

ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(БАНК РОССИИ)

Методические рекомендации
о критериях существенного отклонения цены, спроса и предложения
неликвидных ценных бумаг

11.03.2019

№

8-МР

1. Настоящие Методические рекомендации разработаны в соответствии с частью 2 статьи 5 и пунктом 11 части 1 статьи 14 Федерального закона от 27.07.2010 № 224-ФЗ «О противодействии неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком и о внесении изменений в отдельные законодательные акты Российской Федерации» (далее – Федеральный закон) и предназначены для использования организатором торговли, на торгах которого совершаются операции (сделки) с неликвидными ценными бумагами (далее – организатор торговли).

Под неликвидными ценными бумагами для целей настоящих Методических рекомендаций понимаются все ценные бумаги, допущенные к торгам организатора торговли, за исключением ликвидных ценных бумаг, определяемых на основании пункта 5 Методических рекомендаций по установлению критериев существенного отклонения цены ликвидных ценных бумаг, утвержденных Приказом ФСФР России от 19.05.2011 № 11-21/пз-н «Об утверждении Методических рекомендаций по установлению критериев существенного отклонения цены ликвидных ценных бумаг», и низколиквидных ценных бумаг, определяемых на основании пункта 5 Методических рекомендаций по установлению критериев существенного отклонения цены низколиквидных ценных бумаг, утвержденных Приказом ФСФР России от 30.08.2011 № 11-38/пз-н «Об утверждении Методических

рекомендаций по установлению критериев существенного отклонения цены низколиквидных ценных бумаг».

2. Организатору торговли рекомендуется устанавливать во внутренних документах критерии существенного отклонения цены, спроса и предложения неликвидных ценных бумаг (далее – критерии существенного отклонения). Информацию об установленных критериях существенного отклонения рекомендуется направлять в созданный при Банке России Экспертный совет по существенным рыночным отклонениям (далее – Экспертный совет).

3. В случае если по критериям нестандартных сделок, предусмотренным пунктом 1.19 Положения Банка России от 17.10.2014 № 437-П «О деятельности по проведению организованных торгов» (далее – Положение № 437-П) или определенным организатором торговли на основании пункта 1.21 Положения № 437-П, или по сочетаниям указанных критериев организатором торговли выявлена нестандартная сделка с неликвидной ценной бумагой, и (или) в случае получения организатором торговли в соответствии с частью 1 статьи 16 Федерального закона требования (запроса) Банка России о предоставлении информации о существенном отклонении цены и (или) спроса, и (или) предложения неликвидной ценной бумаги, организатору торговли рекомендуется обращаться в Экспертный совет для определения, привели ли выявленные организатором торговли или указанные в требовании (запросе) Банка России сделки (заявки на совершение сделок) с неликвидной ценной бумагой к существенному отклонению цены, и (или) спроса, и (или) предложения такой неликвидной ценной бумаги от уровня, который сформировался бы без этих сделок (заявок), либо к поддержанию цены, и (или) спроса, и (или) предложения такой неликвидной ценной бумаги на уровне, существенно отличающемся от того уровня, который сформировался бы без таких сделок (заявок).

При обращении в Экспертный совет организатору торговли рекомендуется направлять в Экспертный совет информацию о торгах неликвидной ценной бумагой в рассматриваемый Экспертным советом торговый день и во все предыдущие торговые дни в течение периода

совершения сделок с указанной неликвидной ценной бумагой, продолжительность которого в каждом случае рекомендуется определять по решению организатора торговли, а в случае поступления требования (запроса) Банка России – на основании периода, указанного в этом требовании (запросе).

4. В целях выполнения рекомендаций, предусмотренных в пункте 3 настоящих Методических рекомендаций, организатору торговли рекомендуется направлять в Экспертный совет на бумажном носителе с одновременным направлением на электронном носителе обращение с приложением выписки из реестра договоров, заключенных на организованных торгах, содержащей информацию о сделках с неликвидной ценной бумагой, и выписки из реестра заявок, содержащей информацию о заявках на совершение сделок с неликвидной ценной бумагой, за период, указанный в абзаце втором пункта 3 настоящих Методических рекомендаций, заменяя при этом закодированные данные участников торгов, клиентов участников торгов или клиентов, являющихся клиентами брокера или доверительного управляющего, которые, в свою очередь, являются клиентами участника торгов (далее – клиент второго уровня), обезличенными специальными обозначениями юридических и физических лиц, например:

обозначениями от Ю1 до Юn (где n - количество российских юридических лиц, информация о которых содержится в обеих указанных выше выписках) рекомендуется заменять коды (ИНН) участников торгов, клиентов участников торгов или клиентов второго уровня, являющихся российскими юридическими лицами;

обозначениями от Ф1 до Фn (где n – количество физических лиц, являющихся гражданами Российской Федерации, информация о которых содержится в обеих указанных выше выписках) рекомендуется заменять коды (серии и номера общегражданских паспортов или свидетельств о рождении) клиентов участников торгов или клиентов второго уровня, являющихся гражданами Российской Федерации;

обозначениями от Н1 до Нn (где n – количество иностранных юридических и физических лиц, информация о которых содержится в обеих

указанных выше выписках) рекомендуется заменять коды клиентов участников торгов или клиентов второго уровня, являющихся иностранными юридическими или физическими лицами.

5. С даты издания настоящих Методических рекомендаций отменяются Методические рекомендации по установлению критериев существенного отклонения цены, спроса, предложения и объема торгов неликвидными ценными бумагами от 26.03.2016 № 8-МР.

6. Настоящие Методические рекомендации подлежат опубликованию в «Вестнике Банка России» и размещению на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет».

Заместитель

Председателя Банка России

В.В. Чистюхин