

ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ  
(БАНК РОССИИ)

Методические рекомендации

по установлению критериев существенного отклонения цены, спроса,  
предложения и объема торгов неликвидными ценными бумагами

«23» марта 2016 год

№ 8-МР

1. Настоящие Методические рекомендации разработаны в соответствии с частью 2 статьи 5 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» и предназначены для использования в работе организаторами торговли, на торгах которых совершаются сделки с ценными бумагами (далее – организаторы торговли).

2. Каждому организатору торговли рекомендуется в своих внутренних документах самостоятельно устанавливать критерии существенного отклонения цены, спроса, предложения и объема торгов неликвидными ценными бумагами (далее - критерии). Информацию об установленных критериях рекомендуется направлять в созданный при Банке России Экспертный совет по существенным рыночным отклонениям (далее – Экспертный совет).

3. В целях установления критериев к неликвидным ценным бумагам рекомендуется относить все ценные бумаги, допущенные к торгам у этого организатора торговли, за исключением ликвидных ценных бумаг, определяемых на основании приказа 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 приказа ФСФР России от 30.08.2011 № 11-38/пз-н

«Об утверждении Методических рекомендаций по установлению критериев существенного отклонения цены низколиквидных ценных бумаг».

4. Организатору торговли рекомендуется обращаться в Экспертный совет в случаях:

а) если организатором торговли по определяемым им критериям или по их сочетаниям выявлена нестандартная сделка с неликвидной ценной бумагой;

б) подготовки ответа на предписание (требование, запрос) Банка России о предоставлении информации о существенном отклонении цены, спроса, предложения и (или) объема торгов неликвидной ценной бумагой.

Организатору торговли рекомендуется обращаться в Экспертный совет для определения, привели ли выявленные организатором торговли или указанные в предписании (требовании, запросе) сделки (заявки на совершение сделок) с ценной бумагой к существенному отклонению цены, спроса, предложения и (или) объема торгов такой ценной бумагой от уровня, который сформировался бы без этих сделок (заявок), либо к поддержанию цены, спроса, предложения или объема торгов такой ценной бумагой на уровне, существенно отличающемся от того уровня, который сформировался бы без таких сделок (заявок).

Также организатору торговли рекомендуется дополнительно предоставлять Экспертному совету информацию о торгах неликвидной ценной бумагой в рассматриваемый Экспертным советом торговый день и во все предыдущие торговые дни в течение периода, когда совершались сделки с указанной ценной бумагой, продолжительность которого в каждом конкретном случае рекомендуется определять организатору торговли по своему усмотрению, а в случае поступления соответствующего предписания (требования, запроса) Банка России - в течение периода, указанного в этом предписании (требовании, запросе).

5. В целях выполнения рекомендации, предусмотренной в пункте 4 настоящих Методических рекомендаций, организатору торговли рекомендуется направлять в Экспертный совет обращение на бумажном

носителе, а также в электронной форме (на отчуждаемом носителе), содержащее выписку из реестра сделок с ценной бумагой и выписку из реестра заявок на совершение сделок с этой ценной бумагой за соответствующий период, заменяя при этом закодированные данные участников торгов, субброкеров, клиентов и учредителей доверительного управления обезличенными специальными обозначениями юридических и физических лиц, например:

обозначениями от Ю1 до Юn (где n - количество юридических лиц, информация о которых содержится в обеих указанных выше выписках) рекомендуется заменять коды (ИНН) участников торгов, субброкеров, клиентов и учредителей доверительного управления, являющихся российскими юридическими лицами;

обозначениями от Ф1 до Фn (где n - количество граждан России, информация о которых содержится в обеих указанных выше выписках) рекомендуется заменять коды (серии и номера общегражданских паспортов или свидетельств о рождении) клиентов и учредителей доверительного управления, являющихся российскими гражданами;

обозначениями от Н1 до Нn (где n - количество нерезидентов, информация о которых содержится в обеих указанных выше выписках) рекомендуется заменять коды клиентов и учредителей доверительного управления, являющихся нерезидентами.

6. Настоящие Методические рекомендации подлежат опубликованию в «Вестнике Банка России».

Первый заместитель  
Председателя Банка России

С.А. Швецов