

Рекомендации по предотвращению недобросовестной практики

Влияние на ценовые показатели рынка (цену закрытия) в конце дневной торговой сессии

Marking the close



Целенаправленное влияние на ценовые показатели рынка (цену закрытия)

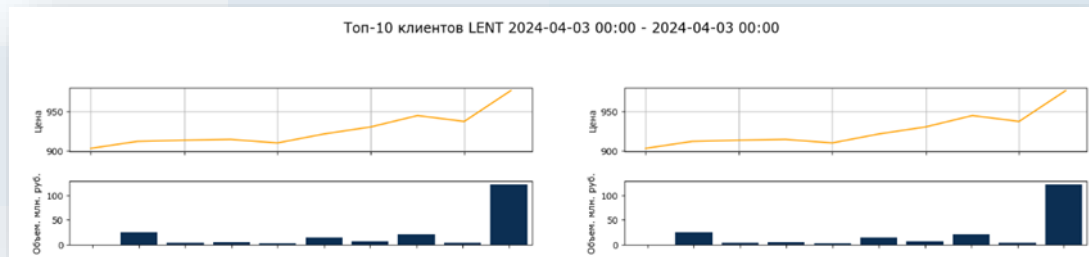


Инициирование роста торговой активности в конце торговой сессии с целью повлиять на условную цену закрытия инструмента. Таким образом, манипулятор изменяет рассчитываемые параметры рынка, искажая представление других участников о рынке.



Пример основных параметров на рынке акций LENT 03.04.2024 во время реализации marking the close

Динамика цены и объёма в течение торгового дня на рынке акций LENT во время реализации marking the close



Доля в сделках в разрезе топ-10 клиентов на определённом рынке финансовых инструментов во время реализации marking the close в течение торгового дня

Часовая грануляция в течение 03.04.2024

ПОКУПКИ Объем сделок, % к общему										Объем сделок, % к общему ПРОДАЖИ										
Q	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	4%
W	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	3%
O	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	37%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	3%
U	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
T	0%	0%	0%	55%	36%	31%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
S	0%	0%	0%	0%	19%	9%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	46%
R	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	3%
Q	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
P	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	3%
O	5%	0%	0%	0%	3%	0%	7%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
N	0%	5%	8%	16%	2%	2%	9%	4%	8%	5%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
M	0%	0%	0%	0%	0%	0%	2%	13%	21%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
L	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
K	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
J	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
I	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
H	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
G	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
F	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
E	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
D	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
C	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
B	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
A	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%

Минутная грануляция в интервале с 18:30:00 по 18:39:00

ПОКУПКИ Объем сделок, % к общему										Объем сделок, % к общему ПРОДАЖИ										
Q	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
W	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
O	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	5%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
U	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
T	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
S	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	9%	6%	10%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
R	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
Q	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
P	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
O	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
N	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
M	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
L	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
K	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
J	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
I	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
H	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
G	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
F	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
E	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
D	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
C	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
B	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
A	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%

Итоги торгов на рынке акций LENT с 01.04.2024 по 16.04.2024

В целом, особенностью рынка акций LENT является высокая волатильность и неравномерная активность инвесторов в разрезе торговых дней при нейтральной тональности новостного фона

Дата торгов	Сделок, шт.	Объем, руб.	Срвзв.цена	Первая	Минимум	Максимум	Закрытия
01.04.2024	11 265	203 530 875,00	902,00	870,00	870,00	925,00	909,50
02.04.2024	4 755	103 395 708,50	901,50	920,00	882,00	925,00	906,00
03.04.2024	8 467	207 630 126,00	976,00	903,00	903,00	1 090,50	1 056,00
04.04.2024	17 893	362 455 233,00	993,00	1 029,00	974,00	1 029,50	990,00
05.04.2024	5 434	113 919 767,00	970,50	998,50	960,00	998,50	962,50
08.04.2024	9 117	214 059 828,50	1 007,00	965,00	961,00	1 044,00	1 020,50
09.04.2024	3 511	125 761 905,00	1 010,00	1 021,00	995,00	1 043,00	1 002,00
10.04.2024	2 124	44 532 223,00	996,50	995,00	985,00	1 017,00	1 005,00
11.04.2024	4 100	74 372 633,00	1 017,50	1 015,00	995,00	1 035,00	1 015,50
12.04.2024	4 121	74 761 369,00	1 038,00	1 005,00	1 001,00	1 058,50	1 041,50
15.04.2024	5 043	108 421 659,50	1 062,50	1 048,50	1 036,50	1 080,00	1 044,00
16.04.2024	5 094	143 435 689,00	1 071,00	1 044,00	1 044,00	1 086,50	1 070,50

Пример динамики котировок акций LENT 03.04.2024 во время marking the close



Воспроизведение ценовой динамики на рынке акций LENT в период с 03.04.2024 по 05.04.2024 с индикацией ценовых экстремумов в период с 18:30:00 по 18:39:00

График подачи клиентом заявок на покупку акций LENT 03.04.2024



Серия однонаправленных крупных заявок под конец торговой сессии, которые дестабилизировали рынок акций LENT 03.04.2024 во временном интервале с 18:31:19 по 18:39:00.

Визуализация очереди заявок на рынке LENT 03.04.2024 в 18:30:51

Заявки клиента, торговая активность которого содержит поведенческие паттерны, характерные для marking the close, находились в топе очереди заявок на рынке на покупку акций LENT при полностью отсутствующем предложении

	B				S			
	details	orderno	quantity	k	details	orderno	quantity	k
- TOTAL								
950,00		2	-2 189	0,00	-	-	-	-
945,00		1	1	0,53	-	-	-	-
944,50		1	56	0,58	-	-	-	-
944,00		1	196	0,63	-	-	-	-
943,50		2	112	0,68	-	-	-	-
943,00		1	196	0,74	-	-	-	-
942,00		3	4	0,84	-	-	-	-
941,50		1	22	0,89	-	-	-	-
941,00		4	373	0,95	-	-	-	-
940,00		4	161	1,05	-	-	-	-
939,00		2	7	1,16	-	-	-	-
938,50		1	10	1,21	-	-	-	-
938,00		1	2	1,26	-	-	-	-
937,00		1	2	1,37	-	-	-	-
936,50		1	5	1,42	-	-	-	-

Основные поведенческие паттерны при реализации недобросовестной практики marking the close

- Клиентом во время окончания дневной торговой сессии подаются крайне агрессивные заявки;
- Приведённые выше заявки как правило «собирают стакан», тем самым приводя к значительному росту котировок цены финансовых инструментов;
- Указанные заявки имеют одну направленность.