

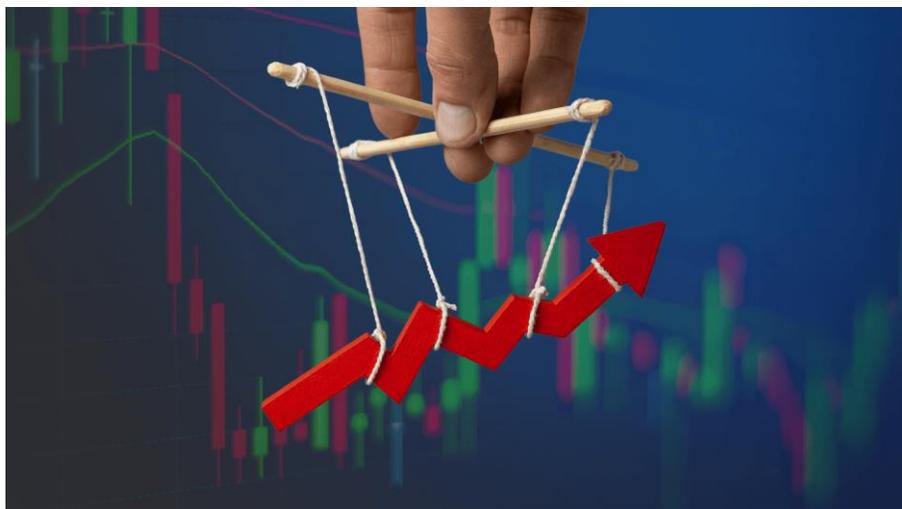
Рекомендации по предотвращению недобросовестной практики

Ввод заявок и совершения сделок, которые могут начать или усилить тренд и побудить других участников ускорить или продлить тренд, чтобы создать возможность закрыть или открыть позицию по выгодной цене «Momentum Ignition»



Действия, относящиеся к манипулированию рынком указаны в части 1 статьи 5 ФЗ-224

Неоднократное в течение торгового дня совершение на организованных торгах сделок за счет или в интересах одного лица на основании заявок, имеющих на момент их выставления наибольшую цену покупки либо наименьшую цену продажи финансового инструмента, иностранной валюты и (или) товара, в результате которых их цена существенно отклонилась от уровня, который сформировался бы без таких сделок, в целях последующего совершения за счет или в интересах того же или иного лица противоположных сделок по таким ценам и последующее совершение таких противоположных сделок (Пункт 5 части 1 статьи 5 ФЗ-224)



Участники торгов обязаны идентифицировать недобросовестную практику и предотвращать ее реализацию

Вариант реализации недобросовестной практики 16.07.2024



Изображение 1. График подачи клиентом заявок и совершения сделок с 18:00 до 18:40

Клиентом с 18:01:28 до 18:03:05 16 июля 2024 г. подано 19 агрессивных заявок на покупку Акции объемом от 20 до 100 штук. В результате заключения сделок по вышеуказанным заявкам цена Акции выросла с 19900 рублей до 23900 рублей (рост больше 20%). На момент совершения сделок вышеуказанные заявки Клиента имели наибольшую цену покупки. Новостной фон, который мог быть использован Клиентом для совершения агрессивных сделок по покупке Акции, отсутствовал.

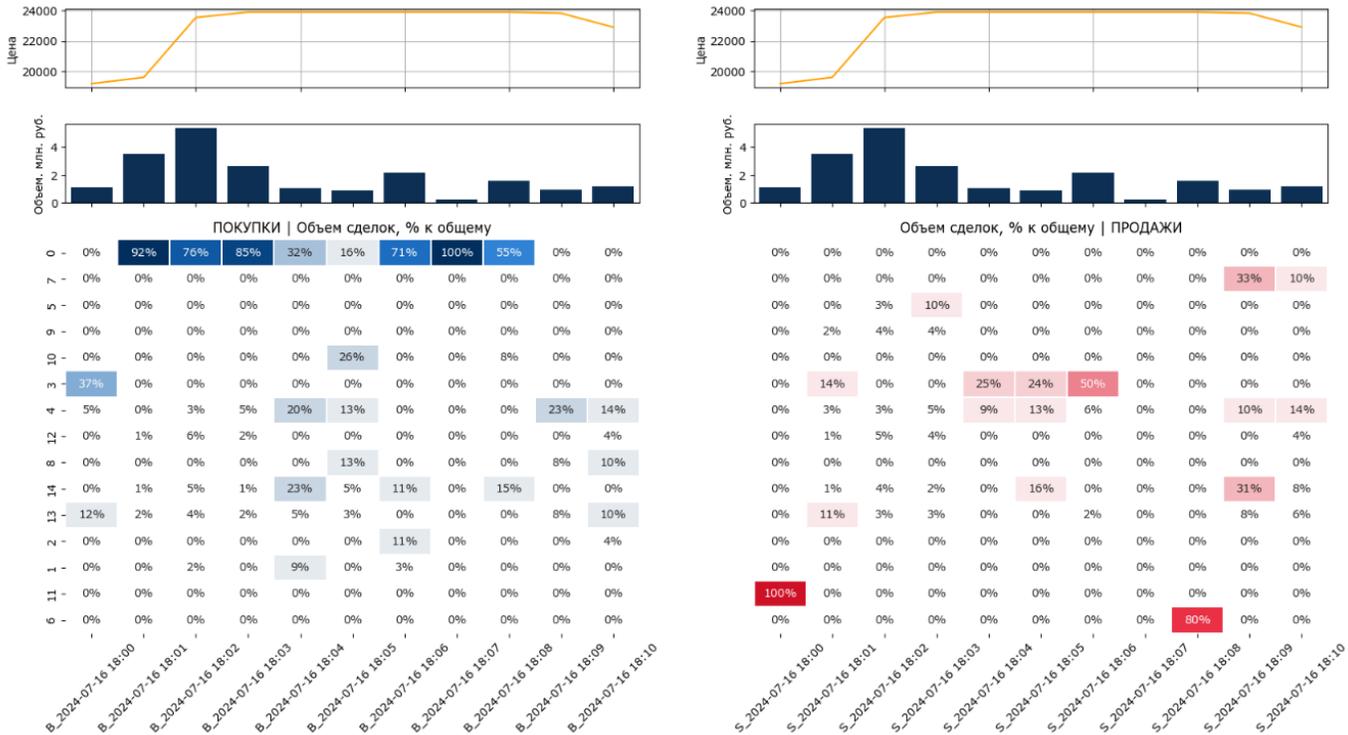
Клиентом с 18:05:33 до 18:28:48 16 июля 2024 г. подано 23 заявки на покупку Акции объемом от 1 до 61 штук. В результате поданных Клиентом заявок, он заключил 322 сделки по покупке Акции.

После роста цены Акции Клиентом с 18:37:51 до 18:39:49 16 июля 2024 г. совершено 14 сделок по продаже Акции.

Вариант реализации недобросовестной практики 16.07.2024

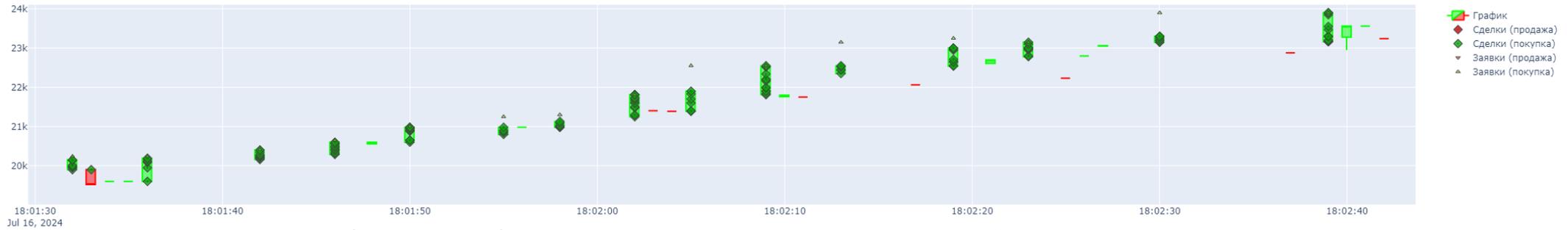


Изображение 2. График подачи клиентом заявок и совершения сделок с 18:00 до 18:10



Изображение 3. Тепловая карта – ТОП-10 клиентов по объему торгов с 18:00 до 18:10

Вариант реализации недобросовестной практики 16.07.2024



Изображение 4. График подачи клиентом заявок и совершения сделок с 18:01:30 до 18:02:40

18:01:36

Цена	Объем
20410	1
20400	12
20340	1
20280	5
20270	1
20250	1
20240	2
20200	4
20190	1
20180	3
20130	2
20100	1
20090	3
19950	2
19600	15
19530	1
19520	4
19510	6
19500	3
19440	1
19430	1
19400	1
19310	4
19300	1
19290	4
19280	1
19270	3
19260	4
19250	2
19200	4

← Клиентом выставлена лимитная заявка на покупку 20 акций по цене 20240

18:01:42

Цена	Объем
20650	2
20600	5
20560	2
20500	3
20460	1
20410	1
20400	12
20340	1
20280	5
20270	1
20250	1
20240	2
20200	4
20160	1
20060	1
19670	6
19660	6
19640	6
19620	4
19600	2
19530	1
19500	3
19440	1
19430	1
19400	1
19340	1
19300	1
19290	1
19280	1
19260	1

← Клиентом выставлена лимитная заявка на покупку 20 акций по цене 20410

18:01:46

Цена	Объем
20980	29
20950	9
20910	1
20900	3
20880	1
20650	2
20600	5
20560	2
20500	3
20460	1
20410	1
20400	11
20340	1
20300	1
20290	1
19800	3
19790	1
19730	3
19720	2
19670	1
19660	6
19650	3
19640	6
19620	3
19530	1
19500	3
19440	1
19430	1
19400	1
19340	1

← Клиентом выставлена лимитная заявка на покупку 20 акций по цене 20560

18:01:50

Цена	Объем
21300	1
21290	1
21250	1
21130	1
21090	1
21030	1
21000	3
20990	1
20980	29
20950	9
20910	1
20900	3
20880	1
20650	2
20600	1
20040	3
20030	2
20020	1
19870	3
19860	3
19840	3
19820	1
19810	4
19790	1
19740	3
19670	1
19660	6
19650	3
19620	3
19580	1

← Клиентом выставлена лимитная заявка на покупку 20 акций по цене 21000

Маркерами для выявления настоящей стратегии являются следующие действия одного лица или связанной группы лиц:

- Неоднократное в течение торгового дня совершение сделок на основании заявок, имеющих на момент их выставления наибольшую цену покупки либо наименьшую цену продажи финансового инструмента
- В результате совершения сделок цена должна существенно отклониться от уровня, который сформировался бы без таких сделок
- Последующее совершение противоположных сделок

Рекомендуемые действия при выявлении недобросовестной практики

