, указанной в лимитной заявке торгового агента (при проведении простого аукциона с определением единой цены с объявлением и без объявления стартовой цены), или по ценам, определяемым согласно подпункту 118.9 пункта 118 настоящих Правил (при проведении стандартного простого аукциона с объявлением и без объявления стартовой цены).

118.3. Удовлетворение заявки на покупку (продажу), поданной участником торгов на заключение сделки с кодом расчетов SCCP-T0 происходит только при наличии в торговой системе лимитной заявки, поданной торговым агентом на заключение сделки с кодом расчетов SCCP-T0 с ценой выше (ниже) цены, указанной в заявке участника торгов. Удовлетворение лимитной заявки на покупку (продажу), поданной торговым агентом на заключение сделки с кодом расчетов SCCP-T0, происходит только при наличии в торговой системе заявок на продажу (покупку), поданных участниками торгов на заключение сделок с кодом расчетов SCCP-T0, с ценой ниже (выше) цены, указанной в лимитной заявке торгового агента.

118.4. Заявки на покупку ценных бумаг, поданные участниками торгов во время сбора заявок, удовлетворяются в следующем порядке: сначала удовлетворяются лимитные заявки на покупку с ценой, равной или выше цены, указанной в лимитной заявке на продажу, поданной торговым агентом (независимо от времени подачи первыми удовлетворяются лимитные заявки на покупку с большими ценами, при равенстве цен первыми удовлетворяются лимитные заявки на покупку, поданные ранее по времени), затем удовлетворяются рыночные заявки на покупку (первыми удовлетворяются рыночные заявки на покупку, поданные ранее по времени).

118.5. Заявки на продажу ценных бумаг, поданные участниками торгов во время сбора заявок, удовлетворяются в следующем порядке: сначала удовлетворяются лимитные заявки на продажу с ценой, равной или ниже цены, указанной в лимитной заявке на покупку, поданной торговым агентом (независимо от времени подачи первыми удовлетворяются лимитные заявки на продажу с меньшими ценами, при равенстве цен первыми удовлетворяются лимитные заявки на продажу, поданные ранее по времени), затем удовлетворяются рыночные заявки на продажу (первыми удовлетворяются рыночные заявки, поданные ранее по времени).

118.6. При проведении простого аукциона с определением единой цены без объявления или с объявлением стартовой цены лимитные заявки и рыночные заявки удовлетворяются по цене, указанной в лимитной заявке, поданной торговым агентом.

118.7. Если ни одна из лимитных заявок участников торгов, поданных в торговую систему при проведении простого аукциона с определением единой цены без объявления стартовой цены, не может быть удовлетворена полностью или частично, простой аукцион признается несостоявшимся.

118.8. Если ни одна из лимитных заявок участников торгов, поданных в торговую систему при проведении простого аукциона с определением единой цены с объявлением стартовой цены, не может быть удовлетворена полностью или частично, а в лимитной заявке на покупку (продажу), поданной торговым агентом, указана цена меньше (больше) последней, объявленной им стартовой цены, простой аукцион признается несостоявшимся.

118.9. При проведении простого стандартного аукциона без объявления или с объявлением стартовой цены лимитные заявки удовлетворяются по указанным в них ценам, рыночные заявки удовлетворяются по средневзвешенной цене, рассчитанной по итогам удовлетворения лимитных заявок. Средневзвешенная цена рассчитывается путем деления общей суммы всех удовлетворенных лимитных заявок на общее количество ценных бумаг в этих заявках.

118.10. Участники торгов и торговый агент, подавшие заявки на покупку (продажу) ценных бумаг с кодом расчетов SCCP-T0, подлежащих удовлетворению согласно условиям подпунктов 118.4 - 118.6 пункта 118 настоящих Правил, заключают сделки на продажу (покупку) ценных бумаг с центральным контрагентом.

118.11. Участники торгов, подавшие заявки на покупку (продажу) ценных бумаг с кодом расчетов S-T0, S-T+n или NS, подлежащих удовлетворению согласно условиям подпунктов 118.4 - 118.6 пункта 118 настоящих Правил, заключают сделки купли-продажи ценных бумаг с торговым агентом.

118.12. Если ни одна из лимитных заявок участников торгов, поданных в торговую систему при проведении стандартного простого аукциона с объявлением или без объявления стартовой цены, не может быть удовлетворена полностью или частично, простой аукцион признается несостоявшимся.

118.13. Простой аукцион признается несостоявшимся, если объем продажи (покупки) меньше объема, установленного параметрами простого аукциона.

118.14. Трейдер участника торгов во время простого аукциона всегда имеет доступ к следующей информации:

118.14.1. о значениях позиций участника торгов, трейдером которого он является;

118.14.2. о поданных им заявках;

118.14.3. о значении стартовой цены аукциона;

118.14.4. о заключенных участником торгов, трейдером которого он является. сделках.

118.15. Торговый агент имеет право перед проведением аукциона определить перечень дополнительной информации из числа, определенного подпунктом 118.16 пункта 118 настоящих Правил, доступной трейдерам во время простого аукциона.

118.16. Дополнительная информация, доступная трейдерам во время простого аукциона:

118.16.1. о минимальной и максимальной ценах в поданных лимитных заявках;

118.16.2. об общей сумме и общем объеме поданных лимитных заявок;

118.16.3. об общем объеме поданных участниками торгов рыночных заявках на продажу;

118.16.4. об общей сумме поданных участниками торгов рыночных заявках на покупку;

118.16.5. об общей сумме всех поданных заявок на покупку;

118.16.6. об общем объеме всех поданных участниками торгов заявках на продажу;

118.16.7. обо всех поданных участниками торгов заявках.

118.17. Трейдер торгового агента во время простого аукциона всегда имеет доступ к следующей информации:

118.17.1. о значениях позиций торгового агента, трейдером которого он является;

118.17.2. о поданных им заявках;

118.17.3. о значении стартовой цены простого аукциона;

118.17.4. обо всех поданных участниками торгов заявках;

118.17.5. о заключенных торговым агентом, трейдером которого он является сделках.

ГЛАВА 8

УСЛОВИЯ ИСПОЛНЕНИЯ СДЕЛОК С КОДАМИ РАСЧЕТОВ S-T+n, SCCP-T+n, NS, SCCPREPO И SREPO

119. В случае, если после заключения сделки с кодом расчетов S-T+n, SCCP-T+n или РЕПО дата исполнения обязательств по данной сделки объявляется выходным и (или) нерабочим (праздничным) днем, исполнение обязательств производится в ближайший следующий за датой исполнения обязательств рабочий день, при этом перерасчет размера обязательств по оплате ценных бумаг по сделкам с кодом расчетов S-T+n, SCCP-T+n, а также суммы обратного выкупа по сделкам РЕПО не производится.

120. Условия исполнения сделок с кодом расчет S-T+n и SCCP-T+n.

120.1. Расторжение ранее заключенной сделки с кодом расчетов S-T+n или SCCP-T+n по соглашению сторон и внесение изменений в ее условия производятся только через торговую систему до наступления дня ее исполнения или в день ее исполнения в период времени, определенный Регламентом торгового дня.

120.2. Для изменения условий (расторжения) ранее заключенной сделки с кодом расчетов S-T+n по соглашению сторон участник – покупатель и участник-продавец по данной сделки должны подать в торговую систему заявку на изменение условий сделки или заявку на расторжение сделки, соответственно с совпадающими реквизитами.

120.3. Для изменения условий (расторжения) ранее заключенной сделки с кодом расчетов SCCP-T+n по соглашению сторон участник должен подать заявку Центральному контрагенту на изменение условий сделки или заявку на расторжение сделки, соответственно.

120.4. Заявка на изменение условий сделки должна содержать указание на номер сделки и перечень ее условий, подлежащих изменению. Изменению могут подлежать: срок исполнения обязательств по передаче (оплате) ценных бумаг, цена сделки с кодом расчетов S-T+n или SCCP-T+n и (или) другие параметры сделки. Допустимый перечень параметров сделки с кодом расчетов S-T+n или SCCP-T+n, которые могут быть изменены по соглашению сторон, для различных видов ценных бумаг и режимов торгов определяются Типовыми условиями обращения, а также параметрами простого аукциона и (или) Регламентом простого аукциона.

120.5. Изменение срока исполнения обязательств по передаче (оплате) ценных бумаг, цены сделки и (или) валюты платежа производятся с учетом ограничений, установленных в соответствии с подпунктом 68.8 пункта 68 и пунктом 74 настоящих Правил.

120.6. Заявка на расторжение сделки с кодом расчет S-T+n и SCCP-T+n должна содержать указание только на номер расторгаемой сделки.

120.7. Изменение условий (расторжение) сделки с кодом расчетов S-T+n происходит при подачи контрагентом по сделки в торговую систему заявки на изменение условий (расторжение) сделки значения реквизитов которой совпадают со значениями реквизитов ранее поданной заявке.

120.8. Изменение условий (расторжение) сделки с кодом расчетов SCCP-T+n происходит при удовлетворении Центральным контрагентом поданной участником заявки на изменение условий (расторжение) сделки. Центральный контрагент удовлетворяет заявку на изменение условий (расторжение) сделки только при регистрации торговой системой заявки на изменение условий (расторжение) второй сделки входящей в связанную пару сделок со сделкой подлежащей изменению (расторжению), значения реквизитов которой совпадает со значениями реквизитов ранее поданной заявки.

120.9. При изменении условий (расторжении) сделки с кодом расчетов S-T+n и SCCP-T+n вносятся соответствующие изменения в единый учетный электронный реестр сделок, и оформляется дополнение и изменение к протоколу о результатах торгов, порядок оформления и подписания которого определяется Положением о документообороте или Регламентом простого аукциона, а также Положением об электронном документообороте.

120.10. В день исполнения обязательств по ранее заключенным сделкам с кодом расчетов S-T+n или SCCP-T+n в определенное Регламентом торгового дня время торговая система формирует для каждого участника торгов электронный реестр сделок с кодом расчетов S-T+n или SCCP-T+n, подлежащих исполнению.

120.11. В день исполнения обязательств по сделкам с кодом расчетов S-T+n или SCCP-T+n ко времени, определенному Регламентом торгового дня участник торгов обязан обеспечить наличие:

денежных средств на счете (разделе счета), соответствующем позиции по денежным средствам, в счет которой была заключена сделка и формирование ее планового значения в сумме, достаточной для исполнения обязательств по каждой сделке с кодом расчетов S-T+n или SCCP-T+n;

ценных бумаг на счете (разделе счета) «депо», соответствующем позиции по ценным бумагам, в счет которой была заключена сделка и формирование ее планового значения в количестве, достаточном для исполнения обязательств по каждой сделке с кодом расчетов S-T+n или SCCP-T+n.

120.12. В установленное Регламентом торгового дня время торговая система в соответствии с электронным реестром сделок производит расчет новых значений позиций участника торгов, в счет которых была заключена сделка, изменяя их значения в соответствии с обязательствами участников торгов по передаче ценных бумаг (оплате ценных бумаг).

120.13. В случае невозможности исполнения обязательства по передаче (оплате) ценных бумаг, вытекающего из ранее заключенной за счет (в интересах) клиента участника торгов сделки с кодом расчетов S-T+n или SCCP-T+n, с использованием позиции по ценным бумагам (денежным средствам), в счет которой она была заключена (по причине неисполнения участником торгов требований подпункта 120.11 пункта 120 настоящих Правил или отстранения участника торгов от исполнения сделки за счет клиента), исполнение производится с использованием позиции участника торгов по ценным бумагам (денежным средствам), предназначенной для учета ценных бумаг (денежных средств), принадлежащих участнику торгов.

120.14. В случае использования ценных бумаг (денежных средств) участника торгов для исполнения обязательств по передаче (оплате) ценных бумаг, вытекающих из ранее заключенных за счет (в интересах) клиента участника торгов сделок с кодом расчетов S-T+n или SCCP-T+n, оформляется учетная ведомость использования ценных бумаг (денежных средств) участника торгов для исполнения обязательств по сделкам, заключенным за счет клиента, порядок оформления и подписания которой определяется Положением о документообороте или Регламентом простого аукциона, а также Положением об электронном документообороте.

120.15. В случае невозможности исполнения обязательств участника торгов по сделке с кодом расчетов S-T+n или SCCP-T+n по причине нарушений им требований подпункта 120.11 пункта 120 настоящих Правил или отстранения его от исполнения сделки, сделка расторгается, вносятся соответствующие изменения в единый учетный электронный реестр сделок, и оформляется уведомление о ее расторжении, порядок оформления и подписания которого определяется Положением о документообороте или Регламентом простого аукциона, а так же Положением об электронном документообороте.

120.16. Если сделка с кодом расчет S-T+n была расторгнута по вине одной из сторон (нарушение участником-покупателем или участником-продавцом требований подпункта 120.11 пункта 120 настоящих Правил или отстранения

участника-покупателя или участника-продавца от исполнения сделки), виновная сторона обязана уплатить пострадавшей стороне неустойку.

120.17. Если сделка с кодом расчет S-T+n или SCCP-T+n была расторгнута по вине обеих сторон, участник-покупатель и участник-продавец освобождаются от уплаты неустойки.

120.18. Размер неустойки, которую обязан уплатить участник торгов в соответствии с подпунктом 120.16 пункта 120 настоящих Правил, для сделок, заключенных в режимах «дискретный аукцион» и «форвардные сделки», и порядок ее уплаты устанавливаются Правлением биржи или одним из участников торгов, инициирующим открытие режима дискретный аукцион в порядке, определенном Типовыми условиями обращения, заключенных в режиме «простой аукцион» – торговым агентом. Размер неустойки и порядок ее уплаты фиксируются в протоколе о результатах торгов.

120.19. Обязательства Центрального контрагента по оплате неустойки участнику торгов прекращаются полностью или частично зачетом встречных однородных требований Центрального контрагента к этому участнику торгов по оплате неустойки, срок исполнения по которым наступил. Зачет обязательств и требований Центрального контрагента по оплате неустойки производится на основании заявления Центрального контрагента, порядок оформления и подписания которого определяется Положением о документообороте или Регламентом простого аукциона, а также Положением об электронном документообороте.

121. Условия исполнения сделок с кодом расчетов NS.

121.1. Расторжение ранее заключенной сделки с кодом расчетов NS по соглашению сторон и внесение изменений в ее условия производятся только через торговую систему до момента исполнения обязательств по оплате или передаче ценных бумаг в период времени, установленный Регламентом торгового дня.

121.2. Для изменения условий ранее заключенной сделки с кодом расчетов NS или ее расторжения по соглашению сторон продавец и покупатель должны подать в торговую систему заявку на изменение условий сделки или заявку на расторжение сделки, соответственно.

121.3. Заявка на изменение условий сделки должна содержать указание на номер сделки и перечень ее условий, подлежащих изменению.

121.4. Изменению могут подлежать следующие условия сделки:

121.4.1. срок или дата оплаты ценных бумаг;

121.4.2. срок или дата передачи ценных бумаг;

121.4.3. цена сделки;

121.4.4. валюта платежа.

121.5. Перечень параметров сделки с кодом расчетов NS, которые могут быть изменены по соглашению сторон, для различных видов ценных бумаг и режимов торгов определяются Типовыми условиями обращения, а также параметрами простого аукциона и (или) Регламентом простого аукциона.

121.6. Изменение срока и (или) даты оплаты (передачи) ценных бумаг, валюты платежа производится с учетом ограничений, установленных в соответствии с пунктом 80 настоящих Правил.

121.7. Заявка на расторжение сделки с кодом расчетов NS должна содержать указание только на номер расторгаемой сделки.

121.8. Изменение условий (расторжение) сделки с кодом расчетов NS в торговой системе происходит при регистрации торговой системой заявок на изменение условий (расторжение), поданных продавцом и покупателем по сделке. При изменении условий или расторжении сделки с кодом расчетов NS вносятся соответствующие изменения в единый учетный электронный реестр сделок, и оформляется дополнение и изменение к протоколу о результатах торгов, порядок оформления и подписания которого определяется Положением о документообороте или Регламентом простого аукциона, а также Положением об электронном документообороте.

121.9. Расчеты по сделкам с кодом расчетов NS продавец и покупатель проводят самостоятельно в согласованном сторонами сделки и непротиворечащем законодательству порядке, а также в сроки, установленные участниками торгов в момент заключения сделки.

121.10. В случае неисполнения или ненадлежащего исполнения одной из сторон по сделке своих обязательств по передаче (оплате) ценных бумаг, виновная сторона обязана уплатить другой стороне пеню, исчисляемую в процентах от суммы сделки за каждый календарный день просрочки.

121.11. В случае неисполнения или ненадлежащего исполнения одной из сторон по сделке с кодом расчетов NS своих обязательств по передаче (оплате) ценных бумаг в течение 10 календарных дней со дня, когда соответствующее обязательство должно было быть исполнено, другая сторона вправе в одностороннем порядке расторгнуть сделку.

121.12. В случае расторжения сделки на основании подпункта 121.11 пункта 121 настоящих Правил виновная сторона обязана выплатить пострадавшей стороне штраф в размере, исчисляемом в процентах от суммы сделки. Штраф, подлежащий выплате в соответствии с настоящим пунктом, выплачивается дополнительно к пене, установленной подпунктом 121.10 пункта 121 настоящих Правил.

121.13. Убытки взыскиваются в полном объеме сверх неустойки.

121.14. Размер пени и штрафа, подлежащие уплате в соответствии с подпунктами 121.10 и 121.11 пункта 121 настоящих Правил для сделок, заключенных в режиме «форвардные сделки», и порядок их уплаты устанавливаются Правлением биржи или одним из участников торгов, иницирующим открытие режима «форвардные сделки» в порядке, определенном Типовыми условиями обращения, заключенных в режиме «простой аукцион» – торговым агентом. Размер пени и штрафа и порядок их уплаты фиксируются в протоколе о результатах торгов.

121.15. Сторона, расторгающая сделку по основаниям, предусмотренным подпунктом 121.11 пункта 121 настоящих Правил, направляет другой стороне и представляет на биржу уведомление о расторжении сделки. Уведомление о

расторжении сделки обязательно должно содержать дату его отправления и данные, позволяющие однозначно идентифицировать сделку (номер сделки, номер протокола и условия сделки.).

121.16. Уведомление о расторжении сделки нарушившей свои обязательства стороны является основанием для прекращения обязательств по заключенной сделке, за исключением обязательств по выплате неустойки, возмещению убытков, возврату переданного имущества.

122. Условия исполнения второй части сделки РЕПО.

122.1. Расторжение второй части сделки РЕПО по соглашению сторон и внесение изменений в ее условия производятся только через торговую систему до дня исполнения обязательств по второй части сделки или в день их исполнения в период времени, определенный Регламентом торгового дня.

122.2. Возможность расторжения, ограничения на расторжение, параметры и условия расторжения второй части сделки РЕПО по соглашению сторон устанавливаются Типовыми условиями обращения.

122.3. Для изменения условий второй части сделки с кодом расчетов SREPO или ее расторжения по соглашению сторон продавец и покупатель должны подать в торговую систему заявку на изменение условий сделки или заявку на расторжение сделки, соответственно.

122.4. Для изменения условий (расторжения) ранее заключенной сделки с кодом расчетов SCCPREPO по соглашению сторон участник должен подать заявку Центральному контрагенту на изменение условий сделки или заявку на расторжение сделки, соответственно.

122.5. Заявка на изменение условий сделки РЕПО должна содержать указание на номер сделки и перечень ее условий, подлежащих изменению.

122.6. Изменению могут подлежать следующие условия: срок РЕПО, ставка РЕПО, валюта платежа, способ возмещения промежуточных платежей по сделке РЕПО. Перечень параметров сделки РЕПО, которые могут быть изменены по соглашению сторон, для различных видов ценных бумаг определяется Типовыми условиями обращения.

122.7. Срок РЕПО, указанный в заявке на изменение условий сделки РЕПО, исчисляется от дня ее заключения.

122.8. Изменение срока РЕПО и (или) ставки РЕПО производится с учетом ограничений, установленных в соответствии с пунктами 102 и 107 настоящих Правил.

122.9. При изменении параметров сделки РЕПО по соглашению сторон, цена второй части сделки и сумма обязательств по сделке РЕПО рассчитываются исходя из новых значений ставки РЕПО, валюты платежа, срока РЕПО и (или) способа возмещения промежуточных платежей по сделке РЕПО.

122.10. Заявка на расторжение второй части сделки РЕПО должна содержать указание только на номер расторгаемой сделки.

122.11. Изменение условий (расторжение) второй части сделки с кодом расчетов SREPO в торговой системе происходит при регистрации торговой системой заявок на изменение условий (расторжение), поданных продавцом и покупателем по сделке.

122.12. Изменение условий (расторжение) сделки с кодом расчетов SCCPREPO происходит при удовлетворении Центральным контрагентом поданной участником заявки на изменение условий (расторжение) сделки. Центральный контрагент удовлетворяет заявку на изменение условий (расторжение) сделки только при условии регистрации в торговой системе заявки на изменение условий (расторжение) второй сделки с кодом расчетов SCCPREPO входящей в связанную пару сделок со сделкой подлежащей изменению (расторжению), значение реквизитов которой совпадает со значениями реквизитов ранее поданной заявкой.

122.13. При изменении условий (расторжении) второй части сделки с кодом расчетов РЕПО вносятся соответствующие изменения в единый учетный электронный реестр сделок и оформляется дополнение и изменение к протоколу о результатах торгов, порядок оформления и подписания которого определяется Положением о документообороте и Положением об электронном документообороте.

122.14. В день исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО в определенное Регламентом торгового дня время торговая система формирует для каждого участника торгов электронный реестр сделок РЕПО, подлежащих исполнению.

122.15. В день исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО ко времени, определенному Регламентом торгового дня, участник торгов обязан обеспечить наличие:

денежных средств на счете (разделе счета) соответствующем позиции по денежным средствам, в счет которой была заключена сделка и формирование ее планового значения в сумме достаточной для исполнения обязательств по второй части каждой сделке РЕПО;

ценных бумаг на счете (разделе счета) «депо», соответствующем позиции по ценным бумагам, в счет которой была заключена сделка, и формирование ее планового значения в количестве, достаточном для исполнения обязательств по второй части каждой сделки РЕПО.

122.16. В установленное Регламентом торгового дня время торговая система в соответствии с электронным реестром сделок производит расчет новых значений позиций участника торгов, в счет которых была заключена сделка, изменяя их значения в соответствии с обязательствами участников торгов по второй части сделки РЕПО.

122.17. В случае невозможности исполнения обязательства по передаче (оплате) ценных бумаг, вытекающего из ранее заключенной за счет (в интересах) клиента участника торгов сделки РЕПО, с использованием позиции по ценным бумагам (денежным средствам), в счет которой она была заключена (по причине неисполнения участником торгов требований подпункта 122.15 пункта 122 настоящих Правил или отстранения участника торгов от исполнения сделки за счет клиента) исполнение производится с использованием позиции участника торгов по ценным бумагам (денежным средствам), предназначенной для учета ценных бумаг (денежных средств), принадлежащих участнику торгов.

122.18. В случае использования ценных бумаг (денежных средств) участника торгов для исполнения обязательств по передаче (оплате) ценных бумаг, вытекающих из ранее заключенных за счет (в интересах) клиента участника торгов сделок РЕПО, оформляется учетная ведомость использования ценных бумаг (денежных средств) участника торгов для исполнения обязательств по сделкам, заключенным за счет клиента, порядок оформления и подписания которых определяется Положением о документообороте и Положением об электронном документообороте.

122.19. При невозможности исполнения обязательств участника торгов по второй части сделки РЕПО по причине нарушения им требований подпункта 122.15 пункта 122 настоящих Правил или отстранения его от исполнения сделки, за исключением случая, определенного подпунктом 122.17 пункта 122 настоящих Правил, вторая часть сделки РЕПО расторгается, вносятся соответствующие изменения в единый учетный электронный реестр сделок, и оформляется уведомление о ее расторжении, порядок оформления и подписания которого определяется Положением о документообороте и Положением об электронном документообороте.

122.20. Если вторая часть сделки с кодом расчетов РЕПО была расторгнута по вине одной из сторон (нарушение участником-покупателем по второй части сделки или участником-продавцом по второй части сделки требований подпункта 122.15 пункта 122 настоящих Правил или отстранения участника-покупателя, или участника-продавца от исполнения сделки), виновная сторона обязана уплатить пострадавшей стороне неустойку. Размер неустойки, которую обязан уплатить участник торгов в соответствии с настоящим пунктом, и порядок ее уплаты устанавливаются Правлением биржи для сделок, совершенных в режиме «РЕПО». Размер неустойки и порядок ее уплаты фиксируются в протоколе о результатах торгов в соответствии с Положением о документообороте.

122.21. Обязательства Центрального контрагента по оплате неустойки участнику торгов прекращаются полностью или частично зачетом встречных однородных требований Центрального контрагента к этому участнику торгов по оплате неустойки, срок исполнения по которым наступил. Зачет обязательств и требований Центрального контрагента по оплате неустойки производится на основании заявления Центрального контрагента, порядок оформления и подписания которого определяется Положением о документообороте или Регламентом простого аукциона, а так же Положением об электронном документообороте.

122.22. В случае расторжения второй части сделки с кодом расчетов SREPO по вине обеих сторон, если иное не установлено Типовыми условиями обращения, участник-покупатель и участник-продавец обязаны уплатить штраф в пользу биржи. Размер штрафа, который обязаны уплатить участник-продавец и участник-покупатель в соответствии с настоящим подпунктом, и порядок его уплаты устанавливаются Правлением биржи. Размер штрафа и порядок его уплаты фиксируются в протоколе о результатах торгов в соответствии с Положением о документообороте.

ГЛАВА 9 ЧРЕЗВЫЧАЙНЫЕ ОБСТОЯТЕЛЬСТВА

123. Под чрезвычайными обстоятельствами понимаются обстоятельства, которые нарушили, нарушают или могут нарушить нормальное функционирование торговой системы биржи.

124. Чрезвычайными признаются следующие обстоятельства:

124.1. принятие (издание) нормативных правовых актов, принятие (издание, опубликование, рассылка) иных актов, распоряжений, инструкций (указаний, заявлений, писем, телеграмм) государственных органов Республики Беларусь, в том числе Министерства финансов, Национального банка, а также иные действия, которые прямо или косвенно делают (могут сделать) невозможным (могут значительно затруднить) дальнейшее проведение торгов и (или) расчетов по совокупности или конкретному выпуску ценных бумаг и (или) участие в торгах более половины участников торгов;

124.2. обстоятельства, предусмотренные статьей 3 Закона Республики Беларусь от 24 июня 2002 года № 117-З «О чрезвычайном положении»;

124.3. неработоспособность, сбои и ошибки программного обеспечения, вычислительной техники, оргтехники, средств связи, включая средства телекоммуникаций;

124.4. нестабильность или отключение электроэнергии, которое не может быть нейтрализовано имеющимися в распоряжении биржи техническими средствами;

124.5. любые события и (или) обстоятельства, которые создали, создают или могут создать угрозу жизни или здоровью сотрудников биржи и (или) трейдеров;

124.6. иные события и (или) обстоятельства, которые прямо или косвенно делают (могут сделать) невозможным (могут значительно затруднить) дальнейшее проведение торгов и (или) расчетов по совокупности или конкретному выпуску ценных бумаг и (или) участие в торгах более половины участников торгов.

125. В случае наступления чрезвычайных обстоятельств ведущий торгов имеет право приостановить технический доступ отдельных участников торгов к торговой системе, задержать начало торгов, приостановить торги на срок до 60 минут, а также продлить торги на срок до 20 минут для проведения необходимых согласований с Председателем Правления биржи.

126. Дальнейший порядок действий по урегулированию чрезвычайных обстоятельств определяет Председатель Правления биржи. Ведущий торгов оповещает участников торгов с использованием доступных ему в данной ситуации средств о возникновении чрезвычайных обстоятельств и о предпринимаемых в связи с этим действиях.

127. Действия, предпринимаемые биржей по урегулированию чрезвычайных обстоятельств, могут предусматривать:

127.1. задержку начала или приостановление торгов;

127.2. приостановление или прекращение технического доступа отдельных участников торгов к торговой системе;

127.3. отмену результатов торгов по всем или некоторым ценным бумагам (полностью, в отдельных режимах торгов и (или) частично по сделкам с определенным кодом расчетов или сформированному перечню сделок);

127.4. изменение способа и (или) срока проведения клиринга и (или) расчетов (исполнения обязательств) по всем или некоторым ценным бумагам;

127.5. досрочное окончание или продление торгов;

127.6. осуществление иных действий в случае необходимости.

127.7. Решения биржи по урегулированию чрезвычайных обстоятельств являются обязательными для исполнения всеми участниками торгов.

128. При отмене результатов торгов (частично или полностью) торги (частично или полностью) признаются недействительными, сделки незаключенными, заявки неподанными.

129. В случае приостановления торгов, по решению ведущего торгов или по требованию участников торгов может быть организована сверка результатов торгов. Для проведения сверки распечатывается единый учетный электронный реестр заявок и сделок, заключенных до приостановления торгов. При выявлении по результатам сверки ошибочных заявок и сделок Председатель Правления биржи имеет право принять решение об отмене результатов торгов по всем или некоторым ценным бумагам (полностью, в отдельных режимах и (или) частично по сделкам с определенным кодом расчетов или сформированному перечню сделок).

130. В случае приостановления торгов трейдер вправе обратиться к ведущему торгов с просьбой снять указанные им неудовлетворенные заявки, ранее введенные им в торговую систему. При наличии технической возможности ведущий торгов обязан снять указанные в обращении трейдера неудовлетворенные заявки, ранее введенные им в торговую систему.

131. Все неудовлетворенные заявки, находящиеся в торговой системе на момент приостановления торгов, сохраняются в торговой системе после их возобновления, если иное не предусмотрено Регламентом торгового дня или они не были сняты ведущим торгов по основаниям, предусмотренным пунктом 130 настоящих Правил.

132. В случае досрочного окончания торгов расчеты и оформление итоговых документов по заключенным до момента их окончания сделкам, осуществляются в общем порядке.

ГЛАВА 10 ТЕХНИЧЕСКИЕ СБОИ АРМ - УЧАСТНИКА ТОРГОВ

133. В случае технических сбоев АРМ - участника торгов все заявки, поданные его трейдером в торговую систему, сохраняются. В случае возможности устранения технического сбоя трейдер устраняет его и повторно входит в торговую систему.

134. В случае невозможности устранения технического сбоя трейдер обязан незамедлительно сообщить о техническом сбое ведущему торгов. Ведущий торгов по требованию трейдера обязан приостановить его технический доступ к торговой системе и снять указанные им неудовлетворенные заявки, ранее введенные в торговую систему. После этого участие трейдера в торгах прекращается. Распечатывается справка о техническом сбое, порядок оформления и подписания которой определяется Положением о документообороте. Расчеты и оформление итоговых документов по сделкам, заключенным на основе заявок, введенных трейдером до момента прекращения его участия в торгах и не снятых ведущим торгов, осуществляются в общем порядке.

ГЛАВА 11 БИРЖЕВЫЕ СБОРЫ

135. При заключении сделки в торговой системе, расторжении и изменении условий сделки по соглашению сторон биржа взимает с продавца и (или) покупателя биржевой сбор.

136. При несоблюдении участником торгов порядка и (или) размера оплаты суммы биржевого сбора участник торгов обязан уплатить бирже неустойку.

137. Решение об установлении размера биржевого сбора и неустойки, порядка их уплаты, их изменение принимаются Правлением биржи, доводятся до сведения участников торгов в письменной форме не позднее пяти рабочих дней после принятия соответствующего решения.

138. Размер неустойки, порядок ее уплаты фиксируется в договоре, заключаемом между участником торгов и биржей.

139. Сумма биржевого сбора фиксируется в протоколах о результатах торгов.

ГЛАВА 12 РАСКРЫТИЕ БИРЖЕВОЙ ИНФОРМАЦИИ

140. В официальных информационных сообщениях биржи, а также в средствах массовой информации могут подлежать раскрытию следующие сведения о торгах ценными бумагами:

140.1. статистические характеристики заявок;

140.2. суммарный объем торгов ценными бумагами, в денежном выражении (штуках);

140.3. объем торгов по каждой ценной бумаге, в денежном выражении (штуках);

140.4. общее количество сделок, заключенных на торгах;

140.5. количество сделок по каждой ценной бумаге;

140.6. количество участников торгов;

140.7. ценовые показатели ценных бумаг (котировки ценных бумаг, цены открытия, закрытия, текущие, рыночные и др.);

140.8. показатели доходности ценных бумаг;

140.9. рыночная цена ценной бумаги;

140.10. биржевые индексы;

140.11. рейтинги участников торгов.

141. Кроме сведений, определенных пунктом 140 настоящих Правил, биржа размещает на сайте биржи информацию о неисполнении участниками обязательств по передаче (оплате) ценных бумаг по сделкам с кодами расчетов S-T+n, SCCP-T+n, и сделкам РЕПО, а также информацию о применении к участникам торгов мер за нарушение требований Условий допуска к торгам и (или) иных локальных правовых актов биржи.

142. Котировка ценной бумаги – цена, указанная в заявке на покупку (продажу) ценной бумаги.

143. Цене открытия соответствует цена первой сделки с кодом расчетов S-T0, SCCP-T0 заключенной в ходе текущего торгового дня, текущей цене – средневзвешенная цена, рассчитанная по итогам сделок с кодом расчетов S-T0, SCCP-T0 заключенных в ходе текущего торгового дня в режимах «дискретный аукцион» и «непрерывный двойной аукцион», цене закрытия – текущая цена, рассчитанная на момент завершения торгов.

144. Расчет рыночной цены ценной бумаги осуществляется в порядке, установленном законодательством. Расчет биржевых индексов и определение рейтингов участников торгов осуществляется в порядке, установленном локальными правовыми актами биржи.

145. Вся информация, связанная с ходом и итогами проведения торгов, является собственностью биржи.

ГЛАВА 13 МЕРЫ ОТВЕТСТВЕННОСТИ

146. Биржа несет ответственность за:

146.1. нарушение законодательства;

146.2. нарушение настоящих Правил и других локальных правовых актов биржи;

146.3. неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств по договорам, заключенным с участниками торгов;

146.4. разглашение конфиденциальной информации.

147. Биржа несет ответственность в порядке, установленном законодательством, и договорами, заключенными с участниками торгов.

148. Участники торгов несут ответственность за:

148.1. нарушение настоящих Правил, Условий допуска, Регламента торгового дня, Типовых условий обращения, Положения о документообороте, Регламента простого аукциона, других локальных правовых актов биржи;

148.2. нарушение условий конфиденциальности при работе с системой аутентификации и идентификации и с СЭД;

148.3. неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств, вытекающих из заключенных на бирже сделок;

148.4. неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств по договорам, заключенным с биржей.

149. К участникам торгов, допустившим нарушение настоящих Правил, могут быть приняты следующие меры ответственности:

149.1. предупреждение;

149.2. отстранение от участия в торгах ценными бумагами (в целом или по режимам торгов);

149.3. запрет на заключение сделок с определенными кодами расчетов;

149.4. уплата неустойки (штрафа, пени) за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств по сделкам с кодами расчетов S-T+n, СССР-T+n, NS и по сделкам РЕПО;

149.5. прекращение допуска к торгам ценными бумагами;

149.6. другие меры ответственности, предусмотренные локальными правовыми актами биржи и (или) заключенными с биржей договорами.

150. Решение о вынесении предупреждения или об отстранении от участия в торгах на срок до одного торгового дня принимает ведущий торгов.

151. Решение об отстранении от участия в торгах ценными бумагами (в целом или по режимам), запрете на заключение сделок с определенными кодами расчетов принимает Председатель Правления биржи или иное уполномоченное им лицо.

152. При неоднократном (более двух раз в течение полугода) нарушении настоящих Правил допуск участника торгов, допустившего нарушения настоящих Правил, к торгам ценными бумагами может быть прекращен по решению Председателя Правления биржи.

Управление развития и планирования бизнеса

Настоящие Правила вступают в силу с 31.01.2022.