

Методические рекомендации по регистрации клиентов Участников торгов с указанием признака «Разрешить кросс-сделки»

Цель введения рекомендаций

Настоящие рекомендации разработаны ПАО Московская Биржа (далее – Биржа) с целью обеспечения большей прозрачности при анализе Биржей и Банком России ситуаций возможного манипулирования или недобросовестного поведения участников торгов в ходе организованных торгов на Фондовом и Срочном рынках Московской Биржи с использованием опции снятия ограничений на заключение кросс-сделок (сделки, заключенные на основании заявок, поданных за счет и в интересах одного и того же лица – конечного выгодоприобретателя (в соответствии с кодом этого лица)) для определенных клиентов Участника торгов.

Сделки, обязательства сторон по которым исполняются за счет или в интересах одного лица, могут приводить к существенным отклонениям параметров торгов и вызывают повышенный интерес при анализе нестандартных сделок, также такие сделки с большой вероятностью могут быть квалифицированы Банком России как манипулирование рынком.

Содержание рекомендаций

1. При регистрации Участником торгов клиента, относящегося к категории «иностранные юридические лица, имеющие лицензию на оказание третьим лицам услуг финансового посредника» на рынках Московской Биржи, рекомендуется регистрировать индивидуальные коды клиента (клиента второго уровня, а на Срочном рынке - клиента, зарегистрированного биржей в качестве клиента, являющегося клиентом брокера, доверительного управляющего или иного лица, которое, в свою очередь, является клиентом второго уровня, которому открыт раздел регистра учета позиций, код которого состоит из 7 знаков) для заключения сделок за счет каждого третьего лица («суб-клиента»), являющегося конечным выгодоприобретателем от торговых операций. В случае, если личным законом иностранного юридического лица запрещена трансграничная передача сведений, необходимых для регистрации кода клиента второго уровня в соответствии с Положением Банка России от 17.10.2014 № 437-П «О деятельности по проведению организованных торгов», рекомендуется использование внутреннего уникального кода, присваиваемого иностранным юридическим лицом и не содержащего ограничений к передаче сведений.
2. При регистрации Участником торгов клиента, являющегося конечным выгодоприобретателем от торговых операций и одновременно реализующего ряд независимых друг от друга процессов подачи заявок и заключения сделок на рынках Московской Биржи, в целях наиболее эффективной идентификации таких процессов рекомендуется регистрировать отдельные уникальные коды специально для клиента (клиента второго уровня, а на Срочном рынке - клиента, зарегистрированного биржей в качестве клиента, являющегося клиентом брокера, доверительного управляющего или иного лица, которое, в свою очередь, является клиентом второго уровня, которому открыт раздел регистра учета позиций, код которого состоит из 7 знаков) для осуществления торговых операций в рамках каждого такого процесса.
3. В случае, если суб-клиент Участника торгов относится к категории «иностранные юридические лица, имеющие лицензию на оказание третьим лицам услуг

финансового посредника», рекомендуется отдельно регистрировать коды клиентов второго уровня для операций, совершаемых в интересах третьих лиц, для каждого такого третьего лица путем создания составного кода клиента второго уровня (через разделитель), и для собственных торговых операций суб-клиента.

4. Участнику торгов – доверительному управляющему при собственной регистрации, а также Участнику торгов при регистрации клиента с признаком доверительного управления рекомендуется в случае доверительного управления пулом активов регистрировать в качестве кода клиента (кода клиента второго уровня) уникальный код пула активов, начинающийся с символов «АР-».
5. Решение о предоставлении клиенту (клиенту второго уровня) технической возможности заключения кросс-сделок принимает Участник торгов, который должен располагать подтверждением того, что клиент (клиент второго уровня) осознает и принимает риски возникновения правовых последствий в случае, если заключение кросс-сделок приведет к нарушению запрета на манипулирование рынком.
6. На момент подачи Участником торгов в адрес ПАО Московская Биржа запроса о предоставлении технической возможности заключения кросс-сделок в интересах своего клиента, Участник торгов должен иметь в своем распоряжении явно выраженный запрос своего клиента и (при наличии клиента второго уровня) копию запроса клиента второго уровня на предоставление возможности заключения кросс-сделок, содержащие обоснование необходимости предоставления такой возможности. В случае запрета личным правом иностранного юридического лица на трансграничную передачу отдельных сведений, указанных в мотивированном запросе, допускается обезличивание запрещенной к передаче информации в копии мотивированного запроса клиента второго уровня, но с сохранением регистрационных данных документа (дата, время получения, регистрационный номер при наличии) и с сохранением мотивационной части.
7. Направляя в адрес ПАО Московская Биржа запрос о предоставлении Участнику торгов технической возможности заключения кросс-сделок, Участник торгов подтверждает свою осведомленность о рисках нарушения запрета на манипулирование рынком, связанных с заключением кросс-сделок.
8. Биржа вправе запросить у Участника торгов копию мотивированного запроса клиента (клиента второго уровня), содержащего обоснование необходимости предоставления ему возможности заключения кросс-сделок. В случае запрета личным правом иностранного юридического лица на трансграничную передачу отдельных сведений, указанных в мотивированном запросе, предоставляется сканированная копия мотивированного запроса с обезличиванием запрещенной к передаче информации, но с сохранением регистрационных данных документа (дата, время получения, регистрационный номер при наличии) и с сохранением мотивационной части.