

**ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(БАНК РОССИИ)**

« » _____

№ _____

г. Москва

У К А З А Н И Е

**О внесении изменений в Положение Банка России от 17 октября 2014 года
№ 437-П «О деятельности по проведению организованных торгов»**

1. Внести в Положение Банка России от 17 октября 2014 года № 437-П «О деятельности по проведению организованных торгов», зарегистрированное Министерством юстиции Российской Федерации 30 декабря 2014 года № 35494 («Вестник Банка России» от 26 января 2015 года № 5), следующие изменения:

1.1. В пункте 1.1:

абзац первый изложить в следующей редакции:

«1.1. Организатор торговли осуществляет допуск лиц, указанных в частях 1 – 5.1 статьи 16 Федерального закона «Об организованных торгах» к организованным торгам, путем установления в правилах торгов совокупности организационно-правовых процедур, направленных на обеспечение соответствия указанных лиц установленным правилам организованных торгов требованиям к участникам торгов с целью заключения договора об оказании услуг по проведению организованных торгов. С целью осуществления указанного допуска, а также с целью предоставления возможности по заключению договоров на организованных торгах в интересах клиентов участников торгов и клиентов, являющихся клиентами брокера или доверительного управляющего, которые, в свою очередь, являются клиентами

участника торгов (далее - клиент второго уровня) (далее вместе - регистрируемые лица), организатор торговли осуществляет их регистрацию. При этом при проведении организованных торгов товарами организатор торговли регистрирует клиентов второго уровня в случаях, предусмотренных правилами организованных торгов.»;

абзац третий изложить в следующей редакции:

«В случае если правилами организованных торгов предусмотрено самостоятельное присвоение участником торгов кодов регистрируемым лицам, организатор торговли утверждает внутренний документ, устанавливающий порядок присвоения таких кодов, и применяет в отношении участника торгов меры воздействия, предусмотренные правилами организованных торгов, при выявлении несоблюдения указанного порядка. Коды, присваиваемые участником торгов самостоятельно, должны соответствовать требованиям настоящего Положения.».

1.2. В пункте 1.2:

абзацы пятый – девятый изложить в следующей редакции:

«для управляющего (управляющей компании) – данные, предусмотренные абзацем вторым настоящего пункта, а также уникальную последовательность символов, однозначно указывающих на то, что этот код присвоен лицу, действующему в качестве доверительного управляющего, а также позволяющих определить объект доверительного управления (ценные бумаги клиентов управляющего; средства пенсионных накоплений, сформированных в Пенсионном фонде Российской Федерации; средства негосударственного пенсионного фонда; акционерный инвестиционный фонд; паевой инвестиционный фонд; накопления для жилищного обеспечения военнослужащих; средства компенсационного фонда саморегулируемой организации; имущество, составляющее целевой капитал; иные объекты управления).

При присвоении кодов управляющему ценными бумагами количество кодов определяется по количеству его клиентов (учредителей доверительного управления), в интересах которых он собирается заключать договоры на организованных торгах. Каждый код указанного участника торгов (клиента участника торгов) дополнительно должен содержать код клиента управляющего. Код клиента управляющего присваивается участником торгов самостоятельно в порядке, предусмотренном настоящим Положением.

При присвоении кода управляющей компании паевого инвестиционного фонда регистрация учредителей управления паевым инвестиционным фондом не производится.

При присвоении кода управляющей компании средствами пенсионных накоплений, сформированных в Пенсионном фонде Российской Федерации, код также должен дополнительно включать признак, указывающий на соответствующий инвестиционный портфель.

Управляющей компании средствами негосударственного пенсионного фонда присваивается три кода: для средств пенсионных накоплений, для средств пенсионных резервов, а также для имущества, предназначенного для обеспечения уставной деятельности, либо собственных средств негосударственного пенсионного фонда. Код учредителя доверительного управления - негосударственного пенсионного фонда включает в себя его ИНН, а также должен дополнительно включать признак, указывающий на то, какие средства являются объектом доверительного управления.».

1.3. Пункт 1.7 изложить в следующей редакции:

«1.7. Передача клиенту (клиенту второго уровня) технических средств, информации и (или) программного обеспечения, полученных участником торгов от организатора торговли (иного уполномоченного организатором торговли лица), если это предусмотрено соглашением участника торгов с организатором торговли (иным уполномоченным организатором торговли лицом), и подключение организатором торговли (иным уполномоченным

организатором торговли лицом) клиента (клиента второго уровня) к программно-техническим средствам, предназначенным для осуществления деятельности по проведению организованных торгов, при наличии согласия на такое подключение участника торгов, который будет заключать на организованных торгах договоры в интересах этого клиента (клиента второго уровня), допускаются после регистрации организатором торговли такого клиента (клиента второго уровня).».

1.4. В пункте 1.14:

дополнить абзацем четвертым следующего содержания:

«цена, указанная в заявке;»;

абзацы четвертый – шестой считать абзацами пятым – седьмым соответственно.

1.5. В пункте 1.15:

подпункт 1.15.5 изложить в следующей редакции:

«1.15.5. При приостановке организованных торгов по основаниям, указанным в абзацах втором и третьем подпункта 1.15.1 настоящего пункта, последующая приостановка организованных торгов акциями в течение торгового дня осуществляется только в случае изменения на 15 процентов значения основного индекса в течение десяти минут подряд в ходе данной торговой сессии по сравнению с последним значением указанного индекса, рассчитанным в течение основной торговой сессии до момента приостановки торгов.

В случае приостановки организованных торгов по указанному в абзаце первом настоящего подпункта основанию последующая приостановка организованных торгов в течение этого торгового дня не осуществляется.»;

в подпункте 1.15.6 слово «третьем» заменить словом «втором»;

в подпункте 1.15.7 слова «подпункте 1.15.2 и абзацах втором и третьем подпункта 1.15.5» заменить словами «подпунктах 1.15.2 и 1.15.5»;

в подпункте 1.15.9:

абзац четвертый изложить в следующей редакции:

минимальное совокупное количество (минимальный совокупный объем) ценных бумаг (валюты, товара) в заявках на покупку и в заявках на продажу, поданных для участия в таких торгах, необходимое для их проведения;

дополнить абзацем шестым следующего содержания:

«случаи проведения таких торгов.»;

подпункт 1.15.13 изложить в следующей редакции:

«1.15.13. Организованные торги могут быть приостановлены или прекращены по решению Председателя Банка России (его заместителя), оформляемому соответствующим предписанием Банка России. Указанное предписание должно содержать набор признаков, позволяющих однозначно идентифицировать предмет договора, торги которым приостанавливаются или прекращаются (в том числе вид (тип), наименование, а также базис (условия) поставки и (или) иные сведения, необходимые для идентификации ценной бумаги, валюты, товара или производного финансового инструмента (далее – торгуемый инструмент)) и срок действия приостановки.».

1.6. Пункт 1.17 изложить в следующей редакции:

«1.17. Организатор торговли устанавливает в правилах организованных торгов меры дисциплинарного воздействия, применяемые к участникам торгов, допустившим нарушение правил организованных торгов. Такими мерами может быть приостановление или прекращение допуска к участию в организованных торгах и иные непротиворечащие законодательству Российской Федерации меры.».

1.7. Абзац первый пункта 2.3 изложить в следующей редакции:

«2.3. Организатор торговли во внутренних документах должен установить порядок актуализации кода участника торгов в случае изменения сведений об участнике торгов, его клиенте или клиенте второго уровня, предусматривающий обязанность участника торгов предоставлять организатору торговли актуальные сведения не позднее пяти рабочих дней с

даты изменения сведений об указанном участнике или получения им актуальных сведений от своих клиентов и клиентов второго уровня.».

1.8. Абзац второй подпункта 2.5.2 пункта 2.5 изложить в следующей редакции:

«В случаях, когда в течение торгового дня происходили технические сбои, приведшие к невозможности предоставления организатором торговли выписок из реестра договоров в сроки, предусмотренные в абзаце первом настоящего пункта, организатор торговли предоставляет участникам торгов выписки из реестра договоров не позднее, чем за 1 час до начала проведения организованных торгов следующего торгового дня.».

1.9. Главу 4 дополнить пунктом 4.4 следующего содержания:

«4.4. Организатор торговли должен обеспечить хранение информации о сетевых адресах и иных идентификаторах устройств участников торгов, их клиентов (клиентов второго уровня), работающих в информационно-телекоммуникационных сетях (средств связи и пользовательского (оконечного) оборудования), с которых осуществляется подключение к программно-техническим средствам, предназначенным для деятельности по проведению организованных торгов».

1.10. В приложении 2:

пункт 2 изложить в следующей редакции:

«2. Средневзвешенная цена торгуемого инструмента определяется по формуле:

$$WAP_{inst} = \frac{\sum_{i=1}^N P_i V_i}{\sum_{i=1}^N V_i}$$

где:

P_i - цена торгуемого инструмента, являющегося предметом i -ого договора, в рублях;

V_i - объем i -ого договора в единицах измерения торгуемого инструмента;

№ - количество договоров, заключенных с начала торгового дня до момента расчета средневзвешенной цены.»;

в пункте 5.5 слова «заключаемых на данном организаторе торговли,» заменить словами «заключаемых на организованных торгах данного организатора торговли.».

1.11. В приложении 4:

в пункте 3:

в абзаце пятнадцатом слова «внутренний документ (документы) организатора торговли, устанавливающий принципы корпоративного управления» заменить словами «внутренний документ по корпоративному управлению организатора торговли»;

предложение первое абзаца восемнадцатого изложить в следующей редакции:

«информацию о судебных спорах организатора торговли, его дочерних и зависимых обществ, решения по которым могут существенным образом повлиять на финансовое положение или хозяйственную деятельность организатора торговли.»;

дополнить абзацами следующего содержания:

«информацию о прекращении предоставления услуг по проведению организованных торгов, в том числе отдельными инструментами, в отдельной торговой (биржевой) секции и (или) отдельном режиме торгов. Указанная информация подлежит раскрытию не позднее, чем за один месяц до даты прекращения предоставления указанных услуг с одновременным направлением данной информации в Банк России;

внутренние документы организатора торговли, ссылки на которые содержатся в правилах организованных торгов, за исключением документов, определяющих порядок организации мониторинга организованных торгов и документов, содержащих коммерческую и иную охраняемую законом тайну.»;

в подпункте 11.2 пункта 11 слова «заключенных на организаторе торговли» заменить словами «заключенных на организованных торгах данного организатора торговли»;

в пункте 13:

абзац пятый изложить в следующей редакции:

«о количественном объеме заключенных договоров, предметом которых является товар, в единицах измерения, предусмотренных такими договорами (тоннах, кубических метрах и др.) (суммарно и отдельно по видам торгуемых инструментов). Организатор торговли вправе раскрывать указанную информацию отдельно по режимам торговли;»;

в абзаце шестом слово «резидентами» заменить словами «налоговыми резидентами Российской Федерации»;

в абзаце седьмом слова «являющихся нерезидентами» заменить словами «не являющихся налоговыми резидентами Российской Федерации»;

в абзаце первом пункта 14 слова «даты и основания приостановления (прекращения) и возобновления допуска к участию в торгах» заменить словами «а также текущего статуса участника торгов (допущен, приостановлен, прекращен, возобновлен и иные) с указанием даты и основания присвоения соответствующего статуса»;

в пункте 15:

абзацы третий и четвертый изложить в следующей редакции:

«наименование, вид, категория (тип) торгуемого инструмента, являющегося предметом договора, обязательства из которого не были исполнены участником торгов (клиринговым брокером);

суммарный размер неисполненных участником торгов (клиринговым брокером) обязательств в отношении каждого вида торгуемого инструмента;»;

абзац шестой исключить;

абзац седьмой изложить в следующей редакции:

«меры, принятые организатором торговли (клиринговой организацией) в связи с неисполнением обязательств участником торгов, в том числе, когда такие обязательства возникли из договоров, заключенных по поручению и (или) в интересах клиента участника торгов и (или) клиента второго уровня;»;

абзац девятый дополнить предложением следующего содержания:

«В случае получения организатором торговли сведений об исполнении участником торгов своих обязательств после раскрытия информации об их неисполнении на сайте организатора торговли, указанная информация подлежит изменению организатором торговли, при этом, измененная информация должна содержать сведения о фактической дате исполнения обязательств участником торгов.»;

в пункте 17:

абзац первый после слов «на сайте» дополнить словами «или иным доступным способом, в случае отсутствия возможности раскрыть указанную информацию на сайте»;

абзац второй после слов «доступным способом» дополнить словами «в случае отсутствия возможности раскрыть указанную информацию на сайте»;

в пункте 20 после слов «причинах технического сбоя» дополнить словами «, а также принимаемых организатором торговли мерах для предотвращения (снижения) ущерба, связанного с техническим сбоем (в случае наличия такого ущерба) и направленных на недопущение повторения подобных технических сбоев»;

в пункте 30 слова «устанавливающий принципы корпоративного управления» заменить словами «по корпоративному управлению»;

пункт 31 изложить в следующей редакции:

«31. Организатор торговли ежемесячно не позднее пяти рабочих дней с даты окончания календарного месяца представляет в Банк России на электронном носителе или в электронно-цифровой форме посредством

электронных каналов связи в соответствии с заключенным между организатором торговли и Банком России договором об информационном взаимодействии реестр договоров, заключенных на организованных торгах за предыдущий месяц, в отношении всех торгуемых инструментов (с разбивкой по видам торгуемых инструментов), а также реестр заявок, не зарегистрированных организатором торговли за предыдущий месяц, с указанием причины отказа в регистрации.

В случае заключения на организованных торгах договоров с участием центрального контрагента организатор торговли включает в реестр договоров, указанный в абзаце первом настоящего пункта, только договоры, по которым центральный контрагент является покупателем.»;

в пункте 34 слово «сделка» заменить словом «договор» в соответствующем числе и падеже;

дополнить пунктами 35-36 следующего содержания:

«35. Организатор торговли вправе раскрывать иную информацию, не предусмотренную настоящим приложением, в случае если такое раскрытие не нарушает принципа конфиденциальности информации, составляющей коммерческую и иную охраняемую законом тайну, и конфиденциальности сведений, предоставляемых участниками торгов в соответствии с правилами организованных торгов.

36. Организатор торговли осуществляет раскрытие информации, предусмотренной подпунктами 1.2 и 1.3 пункта 1 и пунктом 13 настоящего приложения, отдельно по договорам, заключенным на основании адресных заявок, и договорам, заключенным на основании заявок хотя бы одна из которых является безадресной. При этом в отношении договоров, заключенных на основании адресных заявок, раскрытие информации о наибольшей (наименьшей) цене и цене торгуемого инструмента по последнему заключенному договору осуществляется по усмотрению организатора торговли.».

2. В пункте 9 Указания Банка России от 18.04.2014 № 3234-У «О единых требованиях к правилам осуществления брокерской деятельности при совершении отдельных сделок за счет клиентов», зарегистрированного Министерством юстиции Российской Федерации 18 июня 2014 года № 32792, 24 февраля 2016 года № 41207 («Вестник Банка России» от 1 июля 2014 года № 62, от 3 марта 2016 года № 21), слова «и на сделки, обязательства из которых допущены к клирингу с участием центрального контрагента, в отношении которого Банком России принято решение о признании качества управления центральным контрагентом удовлетворительным» исключить.

3. Настоящее Указание вступает в силу по истечении 10 дней после дня его официального опубликования в «Вестнике Банка России».

4. Организаторы торговли должны привести свою деятельность в соответствие с требованиями настоящего Указания не позднее шести месяцев со дня его вступления в силу.

Председатель
Центрального банка
Российской Федерации

Э.С. Набиуллина