

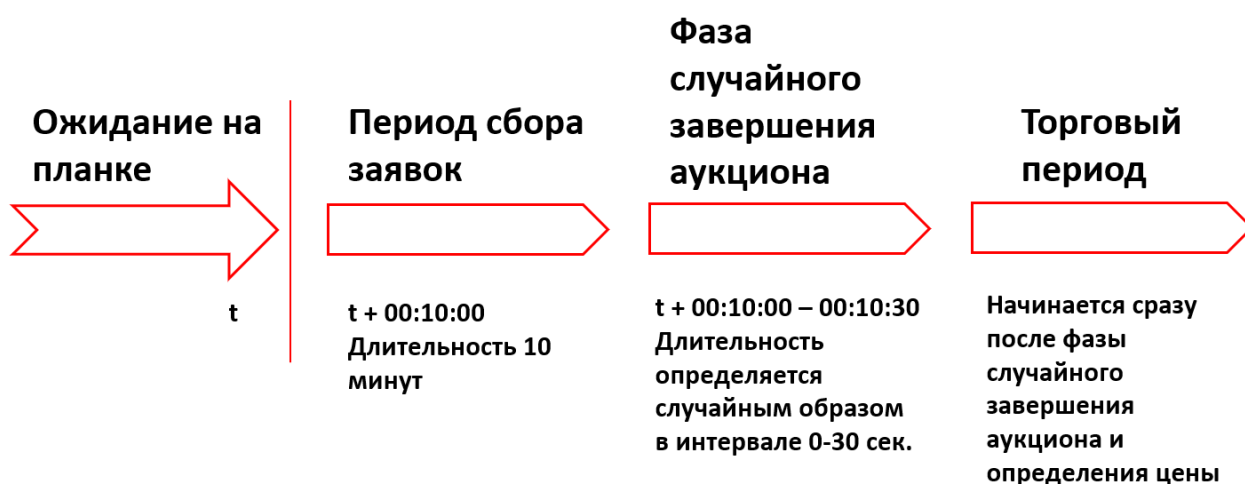
Особенности проведения аукционов обновления цен на валютном рынке

Общая информация

На валютном рынке с целью стабилизации курса при резких движениях цен в ходе торгов, приведших к необходимости сдвига текущих границ после истечения установленного времени ожидания рынка на планке, вводится Аукцион обновления цен (АОЦ).

- АОЦ стартует сразу после сдвижки границ, вместе с сообщением о сдвижке границ
- АОЦ проходит по всем инструментам спот валютной пары (TOD, TOM, TMS, SPT), по которой произошла сдвижка границ
- АОЦ проводится аналогично действующему на валютном рынке Аукциону открытия: момент выбора цены аукциона выбирается случайным образом, сама цена определяется с учетом дисбаланса спроса и предложения
- Завершение АОЦ происходит синхронно по всем инструментам валютной пары в единый момент времени

Схема проведения АОЦ



Тип заявки	Снимается ли перед началом АОЦ	Принимается ли в период сбора заявок в АОЦ
Рыночная заявка	-	да
Лимитированная заявка «Снять остаток»	-	да
Лимитированная заявка «Поставить в очередь»	нет	да
Лимитированная заявка «Поставить в очередь или отклонить»	да	нет
Лимитированная заявка «Полностью или отклонить»	-	нет
Лимитированная заявка «Скрыть количество» с ненулевым объемом	да	нет
Лимитированная заявка «Скрыть количество» с нулевым объемом*	нет*	да
Рыночные и лимитированные заявки из алгопакетов (TWAP)	Нереализованные объемы в таких заявках будут распределены на последующие итерации из	нет

	данного алгопакета по стандартной процедуре в системном режиме торгов после проведения АОЦ.	
--	---	--

* Если заявка «скрыть количество» была выставлена с ненулевым объемом в стакан, но на момент начала АОЦ в заявке не осталось скрытого объема, то такая заявка не снимается при старте АОЦ.

Временной регламент

Аукцион обновления цен				
Инструменты	Режимы торгов	Период времени, в течение которого возможно начало проведения Аукциона обновления цен (t)	Период сбора заявок	Фаза случайного выбора момента определения цены аукциона открытия
Инструменты T+0 (TOD)	Системный режим торгов	10:00:00 – 17:34:30	t + 00:10:00	t + 00:10:00 – t + 00:10:30
Инструменты T+1 (TOM, TMS), T+2 (SPT)		10:00:00 – 18:49:30	t + 00:10:00	t + 00:10:00 – t + 00:10:30
		18:49:30 – 18:58:00	до 18:59:30	18:59:30 – 19:00:00

В период 17:34:30 до 17:45:00 в случае наступления событий, которые должны приводить к сдвигу границ ценового коридора, временем окончания торгов по инструментам TOD соответствующей валютной пары в системном режиме является момент наступления такого события.