Утверждены

*Наблюдательным Советом ОАО Московская Биржа*

*22 августа 2014 г. (Протокол №4)*

*Зарегистрированы Банком России 07 октября 2014 г.*

ПРАВИЛА ОРГАНИЗОВАННЫХ ТОРГОВ ОАО Московская Биржа на валютном рынке и рынке ДРАГОЦЕННЫх МЕТАЛЛов

(в новой редакции)

**МОСКВА 2014 г.**

**СОДЕРЖАНИЕ**

[1. ГЛОССАРИЙ 3](#_Toc383419090)

[2. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ 12](#_Toc383419091)

[3. ПРОВЕДЕНИЕ ТОРГОВ 18](#_Toc383419092)

[4. ОФОРМЛЕНИЕ ЗАРЕГИСТРИРОВАННЫХ ЗАЯВОК И ЗАКЛЮЧЕННЫХ СДЕЛОК 32](#_Toc383419171)

[5. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО сделкам С иностранной валютОЙ/ДРАГОЦЕННЫМИ МЕТАЛЛАМИ 33](#_Toc383419172)

[6. Порядок рассмотрения конфликтных ситуаций 35](#_Toc383419174)

[7. Порядок разрешения споров 38](#_Toc383419175)

# ГЛОССАРИЙ

В целях настоящих Правил организованных торгов ОАО Московская Биржа на валютном рынке и рынке драгоценных металлов (далее – Правила торгов) применяются следующие термины и определения:

**Аналог** **собственноручной подписи Участника торгов (АСП Участника торгов)** – реквизит заявки или иного электронного документа Участника торгов, являющийся торговым идентификатором Участника торгов и позволяющий однозначно идентифицировать Участника торгов, сформировавшего данную заявку или иной электронный документ, а также установить отсутствие искажения информации в заявке или ином электронном документе.

**Аукцион с Банком России (далее – аукцион)** – режим проведения торгов, который используется для целей определения оптимальной цены сделок своп/своп контрактов, базисным активом которых является иностранная валюта или драгоценный металл, заключаемых Участниками торгов с Банком России. Торги, проводимые на организованных торгах в режиме аукциона с Банком России, состоят из периода сбора заявок и периода удовлетворения заявок, подлежащих удовлетворению.

**Аутентификация** – процедура подтверждения Биржей посредством ПТК ТЦ права Участника торгов на заключение сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами и/или на получение Биржевой информации.

**Базисный актив** – иностранная валюта и/или драгоценный металл, определенный в спецификации соответствующего производного финансового инструмента.

**Базовый курс своп контракта** – курс исполнения обязательств по передаче в собственность базисного актива по первой части своп-контракта, определяемый в соответствии со спецификацией своп-контракта.

**Базовый курс сделки своп** – курс сделки своп, определяемый по сделке спот с более ранней датой исполнения обязательств. Базовый курс сделки своп определяется в соответствующей спецификации для каждой сделки своп.

**Биржевая информация** – цифровые данные и иные сведения неконфиденциального характера о ходе и итогах торгов на Бирже, а также информационные сообщения Биржи, обработанные и систематизированные с помощью программно-технических средств и оборудования Биржи, содержащиеся в базах данных Биржи, правом на использование которых обладает Биржа в соответствии с законодательством Российской Федерации.

**Валюта лота** – валюта/драгоценный металл, в которой(ом) номинирован лот инструмента.

**Внесистемные сделки** – сделки, заключаемые на основании двух встречных заявок на заключение внесистемной сделки, в которых Участники торгов указывают конечных контрагентов по внесистемной сделке. Внесистемные сделки при расчете средневзвешенного курса не учитываются.

**Временной регламент проведения торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов (Временной регламент)** – Временной регламент проведения торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, утверждаемый Биржей по согласованию с Клиринговым центром. Временной регламент устанавливает время проведения торгов по каждому из инструментов.

**Драгоценные металлы –** золото, серебро, платина или палладий в обезличенном виде.

**Заявка** – передаваемое в торговую систему электронное сообщение, подписанное АСП Участника торгов, содержащее информацию, предусмотренную Правилами торгов и являющееся предложением Участника торгов заключить сделку с иностранной валютой/драгоценными металлами в соответствии с Правилами торгов на условиях, содержащихся в заявке.

Заявки, зарегистрированные в ТС, отображаются на всех рабочих местах Участников торгов, за исключением заявок на заключение внесистемных сделок.

Заявка считается поданной в надлежащей форме вне зависимости от вида рабочего места Участника торгов, использованного при подаче заявок.

**Исполнение заявки** – заключение сделки в соответствии с условиями, указанными в заявке. Заявка может быть исполнена частично.

**Исполненная заявка** – заявка, по которой заключены сделки в соответствии с условиями, указанными в заявке. Заявка, по которой заключены сделки в полном объеме, является исполненной полностью. Заявка, по которой заключены сделки не в полном объеме, является исполненной частично.

**Неисполненная заявка** – заявка, по которой не заключено ни одной сделки.

**Стандартные виды заявок** – виды заявок, содержащие определенные, исключающие возможность их неоднозначного толкования, условия, предусмотренные настоящими Правилами торгов. Разделяются два вида заявок: лимитированные и рыночные.

**Лимитированная заявка** – стандартный вид заявки, выражающий не требующее дополнительного подтверждения согласие купить определенное количество лотов по цене, не выше указанной в такой заявке максимальной цены покупки, или продать определенное количество лотов по цене, не ниже указанной в такой заявке минимальной цены продажи. Если стандартный тип лимитированной заявки не указан, заявка считается заявкой типа «поставить в очередь».

**Рыночная заявка** – стандартный вид заявки, выражающий не требующее дополнительного подтверждения согласие купить или продать определенное количество лотов по лучшим ценам заявок, зарегистрированных в ТС. При подаче в ТС рыночной заявки указание стандартного типа заявки обязательно.

**Стандартные типы заявок** – типы заявок, содержащие особые дополнительные условия их исполнения. Разделяются четыре стандартных типа заявок: «снять остаток», «поставить в очередь», «немедленно или отклонить» и «скрыть количество».

**Заявка типа «снять остаток»** – заявка, которая исполняется в максимально возможном объеме сразу же после ее регистрации в ТС, а ее остаток удаляется из ТС.

**Заявка типа «поставить в очередь»** – заявка, которая исполняется в максимально возможном объеме сразу же после ее регистрации в ТС, после чего она ставится в очередь, как лимитированная заявка с объемом в размере неисполненного остатка. Если зарегистрированная заявка является рыночной, то она ставится в очередь с указанной на этот случай в этой заявке предельной ценой и далее исполняется, как лимитированная заявка.

**Заявка типа «немедленно или отклонить»** – заявка, которая исполняется полностью сразу же после ее регистрации в ТС, а при невозможности ее немедленного исполнения отклоняется.

**Заявка типа «скрыть количество»** – лимитированная заявка, где указывается количество лотов, которое не отображается в окне текущих котировок. Минимальное количество лотов, указываемых в заявке типа «скрыть количество» и отображаемых в окне текущих котировок, устанавливается решением Биржи по согласованию с Клиринговым центром. Максимальное соотношение общего количества лотов, указываемых в заявке типа «скрыть количество», к количеству лотов, отображаемых в окне текущих котировок, устанавливается решением Биржи по согласованию с Клиринговым центром. Заявки типа «скрыть количество» не могут подаваться в ТС с целью заключения сделок своп, своп контрактов и поставочных фьючерсных контрактов.

**Встречные заявки** – заявки, имеющие противоположную направленность, т.е. для заявок на продажу встречными являются заявки на покупку, и наоборот.

**Допустимые встречные заявки** – допустимыми встречными заявками по отношению к какой-либо заявке являются встречные заявки, удовлетворяющие ее условиям.

Допустимыми встречными заявками по отношению к какой-либо лимитированной заявке типа «поставить в очередь» или «снять остаток» являются встречные заявки с ценами не большими, чем цена покупки (не меньшими, чем цена продажи), указанная в данной заявке.

В случае регистрации в ТС лимитированной заявки типа «немедленно или отклонить» допустимыми встречными заявками являются встречные заявки с ценами не большими, чем цена покупки (не меньшими, чем цена продажи), указанная в данной заявке, и совокупный объем которых не меньше указанного в подаваемой заявке.

Допустимые встречные заявки на заключение внесистемной сделки, в том числе одна из которых является заявкой на заключение внесистемной сделки типа «Всем», должны содержать одинаковые значения цены и объема. В случае подачи заявки на заключение внесистемной сделки, кроме заявки на заключение внесистемной сделки типа «Всем», допустимые встречные заявки должны содержать взаимные указания Участниками торгов друг друга в качестве конечных контрагентов по внесистемной сделке.

В случае регистрации в ТС рыночных заявок типа «снять остаток» и типа «поставить в очередь» допустимыми встречными заявками по отношению к ним являются встречные заявки, стоящие в начале очереди. Для рыночной заявки типа «немедленно или отклонить» – встречные заявки, стоящие в начале очереди и совокупный объем которых не меньше указанного в подаваемой заявке.

**Заявка на заключение внесистемной сделки** – заявка, при подаче которой Участники торгов указывают в качестве конечного контрагента конкретного Участников торгов. Заявка на заключение внесистемной сделки отображается только на рабочем месте Участника торгов, подавшего заявку, и Участника торгов, указанного в качестве конечного контрагента по внесистемной сделке.

**Заявка на заключение внесистемной сделки типа «Всем»** – заявка, при подаче которой Участники торгов указывают в качестве конечного контрагента всех Участников торгов, путем выбора специального кода «Всем», доступного на рабочих местах Участников торгов. Заявка на заключение внесистемной сделки типа «Всем» отображается на рабочих местах всех Участников торгов.

**Заявка на заключение сделки своп** – каждая из заявок, одновременно подаваемая Участником торгов по двум различным сделкам спот с целью заключения сделки своп.

В случае если в заявке на заключение сделки спот обязательство по продаже иностранной валюты/драгоценного металла является обязательством с более поздней датой исполнения, то заявка на заключение сделки своп имеет направленность «покупка/продажа». В случае если в заявке на заключение сделки спот обязательство по покупке иностранной валюты/драгоценного металла является обязательством с более поздней датой исполнения, то заявка на заключение сделки своп имеет направленность «продажа/покупка».

**Заявка на заключение своп контракта** – заявка, подаваемая Участником торгов с целью заключения своп контракта.

В случае если в заявке на заключение своп контракта обязательство по передаче в собственность базисного актива является обязательством с более поздней датой исполнения, то заявка на заключение своп контракта имеет направленность «покупка/продажа». В случае если в заявке на заключение своп контракта обязательство по приему в собственность базисного актива является обязательством с более поздней датой исполнения, то заявка на заключение своп контракта имеет направленность «продажа/покупка».

**Заявка на заключение внесистемной сделки своп/внесистемного своп контракта** – заявка на заключение сделки своп или заявка на заключение своп контракта, при подаче которой Участник торгов в качестве дополнительной информации указывают конечного контрагента из числа Участников торгов. Заявка на заключение внесистемной сделки своп/внесистемного своп контракта отображается только на рабочих местах Участника торгов, подавшего заявку на заключение внесистемной сделки своп/внесистемного своп контракта, и Участника торгов, указанного в качестве конечного контрагента по внесистемной сделке своп/внесистемному своп контракту.

**Заявка на заключение внесистемной сделки типа «аукцион»** – заявка на заключение сделки своп/своп контракта, при подаче которой Участники торгов в качестве дополнительной информации указывают Банк России как конечного контрагента путем выбора специального кода «аукцион», доступного на рабочих местах Участников торгов.

**Инструмент** – сделка спот, сделка своп, своп контракт или поставочный фьючерсный контракт, совокупность условий заключения каждой из которых на организованных торгах Биржи определена в соответствующей спецификации и (или) в списке параметров соответствующих сделок.

**Итоговый курс своп контракта** – курс исполнения обязательства по передаче в собственность базисного актива по второй части своп контракта, определяемый в соответствии с Правилами клиринга.

**Итоговый курс сделки своп** – курс сделки своп, определяемый по сделке спот с более поздней датой исполнения обязательств, численно равный сумме базового курса сделки своп и цены сделки своп.

**Клиент Участника торгов (клиент)** – юридическое или физическое лицо, зарегистрированное в соответствии с Правилами допуска к участию в торгах на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ОАО Московская Биржа, по поручению которого Участник торгов подает заявки в ТС с целью заключения сделок в соответствии с настоящими Правилами торгов.

**Клиринговый центр** – Акционерный Коммерческий Банк «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество), осуществляющий клиринг в соответствии с Правилами клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ОАО Московская Биржа и выполняющий функции центрального контрагента.

**Краткий код Клиента Участника торгов (краткий код Клиента)** – буквенно-цифровой код, присваиваемый Биржей Клиенту Участника торгов.

**Конечный контрагент** – Участник торгов, указываемый другим Участником торгов в заявке на заключение внесистемной сделки в качестве возможного контрагента.

**Лот** – стандартное количество валюты/драгоценных металлов, определяемое применительно к каждому инструменту в соответствии с настоящими Правилами торгов и/или соответствующей спецификацией.

**Лучшая цена** – цена заявки, находящаяся первой в очереди заявок, зарегистрированных в ТС.

**Номер заявки** – идентификационный номер, присваиваемый заявке при ее регистрации в ТС. Порядковый номер заявки возрастает в зависимости от времени выставления заявки Участником торгов.

**ОАО Московская Биржа (Биржа)** – организатор торговли, оказывающий в соответствии с настоящими Правилами организованных торгов услуги по организации торгов иностранной валютой и драгоценными металлами.

**Организованные торги (торги)** – торги иностранной валютой и/или драгоценными металлами, проводимые в порядке, установленном настоящими Правилами торгов.

**Основная сессия** – сессия, в течение которой в ходе одного рабочего дня Участники торгов подают заявки и заключают сделки с иностранной валютой/драгоценными металлами с Клиринговым центром, являющимся стороной по всем сделкам.

**Очередь заявок (очередь)** – упорядоченная последовательность зарегистрированных в ТС заявок, неисполненных полностью или частично. Первой заявкой на покупку в очереди является заявка с максимальной ценой, далее – в порядке убывания цены. Первой заявкой на продажу в очереди является заявка с минимальной ценой, далее – в порядке возрастания цены. При равенстве цен в заявках одинаковой направленности приоритет имеет заявка, поданная ранее. Перед началом торгов очередь отсутствует. В очередь заявок не включаются заявки на заключение внесистемных сделок, заявки на заключение внесистемных сделок типа «Всем». Все заявки, стоящие в очереди, имеют состояние «активная».

**Поставочный своп контракт (своп контракт)** – заключаемый на организованных торгах договор, являющийся производным финансовым инструментом и предусматривающий обязанность каждой из сторон договора периодически уплачивать денежные суммы в зависимости от изменения цены базисного актива в соответствии с Правилами клиринга, а также обязанность в дату исполнения обязательств по первой части своп контракта одной стороны (покупателя) передать базисный актив в объеме сделки в валюте лота в собственность второй стороне (продавцу), и обязанность второй стороны (продавца) принять базисный актив и уплатить первой стороне (покупателю) сумму в сопряженной валюте в объеме, определяемом в соответствии со спецификацией, и в порядке, определяемом в соответствии с Правилами клиринга, а также обязанность в дату исполнения обязательств по второй части своп контракта второй стороны (продавца) передать базисный актив в объеме сделки в собственность первой стороне (покупателю) и обязанность первой стороны (покупателя) принять базисный актив и уплатить второй стороне (продавцу) сумму в сопряженной валюте в объеме и в порядке, определяемыми Правилами клиринга.

В случае если обязательство по передаче в собственность базового актива является обязательством с более поздней датой исполнения, то своп контракт имеет направленность «покупка/продажа». В случае если обязательство по приему в собственность базового актива является обязательством с более поздней датой исполнения, то своп контракт имеет направленность «продажа/покупка».

**Поставочный фьючерсный контракт (поставочный фьючерс)** – заключаемый на организованных торгах договор, являющийся производным финансовым инструментом, и предусматривающий обязанность каждой из сторон договора периодически уплачивать денежные суммы в зависимости от изменения цены базисного актива в соответствии с Правилами клиринга, а также обязанность одной стороны договора (продавца) передать в собственность второй стороне (покупателю) базисный актив в объеме сделки и обязанность второй стороны (покупателя) принять базисный актив и уплатить первой стороне (продавцу) сумму в сопряженной валюте в объеме и в порядке, определяемыми в соответствии с Правилами клиринга.

**Правила допуска** – Правила допуска к участию в торгах на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ОАО Московская Биржа, утвержденные уполномоченным органом ОАО Московская Биржа.

**Правила организованных торгов** (Правила торгов) – настоящие Правила организованных торгов ОАО Московская Биржа на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, утвержденные уполномоченным органом ОАО Московская Биржа.

**Правила клиринга** – Правила клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, утвержденные уполномоченным органом Клирингового центра.

**Правила ЭДО** – Правила электронного документооборота, утвержденные уполномоченным органом ОАО Московская Биржа.

**Программно-технический комплекс Технического центра (ПТК ТЦ)** – совокупность программно-технических средств Технического центра, используемых для оказания Участнику торгов услуг в соответствии с договорами, заключаемыми между Участником торгов и Техническим центром. ПТК ТЦ обеспечивает защищенность и целостность заявок Участников торгов в ТС в результате применения комплекса организационных и технических мер.

**Подсистема ПТК ТЦ** – составная часть ПТК ТЦ, предназначенная для оказания Участнику торгов определенного набора услуг. Торговая система и Клиринговая система являются подсистемами ПТК ТЦ.

**Рабочий день** – день, в том числе выходной или праздничный нерабочий день, в который Биржа проводит организованные торги иностранной валютой и/или драгоценными металлами. Проведение организованных торгов иностранной валютой и/или драгоценными металлами в выходной или праздничный нерабочий день устанавливается решением Биржи по согласованию с Клиринговым центром.

**Рабочее место Участника торгов** – совокупность программно-технических средств, предназначенных для использования Участником торгов в целях получения технического доступа к ПТК ТЦ.

В целях настоящих Правил торгов определяются следующие виды рабочих мест:

* рабочее место Участника торгов, получающего технический доступ к ПТК ТЦ с использованием удаленного рабочего места (далее – РМ УРМ);
* рабочее место Участника торгов , получающего технический доступ к ПТК ТЦ с использованием системы передачи информации Рейтер/Блумберг (далее – РМ Рейтер/РМ Блумберг);
* рабочее место Участника торгов, получающего технический доступ к ПТК ТЦ с использованием внешних программно-технических средств, интегрированных с ПТК ТЦ посредством универсального программно-аппаратного шлюза (далее – РМ ВПТС).

**Регистрационный код Участника торгов (идентификатор Участника торгов)** – уникальный буквенно-цифровой код, присваиваемый Биржей Участнику торгов для получения технического доступа к ПТК ТЦ в порядке, предусмотренном внутренними документами Биржи, с целью заключения сделок с иностранной валютой и/или драгоценными металлами.

**Сделка своп** – сделка купли-продажи иностранной валюты/драгоценных металлов на организованных торгах, по условиям которой Участник торгов, заключая сделку спот по покупке иностранной валюты/драгоценного металла одновременно заключает другую сделку спот по продаже иностранной валюты/драгоценного металла с совпадающей валютой лота и совпадающей сопряженной валютой, и наоборот, заключая сделку спот по продаже иностранной валюты/драгоценного металла одновременно заключает другую сделку спот по покупке иностранной валюты/драгоценного металла с совпадающей валютой лота и совпадающей сопряженной валютой. При этом сумма в валюте лота обеих сделок совпадает.

В случае если обязательство по сделке спот по продаже иностранной валюты/драгоценного металла является обязательством с более поздней датой исполнения, то сделка своп имеет направленность «покупка/продажа». В случае если обязательство по сделке спот по покупке иностранной валюты/драгоценного металла является обязательством с более поздней датой исполнения, то сделка своп имеет направленность «продажа/покупка».

**Сделка спот** – сделка купли-продажи иностранной валюты/драгоценного металла, при заключении которой Участник торгов покупает/продает валюту лота за сопряженную валюту на условиях, определяемых в соответствующей спецификации.

**Система Рейтер (Рейтер)** – программно-аппаратный комплекс, предоставляемый компанией «Томсон Рейтер», предназначенный для передачи информационных сообщений в ходе заключения сделок на организованных торгах Участниками торгов.

**Система Блумберг (Блумберг)** – программно-аппаратный комплекс, предоставляемый компанией «Блумберг», предназначенный для передачи информационных сообщений в ходе заключения сделок на организованных торгах Участниками торгов.

**Сопряженная валюта** – валюта, за которую производится покупка или продажа лотов инструмента.

**Спецификация** – каждый из утверждаемых Биржей по согласованию с Клиринговым центром документов, определяющих совокупность условий заключения своп контрактов/поставочных фьючерсных контрактов/сделок спот и сделок своп на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ОАО Московская Биржа, а также иные положения в соответствии с нормативными актами в сфере финансовых рынков.

**Средневзвешенный курс по инструменту (средневзвешенный курс)** – величина, определяемая в ходе торгов по соответствующему инструменту, численно равная отношению суммарного объема заключенных Участниками торгов сделок в сопряженной валюте к суммарному объему сделок в валюте лота.

**Технический доступ к ПТК ТЦ (технический доступ)** – техническая возможность использования Участником торгов необходимого ему набора функций одной или нескольких подсистем ПТК ТЦ.

**Технический центр (ТЦ)** – организация, обеспечивающая поддержку и функционирование ПТК ТЦ и предоставляющая Участникам торгов интегрированный технологический сервис. Техническим центром является ОАО Московская Биржа.

**Торговый идентификатор Участника торгов (торговый идентификатор)** – уникальный буквенно-цифровой код, присваиваемый Биржей Участнику торгов. Торговый идентификатор формируется на основе регистрационного кода Участника торгов, что подтверждает соответствие торгового идентификатора регистрационному коду Участника торгов и позволяет однозначно идентифицировать Участника торгов.

**Торговая система (ТС)** – подсистема ПТК ТЦ, предназначенная для заключения сделок с иностранной валютой и драгоценными металлами Участниками торгов, а также подготовки документов по итогам торгов в соответствии с Правилами торгов.

**Уполномоченный представитель Биржи** – лицо, надлежащим образом уполномоченное Биржей совершать от ее имени действия, предусмотренные настоящими Правилами торгов.

**Участники торгов** – Банк России, Клиринговый центр и организации, допущенные к организованным торгам после выполнения установленных Биржей условий допуска.

Положения настоящих Правил торгов об Участниках торгов применяются к Банку России и Клиринговому центру, если настоящими Правилами торгов для Банка России и Клирингового центра не предусмотрено специальных положений.

Участники торгов должны заключить с Биржей договор об оказании услуг по проведению организованных торгов.

**Цена своп контракта** – величина, указываемая Участником торгов при подаче заявки на заключение своп контракта в качестве его условия и определяющая разницу между базовым курсом своп контракта и итоговым курсом своп контракта, определенным на момент его заключения.

**Цена сделки своп** – величина, указываемая Участниками торгов при подаче заявки в качестве ее условия и используемая при расчете итогового курса сделки своп. Цена сделки своп численно равна разнице между итоговым и базовым курсом сделки своп (своп разница).

При подаче Участником торгов заявки на заключение внесистемной сделки типа «аукцион» цена сделки своп может указываться как в виде своп разницы, так и в виде рублевой процентной ставки, рассчитанной в соответствии с формулой расчета величины своп разницы для сделок валютный своп Банка России, опубликованной на сайте Банка России в сети интернет.

**Шаг цены** – минимально возможная разница между ценами, указанными в заявках одинаковой направленности.

Термины, специально не определенные в настоящих Правилах торгов, используются в значениях, установленных в Правилах клиринга, спецификациях и иных документах, утверждаемых Биржей.

# ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

* 1. Принципы заключения сделок на организованных торгах

### Настоящие Правила торгов определяют порядок заключения сделок с иностранной валютой и драгоценными металлами на валютном рынке и рынке драгоценных металлов Биржи, а также общий порядок взаимодействия Биржи с Участниками торгов.

Настоящие Правила торгов, все изменения и дополнения в них, а также дата и порядок вступления в силу Правил торгов утверждаются уполномоченным органом Биржи.

Утвержденные уполномоченным органом Биржи Правила торгов, а также изменения и дополнения в них, в том числе Правила торгов в новой редакции, раскрываются на сайте Биржи в сети интернет и вступают в силу не ранее чем через пять дней после дня раскрытия информации. Дата вступления в силу Правил торгов, изменений и дополнения в них, в том числе Правил торгов в новой редакции, также раскрывается на сайте Биржи в сети интернет.

Дополнительно информация об утверждении и вступлении в силу настоящих Правил организованных торгов, а также всех изменений и дополнений в них доводится до Клирингового центра и Участников торгов не позднее, чем за три рабочих дня до даты вступления их в силу путем направления информационного сообщения любым из следующих способов:

* 1. в электронной форме через Торговую систему;
  2. в форме электронного документа по электронной почте;
  3. иным способом.

### Биржа проводит организованные торги иностранной валютой и/или драгоценными металлами, в ходе которых Участниками торгов заключаются сделки в соответствии с настоящими Правилами торгов.

Банк России заключает сделки с иностранной валютой/драгоценными металлами в порядке, предусмотренном Правилами торгов, Правилами клиринга и договором о взаимодействии, заключаемым между Банком России, Биржей и Клиринговым центром.

### Клиринг по итогам организованных торгов на Бирже осуществляется с участием центрального контрагента, которым является Клиринговый центр. Клиринговый центр является стороной по всем сделкам, заключенным в соответствии с настоящими Правилами торгов.

### Торги иностранной валютой и (или) драгоценными металлами проводятся ежедневно, кроме установленных в соответствии с законодательством Российской Федерации выходных и праздничных нерабочих дней. Биржа по согласованию с Клиринговым центром вправе принять решение об отмене проведения торгов (в том числе по отдельным инструментам) в установленный в соответствии с законодательством Российской Федерации рабочий день и/или о проведении торгов (в том числе по отдельным инструментам) в установленный в соответствии с законодательством Российской Федерации выходной или праздничный нерабочий день.

Организованные торги иностранной валютой и/или драгоценными металлами проводятся Биржей с 10:00 до 23:50 по московскому времени.

Биржа по согласованию с Клиринговым центром устанавливает время проведения торгов по каждому из инструментов во Временном регламенте, раскрываемом Участникам торгов на сайте Биржи в сети интернет.

Обо всех изменениях, касающихся дня и/или времени проведения торгов (в том числе по отдельным инструментам), Биржа извещает Участников торгов не позднее, чем за три рабочих дня до даты введения указанных изменений в действие путем раскрытия информации на сайте Биржи в сети интернет.

В ходе проведения организованных торгов ПТК ТЦ обеспечивает защищенность и целостность заявок Участников торгов в ТС в результате применения комплекса организационных и технических мер, включающих в себя, в том числе:

* использование Участником торгов торгового идентификатора и пароля для аутентификации Участника торгов, получающего технический доступ к ПТК ТЦ;
* наличие специальной процедуры передачи Участнику торгов сведений о присвоенном торговом идентификаторе, обеспечивающей защиту данной информации от несанкционированного доступа;
* использование специальной технологии регистрации в ТС заявок, исключающей возможность изменения условий заявок после их регистрации в ТС (при условии строгого соблюдения Биржей, ТЦ и Участниками торгов положений настоящих Правил торгов, а также внутренних документов Биржи и ТЦ);
* использование специализированных программно-аппаратных средств, обеспечивающих однозначную идентификацию в промышленной сети связи Биржи рабочего места Участника торгов по IP-адресу;
* использование средств криптографической защиты информации Системы электронного документооборота ОАО Московская Биржа для обеспечения контроля целостности и защиты информации от несанкционированного доступа при передаче ее по сети связи общего пользования.

### Порядок использования Участниками торгов рабочих мест Участников торгов при подаче ими заявок и заключении сделок на организованных торгах посредством РМ Рейтер/РМ Блумберг устанавливается внутренними документами Биржи.

### Биржа в соответствии с настоящими Правилами торгов вправе принять решение о приостановке торгов:

* при необходимости изменения параметров, установленных ПТК ТЦ;
* в случаях, предусмотренных п. настоящих Правил торгов.

Биржа обязана приостановить или прекратить торги в случаях, порядке и сроки, предусмотренные соответствующими нормативными актами в сфере финансовых рынков, а также в случаях, установленных федеральными законами, и в случаях получения соответствующего предписания Банка России о приостановлении или прекращении торгов иностранной валютой.

При возобновлении торгов торги проводятся до окончания времени проведения торгов, за исключением случаев, предусмотренных п. настоящих Правил торгов, а также если иное не установлено соответствующими нормативными актами в сфере финансовых рынков, федеральными законами или предписанием (распоряжением) Банка России. При этом Участники торгов повторно выполняют все процедуры, необходимые для их аутентификации в ПТК ТЦ.

Информация о приостановлении, прекращении и возобновлении торгов раскрывается на сайте Биржи в сети интернет, если иное не предусмотрено соответствующими нормативными актами в сфере финансовых рынков и(или) настоящими Правилами торгов.

### Настоящие Правила торгов, а также все вытекающие из Правил торгов права и обязанности Биржи, Участников торгов и Уполномоченных участников торгов толкуются в соответствии с законодательством Российской Федерации. Сделки с иностранной валютой/драгоценными металлами, заключаемые на организованных торгах между Участниками торгов и Клиринговым центром, между Клиринговым центром и Уполномоченными участниками торгов, а также все вытекающие из указанных сделок права и обязанности Биржи, Клирингового центра, Участников торгов и Уполномоченных участников торгов регулируются законодательством Российской Федерации.

* 1. Общий порядок взаимодействия Биржи с Участниками торгов
     1. Порядок взаимодействия Биржи с Участниками торгов регулируется настоящими Правилами торгов и внутренними документами Биржи.
     2. Биржа обеспечивает допуск Участников торгов к организованным торгам иностранной валютой и/или драгоценными металлами и предоставляет отчетные документы по итогам торгов в соответствии с настоящими Правилами торгов и иными внутренними документами Биржи (далее – отчетные документы). Формы отчетных документов приведены во внутренних документах Биржи.
     3. Участник торгов, являющийся Участником клиринга, вправе:
* подавать заявки и заключать на организованных торгах сделки от своего имени и за свой счет (права и обязанности по таким сделкам возникают у Участника торгов);
* подавать заявки и заключать на организованных торгах сделки от своего имени в интересах и за счет клиента (права и обязанности по таким сделкам возникают у Участника торгов).

Участник торгов, в т.ч. не являющийся Участником клиринга, вправе:

* подавать заявки и заключать на организованных торгах сделки с указанием клирингового брокера (права и обязанности по таким сделкам возникают у клирингового брокера).

Участники торгов, заключающие сделки с драгоценными металлами в интересах и за счет клиентов, и не являющиеся брокерами, имеющими лицензию профессионального участника рынка ценных бумаг, включаются Биржей в соответствующий список, условия и порядок включения в который, а также условия и порядок исключения из которого устанавливаются Биржей.

При этом Участники торгов обязаны обеспечивать соответствие содержания заявок, подаваемых от своего имени и за свой счет, а также от своего имени и по поручению клиентов, требованиям нормативных правовых актов, регламентирующего порядок заключения сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами.

В целях обеспечения бесперебойного функционирования ТС Биржа вправе принять решение о приостановке возможности подачи, изменения и снятия заявок с использованием отдельного торгового идентификатора в день торгов, в течение которого на протяжении установленного Биржей периода времени превышалось:

* установленное внутренними документами Биржи среднее допустимое количество действий в секунду, выполняемых в ТС с использованием соответствующего торгового идентификатора, или
* установленное внутренними документами Биржи среднее допустимое количество сообщений об ошибке в секунду, формируемых в ТС вследствие ошибочных действий, выполняемых с использованием соответствующего торгового идентификатора.

При этом для целей настоящего пункта Правил торгов под действием, выполняемым с использованием торгового идентификатора в ТС, понимается: подача заявки, снятие заявки или изменение заявки.

Возможность подачи, изменения и снятия заявок с использованием торгового идентификатора приостанавливается до получения Биржей уведомления от Участника торгов об исправлении ошибок программного обеспечения, используемого Участником торгов (форма уведомления утверждается Биржей и раскрывается на сайте Биржи в сети интернет), а при повторном достижении критериев в течение данного дня торгов – до окончания данного дня торгов.

В случае приостановки возможности подачи, изменения и снятия заявок активные заявки, ранее поданные с использованием соответствующего торгового идентификатора, могут быть сняты по требованию Участника торгов в порядке, предусмотренном п. настоящих Правил торгов. При этом указание Участником торгов номеров активных заявок, поданных с использованием соответствующего торгового идентификатора, не требуется.

* + 1. Участник торгов уплачивает Бирже вознаграждение, которое рассчитывается и взимается Клиринговым центром в пользу Биржи на основании договора о взаимодействии, заключенного между Биржей и Клиринговым центром, и в соответствии с Правилами клиринга в отношении сделок, заключенных с использованием присвоенного Участнику торгов регистрационного кода. Участник клиринга, определенный в соответствии с Правилами клиринга, исполняет обязательства по уплате комиссионных вознаграждений Биржи и Технического центра за Участника торгов.

Банк России уплачивает Бирже вознаграждение в порядке, установленном договором о взаимодействии, заключенным между Банком России, Биржей и Клиринговым центром.

Клиринговый центр уплачивает Бирже вознаграждение в соответствии с договором о взаимодействии, заключенным между Клиринговым центром и Биржей.

* + 1. Биржа предоставляет Участникам торгов информацию, в том числе биржевую информацию, в объеме и порядке, как это предусмотрено законодательством Российской Федерации и настоящими Правилами торгов.

Биржа вправе предоставлять Участникам торгов биржевую информацию за плату, если иное не предусмотрено законодательством Российской Федерации. Тарифы на услуги по предоставлению Биржевой информации и порядок оплаты таких услуг определяются Биржей.

* + 1. В отношении информации, ставшей доступной Участнику торгов при использовании ТС, и не являющейся биржевой информацией, Участник торгов обязан соблюдать режим конфиденциальности, в том числе не передавать данную информацию своим клиентам, если иное не предусмотрено отдельным договором Участника торгов с Биржей и/или настоящими Правилами торгов и/или законодательством Российской Федерации.

Биржа вправе требовать от Участника торгов возмещения убытков, возникших у Биржи в связи с нарушением Участником торгов режима конфиденциальности информации, ставшей доступной Участнику торгов при использовании ТС.

* + 1. Участник торгов обязан:
* не раскрывать информацию, связанную с работой ТС, ставшую доступной Участнику торгов в процессе участия в торгах;
* предоставлять информацию, относящуюся к конкретному клиенту только непосредственно этому клиенту;
* использовать биржевую информацию исключительно в целях участия в торгах (принятия решения о подаче заявок и совершения сделок) на Бирже;
* заключать договоры с Биржей для использования биржевой информации в системах автоматического принятия решения о подаче заявок и заключения сделок на Бирже, в т.ч. с использованием торговых алгоритмов, а также для использования Биржевой информации в системах риск-менеджмента;
* заключать договоры с Биржей для использования биржевой информации в любых иных целях, не связанных с участием в торгах (принятием решения о подаче заявок и заключения сделок), включая использование биржевой информации для расчета производных показателей (цифровые данные, в том числе индексы и индикаторы, рассчитанные на основе биржевой информации), с целью их дальнейшего распространения; данное требование не относится к биржевой информации новостного и уведомительного характера (новости, объявления, информация о событиях и мероприятиях);

- в случае предоставления клиенту биржевой информации предупреждать клиента в письменной форме (под роспись об ознакомлении), что он может использовать биржевую информацию только в целях принятия решения о подаче заявок Участнику торгов для заключения сделок на Бирже, а также о мерах ответственности за нарушения при использовании биржевой информации, предусмотренных п. 2.2.10 настоящих Правил торгов;

- соблюдать требования настоящих Правил торгов, Порядка использования Биржевой информации, предоставляемой ОАО Московская Биржа и иных внутренних документов Биржи.

2.2.8 В случае распространения Участником торгов и/или его клиентом биржевой информации или использования этой информации для расчета производных показателей (цифровые данные, в том числе индексы и индикаторы, рассчитанные на основе биржевой информации), с целью их дальнейшего распространения, или в иных целях, не предусмотренных настоящими Правилами торгов, без заключения договора с Биржей, Участник торгов несет ответственность в порядке, предусмотренном в п. 2.2.9 настоящих Правил торгов. Положения настоящего абзаца не относятся к биржевой информации новостного и уведомительного характера (новости, объявления, информация о событиях и мероприятиях).

Не является распространением биржевой информации и не влечет применение мер ответственности в соответствии с настоящим пунктом предоставление Участником торгов своему клиенту биржевой информации в объеме, необходимом для принятия решения о подаче заявок Участнику торгов для заключения сделок на Бирже, а также об итогах торгов в отношении сделок, заключенных в интересах этого Клиента.

* + 1. В случае распространения и/или предоставления Участником торгов биржевой информации третьим лицам, не являющимся клиентами, неисполнения обязанности, предусмотренной п. 2.2.10 настоящих Правил торгов, а также использования Участником торгов биржевой информации с нарушением порядка, изложенного в п. 2.2.7 настоящих Правил торгов, к Участнику торгов может быть применена одна из следующих мер ответственности:
* предупреждение о нарушении в письменном виде;
* штраф в размере 250 000 (Двести пятьдесят тысяч) рублей;
* приостановление допуска к участию в торгах на срок до одного года;
* прекращение допуска к участию в торгах.
  + 1. В случае использования клиентом биржевой информации в целях, отличных от целей принятия решения о подаче заявок Участнику торгов для заключения сделок на Бирже, Участник торгов обязан применить к клиенту одну из следующих мер ответственности:
* предупреждение о нарушении в отношении использования биржевой информации в письменном виде;
* приостановка предоставления клиенту биржевой информации до устранения допущенных клиентом нарушений в отношении использования биржевой информации.
  + 1. Биржа или лицо, действующее от имени Биржи, вправе осуществлять действия по проверке корректности использования Участником торгов биржевой информации, предоставленной ему Биржей (далее – информационный аудит).

Информационный аудит проводится с предварительным уведомлением Участника торгов в порядке, исключающим создание каких-либо препятствий в осуществлении им своей профессиональной деятельности.

Условия и процедура проведения информационного аудита определены в Порядке использования Биржевой информации, предоставляемой ОАО Московская Биржа.

Порядок использования Биржевой информации, предоставляемой ОАО Московская Биржа, раскрывается на официальном сайте ОАО Московская Биржа в сети интернет.

* + 1. В случае нарушения Участником торгов требований настоящих Правил торгов, иных внутренних документов Биржи, касающихся порядка участия в торгах, в т.ч. в случаях нарушения порядка подачи заявок и заключения сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами к Участникам торгов могут быть применены меры воздействия в соответствии с Правилами допуска и законодательством Российской Федерации.
  1. Общий порядок взаимодействия Биржи с Клиринговым центром
     1. Порядок взаимодействия Биржи и Клирингового центра при проведении организованных торгов и исполнении обязательств по итогам клиринга регулируется настоящими Правилами торгов, Правилами клиринга, а также договорами, заключаемыми между Клиринговым центром и Биржей.

Правила клиринга, а также все изменения и дополнения к ним утверждаются Клиринговым центром после согласования с Биржей.

* 1. Общий порядок взаимодействия Биржи с Банком России
     1. Банк России вправе:
* получать полную информацию о заявках и сделках Участников торгов;
* направлять Бирже предписания (распоряжения) о приостановке, прекращении или возобновлении торгов;
* направлять Бирже обязательные для исполнения распоряжения о приостановлении допуска к торгам или прекращении допуска к торгам иностранной валютой Участников торгов.

# ПРОВЕДЕНИЕ ТОРГОВ

## **Общие положения**

# Заключение Участниками торгов, кроме Банка России и Клирингового центра, сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами на организованных торгах допускается только при условии положительного результата проверки возможности заключения каждой такой сделки. Указанная проверка осуществляется Клиринговым центром в соответствии с Правилами клиринга исходя из анализа изменения значения единого лимита Участника клиринга, по расчетному коду, указанному в заявке. Порядок расчета единого лимита Участника клиринга и порядок проведения указанной проверки определены Правилами клиринга. Банк России и Клиринговый центр заключают сделки с иностранной валютой и/или драгоценными металлами на торгах без проведения указанной проверки и без обеспечения.

# В ходе торгов проверка возможности заключения сделок на торгах Участником торгов осуществляется Клиринговым центром на основании информации, доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

# Иностранная валюта/драгоценный металл допускаются к организованным торгам на Бирже путем введения в действие спецификации, содержащей инструмент (инструменты) по соответствующей валюте/драгоценному металлу.

Допуск иностранной валюты/драгоценного металла к организованным торгам на Бирже прекращается с даты прекращения действия всех спецификаций, содержащих инструменты по соответствующей валюте/драгоценному металлу.

# Заключение сделок, являющихся производными финансовыми инструментами, на валютном рынке и рынке драгоценных металлов Биржи возможно начиная с даты введения в действие спецификации соответствующего производного финансового инструмента, если иное не установлено решением Биржи.

Заключение сделок, являющихся производными финансовыми инструментами, на валютном рынке и рынке драгоценных металлов Биржи прекращается с даты прекращения действия спецификации соответствующего производного финансового инструмента, если иное не установлено решением Биржи.

При возникновении обстоятельств, которые приводят к существенному изменению условий или к прекращению обращения базисного актива, в связи с чем становится невозможным исполнение сделки, являющейся производным финансовым инструментом в установленном порядке, Биржа вправе принять решение о приостановлении или прекращении заключения соответствующих сделок.

# После прекращения (устранения) обстоятельств, приведших к существенному изменению условий или к прекращению обращения базисного актива, в связи с чем было приостановлено или прекращено заключение сделок, являющихся производными финансовыми инструментами, Биржа вправе принять решение о возобновлении заключения сделок с производными финансовыми инструментами с данным базисным активом.

# Заявки Участника торгов, зарегистрированные в ТС и подписанные АСП Участника торгов, признаются электронными документами, равнозначными документам, совершенным в письменной форме.

# При подаче электронных сообщений, подписанных АСП Участника торгов, Биржа осуществляет идентификацию лица, подписавшего электронное сообщение, путем проверки соответствия АСП Участника торгов, содержащегося в электронном сообщении, торговому идентификатору, присвоенному Биржей Участнику торгов.

Сведения о присвоенном торговом идентификаторе относятся к конфиденциальным. Участники торгов и Биржа обеспечивают соблюдение требований о конфиденциальности.

# Условия заключения сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами (лот, точность указания цены заявок, шаг цены и др.) устанавливаются в соответствующих спецификациях.

# Биржа извещает Участников торгов о введении в действие, прекращении действия спецификаций, о внесении в спецификации изменений не позднее, чем за три рабочих дня до даты введения спецификаций в действие, прекращении действия спецификаций, вступления в силу изменений в спецификации.

## **Аутентификация участников торгов**

## Аутентификация Участников торгов, принимающих участие в торгах посредством РМ УРМ, проводится перед началом торгов в соответствии со следующей процедурой:

## В ТС Участником торгов вводится торговый идентификатор и пароль. Пароль устанавливается непосредственно Участником торгов на его рабочем месте.

## В ходе аутентификации Биржа проверяет соответствие торгового идентификатора регистрационному коду Участника торгов.

# Аутентификация Участников торгов, принимающих участие в торгах посредством РМ Рейтер/РМ Блумберг, производится в момент подачи заявки путем проверки Биржей соответствия торгового идентификатора уникальному символьному коду, закрепленному за Участниками торгов в системе Рейтер/Блумберг, соответствующему регистрационному коду Участника торгов, присваиваемому Биржей в соответствии с внутренними документами Биржи.

# Аутентификация РМ ВПТС Участника торгов, производится перед началом торгов путем проверки Биржей соответствия торгового идентификатора регистрационному коду Участника торгов, присваиваемому Биржей в соответствии с внутренними документами Биржи.

## **Порядок заключения сделок на торгах**

* + 1. Заключение сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами на торгах осуществляется путем подачи Участниками торгов заявок в ТС посредством электронных сообщений, подписанных АСП Участника торгов, с использованием рабочих мест Участников торгов. Заявка признается электронным документом, равнозначным документу, подписанному собственноручной подписью Участника торгов.

# Заключение сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами на организованных торгах осуществляется путем обмена электронными документами посредством электронной связи, позволяющей установить, что указанные в настоящем пункте документы исходят от Участника торгов.

# До начала торгов по каждому инструменту Биржа осуществляет контроль наличия, а в случае необходимости - ввод следующих параметров в ТС: время начала и окончания торгов, размер лота.

# До начала торгов и в ходе торгов Биржа осуществляет взаимодействие с Банком России, выполняя следующие функции:

* получение и выполнение письменных предписаний (распоряжений) Банка России, касающихся проведения торгов. Письменные предписания (распоряжения) передаются по факсу с дублированием по телефону и последующей передачей Бирже оригинала соответствующего письменного распоряжения;
* информирование Клирингового центра о полученных распоряжениях Банка России по телефону с последующим письменным уведомлением.

# С момента начала торгов и после аутентификации Участники торгов имеют право подавать в ТС заявки на заключение сделок, а также снимать и изменять ранее поданные ими и зарегистрированные в ТС заявки, неисполненные полностью или частично.

# При регистрации и снятии заявок в ТС фиксируется время совершения соответствующего действия.

# Участник торгов, подавший заявку на заключение сделки в соответствии с Правилами торгов, действующими на день подачи такой заявки, приобретает все права и обязанности, предусмотренные Правилами торгов, действующими на день подачи такой заявки.

# При наличии отрицательного единого лимита Участника клиринга, по определенному расчетному коду, Участник торгов имеет право совершать по такому расчетному коду следующие действия, при условии, что эти действия не приведут к дальнейшему уменьшению единого лимита:

* подавать в ТС заявки на заключение сделок в соответствии с настоящими Правилами торгов;
* изменять ранее поданные и зарегистрированные в ТС заявки, неисполненные полностью или частично.

# Всякий раз, когда Участник торгов подает в ТС заявку на заключение сделки, заявка посредством ПТК ТЦ становится доступной Клиринговому центру. Клиринговый центр осуществляет в ходе торгов проверку возможности регистрации в ТС заявки в порядке, определенном Правилами клиринга.

# Информация о результатах проверки возможности регистрации в ТС заявки в ходе торгов посредством ПТК ТЦ становится доступной Бирже.

# Если результат проверки возможности регистрации в ТС заявки отрицательный, то Биржа не регистрирует в ТС такую заявку.

# Если результат проверки возможности регистрации в ТС заявки положительный, то Биржа регистрирует в ТС такую заявку.

# Заявки Участников торгов регистрируются в ТС путем внесения записи в реестр заявок, формируемый в соответствии с п. настоящих Правил торгов.

# Каждая заявка, вновь зарегистрированная в ТС, проверяется Биржей посредством ТС на наличие в очереди допустимых встречных заявок. По результатам проверки определяются две допустимые встречные заявки, которыми признаются вновь зарегистрированная заявка и допустимая встречная к ней заявка.

# Сделка на торгах считается заключенной в момент определения в ТС двух допустимых встречных заявок путем внесения Биржей записи о заключении сделки в реестр сделок, за исключением случаев, предусмотренных настоящими Правилами торгов.

# Цена каждой из сделок (курс сделки) равна цене, указанной в допустимой встречной заявке, которая стоит первой в очереди заявок. Объем каждой из сделок равен минимальному объему из указанных в двух допустимых встречных заявках.

Порядок определения значения цены (курса сделки) и объема каждой сделки, входящей в сделку с Бивалютной корзиной, устанавливается решением Биржи по согласованию с Клиринговым центром и Банком России.

# В момент определения среди стоящих в очереди заявок двух допустимых встречных заявок либо при наличии двух зарегистрированных в ТС допустимых встречных заявок на заключение внесистемной сделки, Биржа вносит в реестр сделок записи о заключении двух сделок между каждым из Участников торгов и Клиринговым центром. Информация о каждых двух зарегистрированных сделках посредством ПТК ТЦ становится доступной Клиринговому центру.

# После заключения каждых двух сделок, не являющихся внесистемными, текущая цена последних двух сделок и текущее значение средневзвешенного курса автоматически обновляется. Информация о новом значении цены последних двух сделок и новом значении средневзвешенного курса посредством ПТК ТЦ становится доступной Клиринговому центру.

# Реестр сделок формируется в соответствии с п. настоящих Правил торгов. При внесении в реестр сделок записей о каждых двух заключенных сделках объем каждой из заявок, являющихся допустимыми встречными заявками, уменьшается в ТС на объем заключенной сделки.

# Указанная последовательность осуществляемых в ТС действий повторяется до тех пор, пока либо вновь зарегистрированная заявка, являющаяся допустимой встречной заявкой, не будет исполнена полностью, либо в очереди заявок не останется ни одной допустимой встречной заявки.

# Две зарегистрированные в ТС допустимые встречные заявки на заключение внесистемной сделки исполняются немедленно и полностью по цене, указанной в заявках.

# При отсутствии в очереди допустимых встречных заявок вновь зарегистрированная заявка целиком ставится в очередь или удаляется из ТС в зависимости от вида и типа заявки.

# Если вновь зарегистрированная заявка, являющаяся допустимой встречной заявкой, после заключения сделок на основании всех находящихся в очереди допустимых встречных заявок в соответствии с процедурой, описанной в п. настоящих Правил торгов, исполнена частично, то ее остаток остается в очереди или удаляется из очереди. Остаток исполненной частично заявки удаляется из очереди заявок в следующих случаях:

* исполненная частично заявка имеет тип «снять остаток»;
* исполненная частично заявка является рыночной или лимитированной заявкой типа «поставить в очередь» и имеет цену не большую, чем цена покупки (не меньшую, чем цена продажи), указанная во встречной заявке, стоящей первой в очереди. При этом:
* исполненная частично заявка и встречная заявка, стоящая первой в очереди, поданы одним и тем же Участником торгов с использованием одного и того же или разных регистрационных кодов данного Участника торгов при заключении им сделок от своего имени и за свой счет;
* исполненная частично заявка и встречная заявка, стоящая первой в очереди, поданы одним и тем же Участником торгов или разными Участниками торгов при заключении им сделок от своего имени и по поручению одного и того же Клиента.

# Информация о наличии или отсутствии в очереди неисполненных заявок посредством ПТК ТЦ становится доступной Клиринговому центру.

# При обработке заявки типа «немедленно или отклонить» описанная в п. настоящих Правил торгов процедура заключения сделок при наличии в очереди допустимых встречных заявок повторяется до полного исполнения указанной заявки.

# Клиринговый центр в целях урегулирования случаев неисполнения или ненадлежащего исполнения обязательств по сделкам с иностранной валютой/драгоценными металлами и/или в случаях, когда это необходимо в целях исполнения Клиринговым центром своих обязательств на других рынках, на которых Клиринговый центр осуществляет функции клиринговой организации и/или центрального контрагента, либо в иных случаях, установленных Правилами клиринга, Клиринговый центр вправе подавать в ТС заявки и заключать сделки на основании заявок, поданных Клиринговым центром или Участником торгов.

# В ходе торгов Клиринговый центр вправе заключать сделки без подачи заявок в случаях, предусмотренных настоящими Правилами торгов и/или Правилами клиринга.

# Процедура снятия заявки происходит в следующем порядке: при полностью исполненной заявке Участник торгов информируется о невозможности ее снятия; если же неисполненная полностью или частично заявка находится в очереди, то такая заявка снимается Участником торгов и удаляется из очереди.

# Информация о снятия заявки посредством ПТК ТЦ становится доступной Клиринговому центру.

# Процедура изменения заявки происходит в следующем порядке: при полностью исполненной заявке Участник торгов информируется о невозможности ее изменения; если же неисполненная полностью или частично заявка находится в очереди, то для ее изменения такая заявка снимается Участником торгов и удаляется из очереди, после чего Участником торгов вновь подается в ТС заявка с измененными условиями (цена и объем) в соответствии с порядком, предусмотренном п.п. и настоящих Правил торгов, обработка заявок осуществляется в соответствии с п.п. – настоящих Правил торгов.

# В ходе торгов Бирже посредством ПТК ТЦ доступна следующая сформированная Клиринговым центром информация об Участнике клиринга, за которым закреплен расчетный код, который Участник торгов вправе указывать при подаче заявок:

* о размере обеспечения по расчетному коду Участника клиринга в каждой валюте/каждом драгоценном металле;
* о размере единого лимита по расчетному коду Участника клиринга;
* о размере торгового лимита по расчетному коду Участника клиринга (в случае если для Участника клиринга установлен торговый лимит);
* о значении нетто-обязательства и/или нетто-требования по расчетному коду Участника клиринга в каждой валюте/каждом драгоценном металле и с каждой датой исполнения;
* о сумме обеспечения по расчетному коду Участника клиринга в каждой валюте/каждом драгоценном металле, недостающего для исполнения нетто-обязательства Участника клиринга в соответствующей валюте/соответствующем драгоценном металле с наступившей датой исполнения;
* о значении нетто-обязательства и/или нетто-требования по расчетному коду Участника клиринга по поручениям на управление риском;
* о наличии/отсутствии маржинального требования по расчетному коду Участника клиринга, о сумме маржинального требования в российских рублях (в случае наличия);
* о наличии/отсутствии задолженности по расчетному коду Участника клиринга перед Клиринговым центром, о сумме задолженности Участника клиринга (в случае наличия).

# Указанная выше информация предоставляется Биржей Участнику торгов посредством рабочего места Участника торгов, а в случае необходимости указанная информация может быть предоставлена Участнику торгов уполномоченным представителем Биржи.

# Срок действия заявки, зарегистрированной в ТС, ограничивается временем проведения торгов.

# Подача Участником торгов заявки на заключение сделки спот/поставочного фьючерса осуществляется в ТС посредством электронного сообщения, подписанного АСП Участника торгов и содержащего, в том числе, следующие данные (условия заявки):

* краткий код клиента (при подаче Участником торгов заявки на заключение сделки в интересах клиента);
* расчетный код Участника клиринга, в том числе являющегося клиринговым брокером;
* идентификатор Участника клиринга;
* наименование сделки спот/поставочного фьючерса;
* направленность заявки: на продажу или на покупку;
* количество лотов;
* дату исполнения обязательств (для поставочных фьючерсов указывается Участником торгов, формируется в ТС, для сделок спот – формируется в ТС исходя из наименования сделки спот, выбранной Участником торгов);
* вид заявки из возможных стандартных видов;
* тип заявки из возможных стандартных типов;
* в случае лимитированной заявки или рыночной заявки типа «поставить в очередь» – предельную цену продажи или покупки, указываемую в сопряженной валюте с точностью, установленной в спецификации соответствующего инструмента.

# Подача Участником торгов заявки на заключение сделки своп/своп контракта осуществляется в ТС посредством электронного сообщения, подписанного АСП Участника торгов и содержащего, в том числе, следующие данные (условия заявки):

* краткий код клиента (при подаче Участником торгов заявки на заключение сделки в интересах клиента);
* расчетный код Участника клиринга, в том числе являющегося клиринговым брокером;
* идентификатор Участника клиринга;
* наименование сделки своп/своп контракта;
* направленность заявки: на продажу/покупку или на покупку/продажу;
* количество лотов;
* даты исполнения обязательств по сделкам спот, входящим в сделку своп, даты исполнения обязательств по своп контракту (формируется в ТС, исходя из наименования сделки своп/своп контракта, выбранного Участником торгов);
* цену продажи/покупки или покупки/продажи.

# В ходе торгов Участники торгов вправе заключать внесистемные сделки. Обработка всех заявок на заключение внесистемных сделок, в том числе заявок на заключение внесистемных сделок типа «Всем», подаваемых в ТС, производится в соответствии с п.п. - настоящих Правил торгов. Заявки на заключение внесистемных сделок, в том числе заявки на заключение внесистемных сделок типа «Всем», не включаются в очередь заявок.

# Каждая заявка на заключение внесистемной сделки, в том числе заявка на заключение внесистемной сделки типа «Всем», вновь регистрируемая в ТС после прохождения процедуры контроля ограничений в ходе торгов по соответствующей валюте проверяется Биржей посредством ТС на наличие допустимых встречных заявок.

# Заключение внесистемных сделок осуществляется в порядке, предусмотренном п.п. настоящих Правил торгов.

# Подача Участником торгов заявки на заключение внесистемной сделки спот или поставочного фьючерса осуществляется в ТС посредством электронного сообщения, подписанного АСП Участника торгов и содержащего, в том числе, следующие данные (условия заявки):

* краткий код клиента (при подаче Участником торгов заявки на заключение внесистемной сделки в интересах клиента);
* расчетный код Участника клиринга, в том числе являющегося клиринговым брокером;
* идентификатор Участника клиринга;
* наименование сделки спот/поставочного фьючерса;
* направленность заявки: на продажу или на покупку;
* количество лотов;
* дату исполнения обязательств (для поставочных фьючерсов указывается Участником торгов, для сделок спот – формируется в ТС исходя из наименования сделки спот, выбранной Участником торгов);
* Участника торгов в качестве конечного контрагента по внесистемной сделке либо специальный код «Всем» в заявке на заключение внесистемной сделки типа «Всем»;
* цену продажи или покупки по сделке спот/поставочному фьючерсу.

# Подача Участником торгов заявки на заключение внесистемной сделки своп или внесистемного своп контракта осуществляется в ТС посредством электронного сообщения, подписанного АСП Участника торгов и содержащего, в том числе, следующие данные (условия заявки):

* краткий код клиента (при подаче Участником торгов заявки на заключение сделки в интересах клиента);
* расчетный код Участника клиринга, в том числе являющегося клиринговым брокером;
* идентификатор Участника клиринга;
* наименование сделки своп/своп контракта;
* направленность заявки: на продажу/покупку или на покупку/продажу;
* количество лотов;
* даты исполнения обязательств по сделкам спот, входящим в сделку своп, даты исполнения обязательств по своп контракту (формируется в ТС, исходя из наименования сделки своп/своп контракта, выбранного Участником торгов);
* цену продажи/покупки или покупки/продажи;
* Участника торгов в качестве конечного контрагента по внесистемной сделке своп/своп контракту.

# В случае получения Биржей от Клирингового центра уведомления о проведении ранних расчетов по указанному в таком уведомлении расчетному коду Участника клиринга в день получения такого уведомления прекращается до окончания торгов текущего дня проведения торгов возможность подачи заявок, направленных на заключение сделок по инструментам со сроком исполнения обязательств в день проведения торгов, с указанием данного расчетного кода. При этом все неисполненные заявки с указанием такого расчетного кода снимаются уполномоченным представителем Биржи и удаляются из очереди заявок. Участникам торгов, которые вправе подавать заявки с указанием расчетного кода, указанного в уведомлении о проведении ранних расчетов, выдаются отчетные документы в соответствии с настоящими Правилами торгов.

# В случае получения Биржей от Клирингового центра уведомления о раннем завершении заключения сделок с Клиринговым центром по указанному в таком уведомлении расчетному коду Участника клиринга в день получения такого уведомления прекращается до окончания торгов текущего дня проведения торгов возможность подачи заявок с указанием данного расчетного кода. При этом все неисполненные заявки с указанием такого расчетного кода снимаются уполномоченным представителем Биржи и удаляются из очереди заявок. Участникам торгов, которые вправе подавать заявки с указанием расчетного кода, указанного в уведомлении о раннем завершении заключения сделок с Клиринговым центром, выдаются отчетные документы в соответствии с настоящими Правилами торгов.

# Помимо информации, предоставляемой в соответствии с п. настоящих Правил торгов Биржа предоставляет Участнику торгов посредством рабочего места Участника торгов во время и по окончании торгов биржевую информацию и следующую информацию, относящуюся непосредственно к данному Участнику торгов:

* о поданных данным Участником торгов заявках, зарегистрированных в ТС и находящихся в очереди, заявках на заключение внесистемных сделок, в том числе заявках на заключение внесистемных сделок типа «Всем», зарегистрированных в ТС, а также о заявках, по которым заключены сделки;
* о заключенных данным Участником торгов сделках.

# В ходе торгов Участники торгов вправе заключать внесистемные сделки своп/своп контракты в режиме аукциона с Банком России.

# Не позднее, чем за один час до начала проведения торгов в режиме аукциона с Банком России Банк России посредством электронного документа, сформированного в соответствии с Правилами ЭДО и/или документа на бумажном носителе, подписанного уполномоченным представителем Банка России, доводит до сведения Биржи следующую информацию об условиях такого аукциона:

* временной регламент проведения аукциона с Банком России;
* даты исполнения сделок своп/своп контрактов для данного аукциона с Банком России;
* минимальная/максимальная цена заявок на заключение сделок своп/своп контрактов;
* максимальный объем заявок на заключение сделок своп/своп контрактов в ходе аукциона с Банком России, которые могут быть поданы одним Участником торгов по одной цене;
* перечень валютных пар, с которыми заключаются сделки своп/своп контракты в ходе аукциона с Банком России.

# Банк России вправе предоставить Бирже информацию, указанную в п. 3.3.29 настоящих Правил торгов (всю или частично) без указания конкретного аукциона с Банком России, на который распространяются соответствующие условия. В этом случае такие условия распространяются на все аукционы с Банком России, проводимые после получения Биржей от Банка России указанной информации в форме, предусмотренной в подпункте 3.3.29 настоящих Правил торгов. При этом информация об условиях проведения аукциона с Банком России, переданная Банком России Бирже для проведения конкретного аукциона с Банком России перед началом его проведения (но не позднее, чем за один час до начала проведения) имеет приоритет в отношении этого аукциона с Банком России перед информацией, переданной Банком России Бирже ранее без указания конкретного аукциона с Банком России, на который распространяются соответствующие условия.

# Биржа до начала аукциона с Банком России средствами ТС доводит полученную от Банка России в соответствии с п. 3.3.29 настоящих Правил торгов информацию до сведения Участников торгов, допущенных Банком России к участию в аукционе с Банком России.

# В установленное Банком России время Участники торгов имеют право вводить в ТС неограниченное число заявок на заключение внесистемных сделок типа «аукцион».

Подача Участником торгов заявки на заключение внесистемной сделки типа «аукцион» осуществляется в ТС посредством электронного сообщения, подписанного АСП Участника торгов и содержащего, в том числе, следующие данные (условия заявки):

* краткий код Клиента (при подаче Участником торгов заявки на заключение сделки в интересах клиента);
* расчетный код Участника клиринга, в том числе являющегося клиринговым брокером;
* идентификатор Участника клиринга;
* наименование сделки своп/своп контракта;
* направление заявки;
* количество лотов;
* даты исполнения сделки своп/своп контракта (формируется в ТС, исходя из наименования сделки своп/своп контракта, выбранного Участником торгов);
* специальный код «аукцион»;
* цену сделки своп/своп контракта.

# Обработка всех заявок на заключение внесистемных сделок типа «аукцион», подаваемых в ТС, производится в соответствии с п.п. 3.3.6 – 3.3.8 настоящих Правил торгов.

# Участник торгов вправе снять заявку на заключение сделки своп/своп контракта в режиме аукциона с Банком России, введенную им в ТС, до окончания установленного Банком России времени приема заявок на заключение сделок своп/своп контрактов в ходе аукциона с Банком России.

# В режиме аукциона с Банком России прием и снятие заявок Участников торгов на заключение сделок своп/своп контрактов прекращается после окончания времени приема заявок на заключение сделок своп/своп контрактов в режиме аукциона с Банком России.

# По итогам приема заявок Участников торгов на заключение сделок своп/своп контрактов в ходе аукциона с Банком России Банк России средствами ТС формирует сводный реестр принятых (зарегистрированных) заявок на заключение сделок своп/своп контрактов в режиме аукциона с Банком России.

# В установленное Банком России для данного аукциона с Банком России время в ответ на зарегистрированные в ТС заявки Участников торгов на заключение сделок своп/своп контрактов от имени Банка России в ТС вводятся встречные заявки Банка России с указанием минимальной/максимальной цены сделок своп/своп контрактов.

Заявка Участника торгов на заключение сделки своп/своп контракта в ходе аукциона с Банком России удовлетворяется по цене, указанной в данной заявке, при условии, что цена в ней не ниже минимальной/не выше максимальной цены сделок своп/своп контрактов. Допускается частичное удовлетворение заявок Участников торгов.

# Одновременно с регистрацией в ТС встречных заявок Банка России в ответ на удовлетворяемые заявки Участников торгов на заключение сделок своп/своп контрактов в ходе аукциона с Банком России в ТС производится регистрация соответствующих сделок своп/своп контрактов в порядке, предусмотренном п.п. 3.3.9 – 3.3.11 настоящих Правил торгов.

# По окончании аукциона с Банком России в ТС автоматически снимаются все неудовлетворенные заявки Участников торгов на заключение сделок своп/своп контрактов в ходе аукциона с Банком России.

# Заявки, поданные в ТС с нарушением настоящих Правил торгов, в том числе в результате технических сбоев и/или ошибок в работе средств проведения торгов (включая сбои в работе программного обеспечения), программно-технических средств, информационно-коммуникационных средств связи, с помощью которых обеспечивается проведение организованных торгов, не регистрируются в ТС.

Сделки с иностранной валютой/драгоценными металлами, заключенные с нарушением настоящих Правил торгов в результате технических сбоев и/или ошибок в работе средств проведения торгов (включая сбои в работе программного обеспечения), программно-технических средств, информационно-коммуникационных средств связи, с помощью которых обеспечивается проведение организованных торгов, могут быть признаны незаключенными.

## **Особенности заключения сделок на торгах с использованием РМ Рейтер/РМ Блумберг**

# Для Участников торгов, принимающих участие в торгах с использованием РМ Рейтер/РМ Блумберг, подача/прием заявок на заключение сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами осуществляется путем обмена текстовыми сообщениями между Участниками торгов и Биржей в соответствии с требованиями настоящих Правил торгов, а также требованиями к оформлению сообщений при подаче заявок Участником торгов посредством системы передачи информации Рейтер/Блумберг. Данные требования и изменения к ним утверждаются решением Биржи.

# Текстовые сообщения, полученные от Участника торгов с использованием РМ Рейтер/РМ Блумберг, транслируются в ТС в виде заявок на заключение сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами.

# Участники торгов несут полную ответственность за подаваемые с использованием РМ Рейтер/РМ Блумберг заявки на заключение сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами.

# Подтверждением подачи/приема заявки на заключением сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами с использованием РМ Рейтер/РМ Блумберг является протокол, содержащий текст переговоров между Участником торгов и Биржей по системе Рейтер/Блумберг, который выражает не требующее дополнительного подтверждения согласие Участника торгов на заключение сделки в соответствии с настоящими Правилами торгов, а также иными внутренними документами Биржи.

# При заключении сделок на торгах с использованием РМ Рейтер/РМ Блумберг заявка Участника торгов считается поданной в ТС с момента получения таким Участником торгов подтверждения от Биржи о приеме данной заявки.

# После подачи заявки в ТС с использованием РМ Рейтер/РМ Блумберг производится обработка такой заявки в соответствии с п.п.- настоящих Правил торгов.

# Заключение сделок по заявкам, поданным в ТС с использованием РМ Рейтер/РМ Блумберг, осуществляется в порядке, предусмотренном п.п. - настоящих Правил торгов.

## **Порядок действий при неработоспособности рабочего места Участника торгов**

# Под неработоспособностью рабочего места Участника торгов подразумеваются обстоятельства, возникшие при эксплуатации программно-технических средств на удаленном рабочем месте Участника торгов и повлекшие за собой невозможность дальнейшего участия в торгах Участника торгов в течение какого-либо периода времени при отсутствии приостановки торгов.

# В случае неработоспособности рабочего места Участника торгов или в случае приостановки возможности подачи, изменения и снятия заявок с использованием отдельного торгового идентификатора в соответствии с п. настоящих Правил торгов Участник торгов информирует об этом уполномоченного представителя Технического центра. Участник торгов может направить уполномоченному представителю Биржи заявление о снятии его активных заявок с использованием телефонной связи, факсимильной связи, посредством другого типа рабочего места Участника торгов (далее – средства связи). Заявление Участника торгов о снятии его активных заявок должно содержать следующую информацию:

* торговый идентификатор Участника торгов;
* регистрационный код Участника торгов или код, закрепленный за Участником торгов в системе Рейтер/Блумберг;
* номера активных заявок, поданных Участником торгов посредством ПТК ТЦ с использованием регистрационного кода Участника торгов или кода, закрепленного за Участником торгов в системе Рейтер**/**Блумберг, которые нужно снять, или указание на то, что нужно снять активные заявки, поданные Участником торгов посредством ПТК ТЦ с использованием регистрационного кода Участника торгов, или кода, закрепленного за Участником торгов в системе Рейтер/Блумберг.

# В случае если реквизиты запроса корректны, а номера активных заявок совпадают с находящимися в ТС номерами активных заявок, поданных Участником торгов, Биржа вправе снять активные заявки в соответствии с запросом Участника торгов. В случае если номера активных заявок, указанные в запросе, не совпадают с номерами активных заявок находящихся в ТС, поданных Участником торгов и/или реквизиты запроса Участника торгов некорректны, такой запрос отклоняется, о чем уполномоченный представитель Биржи информирует Участника торгов с использованием одного из средств связи.

# В случае неработоспособности рабочего места Участника торгов по причине сбоя в системе Рейтер/Блумберг заявки, принятые до возникновения неработоспособности рабочего места Участника торгов, не аннулируются. Исполнение Участником торгов своих обязательств по сделкам, заключенным на основании заявок, поданных им с использованием РМ Рейтер/РМ Блумберг до возникновения неработоспособности рабочего места Участника торгов осуществляется в соответствии с Правилами клиринга.

# Участник торгов может подать постоянный запрос на проверку работоспособности рабочего места и автоматическое удаление активных заявок (далее – постоянный запрос) на случай неработоспособности рабочего места Участника торгов (за исключением РМ Рейтер/РМ Блумберг) или на случай приостановки возможности подачи, изменения и снятия заявок с использованием отдельного торгового идентификатора.

После получения постоянного запроса Биржа в течение трех рабочих дней активирует для участника функционал проверки работоспособности и автоматического удаления активных заявок при условии соответствия программно-технических средств Участника торгов требованиям, установленным Биржей и раскрываемым на сайте Биржи в сети Интернет.

После активации Биржей для Участника торгов данного функционала Биржа вправе автоматически удалять активные заявки из Торговой системы в ходе торгов в случае невозможности подтверждения работоспособности рабочего места Участника торгов и/или приостановки возможности подачи, изменения и снятия заявок с использованием отдельного торгового идентификатора. Проверка работоспособности рабочего места осуществляется в порядке, установленном Биржей и раскрываемом на сайте Биржи в сети Интернет.

В случае если до момента автоматического удаления Биржей активных заявок такие заявки уже исполнены, они не могут быть удалены Биржей.

Участник торгов вправе подать запрос на отключение функционала проверки работоспособности и автоматического удаления активных заявок, который исполняется Биржей в течение трех рабочих дней.

# В случае отсутствия возможности выполнения запроса/ постоянного запроса Участника торгов уполномоченный представитель Биржи уведомляет о невозможности снятия заявок Участника торгов, направившего такой запрос/постоянный запрос, с использованием одного из средств связи.

# Биржа не несет ответственности за убытки, которые могут возникнуть у Участника торгов при исполнении Биржей запроса/постоянного запроса Участника торгов о снятии его активных заявок.

# Если работоспособность рабочего места может быть восстановлена Участником торгов самостоятельно, то он может повторно авторизоваться в ПТК ТЦ.

## **Порядок приостановления, прекращения и возобновления торгов**

# Под приостановкой торгов в рамках настоящего пункта Правил торгов понимается приостановка торгов в ходе их проведения, а также отсрочка начала проведения торгов.

# Настоящий пункт Правил торгов регулирует порядок приостановления, прекращения и возобновления торгов в случае возникновения обстоятельств, нарушающих или могущих нарушить нормальный порядок проведения торгов, к которым, в частности, относятся: технические сбои в работе средств проведения торгов (включая сбои в работе программного обеспечения); попытки несанкционированного доступа к средствам проведения торгов; сбои в работе систем связи, электроснабжения; обстоятельства непреодолимой силы; невозможность надлежащего функционирования Клирингового центра и/или иных организаций, деятельность которых влияет на возможность проведения торгов.

# Приостановление торгов возможно:

* в связи с фактической невозможностью проведения торгов;
* по решению Биржи.

Торги могут быть приостановлены полностью или частично.

# Сроки раскрытия информации о приостановлении торгов:

* в случае если торги были приостановлены в результате технического сбоя в работе средств проведения торгов, Биржа обязан раскрыть информацию об этом не позднее чем через 15 (пятнадцать) минут после обнаружения технического сбоя;
* в случае если торги были приостановлены по решению Биржи, Биржа раскрывает информацию об этом незамедлительно после принятия решения о приостановлении.

# После прекращения обстоятельств, послуживших основанием для приостановления торгов, торги подлежат возобновлению. В случае приостановления торгов, вызванного техническим сбоем в работе средств проведения торгов, Биржа раскрывает информацию о времени возобновления торгов и предоставляет Участникам торгов возможность снять активные заявки посредством средств проведения торгов не менее чем за 15 (пятнадцать) минут до возобновления торгов.

# В случае невозможности снятия активных заявок посредством средств проведения торгов, Участник торгов может предоставить Бирже заявление на снятие активных заявок с использованием телефонной или факсимильной связи. Биржа после получения заявления посредством телефонной или факсимильной связи снимает (при наличии такой возможности) активные заявки данного Участника торгов. При рассмотрении споров Биржа и Участник торгов вправе использовать запись телефонных переговоров в качестве доказательства факта направления Участником торгов указанного заявления на снятие активных заявок. Заявление Участника торгов о снятии его активных заявок должно содержать информацию аналогичную указанной в пункте настоящих Правил торгов.

# В случае если обстоятельства, повлекшие приостановку торгов, не прекращаются, Биржа вправе прекратить торги в данный торговый день.

# Информация обо всех случаях приостановления, прекращения и возобновления торгов раскрывается через представительство Биржи в сети интернет. Информация о возникновении технического сбоя также доводится до сведения Участников торгов (при наличии такой возможности) иным доступным способом.

# Если в течение текущего торгового дня приостановленные торги были возобновлены менее чем за один час до окончания основной сессии, Биржа вправе продлить основную сессию после истечения времени, предусмотренного настоящими Правилами торгов для ее проведения. Информация о продлении основной сессии раскрывается на сайте Биржи в сети интернет.

# ОФОРМЛЕНИЕ ЗАРЕГИСТРИРОВАННЫХ ЗАЯВОК И ЗАКЛЮЧЕННЫХ СДЕЛОК

## В ходе торгов все зарегистрированные в ТС заявки Участников торгов отражаются в реестре заявок. Реестр заявок формируется Биржей в электронном виде.

## В ходе торгов все зарегистрированные в соответствии с п.п. и настоящих Правил торгов сделки отражаются в реестре сделок. Реестр сделок формируется Биржей в электронном виде.

## По итогам каждой основной сессии Биржа посредством ПТК ТЦ получает от Клирингового центра и вносит в реестр сделок информацию о комиссионном вознаграждении за организацию торгов в российских рублях, о вознаграждении ТЦ в российских рублях за предоставление интегрированного технологического сервиса на рынке валюты и драгоценных металлов и о комиссии Клирингового центра за клиринговое обслуживание.

## По итогам каждой основной сессии Биржа формирует для Клирингового центра выписку из реестра сделок, формат которой определен в договоре, регулирующем взаимодействие Биржи и Клирингового центра. Клиринговый центр в соответствии с договором, регулирующим взаимодействие Биржи и Клирингового центра, получает от Биржи выписку из реестра сделок в виде электронного документа, сформированного в соответствии с Правилами ЭДО, и подписанного уполномоченным представителем Биржи.

## В соответствии с Временным регламентом в день проведения торгов Биржа формирует для Участника торгов с учетом требований п.п. и настоящих Правил торгов выписку из реестра сделок, зарегистрированных в соответствии с п.п. п. и настоящих Правил торгов, отдельно по каждому присвоенному такому Участнику торгов регистрационному коду Участника торгов. В соответствии с Временным регламентом на следующий рабочий день Биржа формирует для Участника торгов с учетом требований п.п. и настоящих Правил торгов выписку из реестра сделок, зарегистрированных в соответствии с п.п. п. и настоящих Правил торгов с момента составления предыдущей выписки из реестра сделок за основную сессию предыдущего рабочего дня, отдельно по каждому присвоенному такому Участнику торгов регистрационному коду Участника торгов.

Выписка из реестра сделок в виде электронного документа, сформированного в соответствии с Правилами ЭДО, и подписанного уполномоченным представителем Биржи, направляется Участнику торгов в соответствии с Правилами ЭДО. Форма и структура электронного документа утверждается Биржей.

Участник торгов может получать от Биржи выписку из реестра сделок в виде письменного документа на бумажном носителе, подписанного уполномоченным представителем Биржи. Выписка из реестра сделок на бумажном носителе предоставляется Биржей уполномоченному лицу Участника торгов, имеющему доверенность, составленную по форме, предусмотренной внутренними документами Биржи.

## В соответствии с Временным регламентом в день проведения торгов Биржа может формировать для Участника торгов с учетом требований п.п. и настоящих Правил торгов выписку из реестра сделок по сделкам своп, своп контрактам и сделкам с Бивалютной корзиной без указания сделок, входящих в данные сделки (далее – выписка из реестра сделок (сделки аналитического учета)), зарегистрированных в соответствии с п.п. и настоящих Правил торгов, отдельно по каждому присвоенному такому Участнику торгов регистрационному коду Участника торгов. В соответствии с Временным регламентом на следующий рабочий день Биржа может формировать для Участника торгов с учетом требований п.п. и настоящих Правил торгов выписку из реестра сделок (сделки аналитического учета), зарегистрированных в соответствии с п.п. и настоящих Правил торгов с момента составления предыдущей выписки из реестра сделок за основную сессию предыдущего рабочего дня, отдельно по каждому присвоенному такому Участнику торгов регистрационному коду Участника торгов.

## По итогам основной сессии Участнику торгов по его требованию предоставляется выписка из реестра сделок (сделки аналитического учета) отдельно по каждому присвоенному такому Участнику торгов регистрационному коду.

## Выписка из реестра сделок (сделки аналитического учета) в виде электронного документа, сформированного в соответствии с Правилами ЭДО, утвержденными уполномоченным органом Биржи, и подписанного уполномоченным представителем Биржи, направляется Участнику торгов в соответствии с внутренними документами Биржи, регулирующими электронный документооборот между Участниками торгов и Биржей. Форма и структура электронного документа утверждается уполномоченным органом Биржи.

## Документы, предоставляемые Участникам торгов по итогам каждой основной сессии, являются отчетными документами.

# ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО сделкам С иностранной валютОЙ/ДРАГОЦЕННЫМИ МЕТАЛЛАМИ

## **Общие принципы определения обязательств**

## Порядок исполнения обязательств Участниками клиринга Клиринговым центром и Банком России по сделкам с иностранной валютой/драгоценными металлами, заключенным на организованных торгах, регламентируется Правилами клиринга. Временные рамки исполнения указанных обязательств определяются Правилами клиринга.

## На основании выписки из реестра сделок, полученной от Биржи, Клиринговым центром в ходе клиринга определяются итоговые нетто-требования и/или итоговые нетто-обязательства Участников клиринга в каждой валюте/каждом драгоценном металле, а также обязательства по уплате/требования по получению вариационной маржи в соответствии с Правилами клиринга.

## По итогам клиринга по всем заключенным сделкам Участники клиринга исполняют свои итоговые нетто-обязательства в валюте/ драгоценных металлах, а также обязательства по уплате вариационной маржи и обязательства по уплате о вознаграждения в пользу Клирингового центра, а также обязательства Участников торгов по уплате вознаграждения в пользу Биржи, в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

# Порядок рассмотрения конфликтных ситуаций

## В связи с заключением сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами на организованных торгах возможно возникновение конфликтных ситуаций, связанных с регистрацией заявок Биржей в ТС, изменением информации в заявках после подачи их Участником торгов в ТС, а именно:

* оспаривание Участником торгов факта регистрации заявки Биржей в ТС;
* заявление Участника торгов об изменении информации в поданной им заявке при её регистрации Биржей в ТС;
* заявление Участника торгов о неисполнении поданной заявки при наступлении условий ее исполнения;
* заявление Участника торгов о снятии ранее поданных ими и зарегистрированных в ТС заявок, неисполненных полностью или частично;
* иные случаи возникновения конфликтных ситуаций, связанных с заключением сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами на организованных торгах, за исключением конфликтных ситуаций, связанных с использованием АСП Участника торгов, порядок разрешения которых определяется в п. настоящих Правил торгов.

## В случае возникновения конфликтной ситуации Участник торгов должен незамедлительно, но не позднее чем в течение трех рабочих дней или в иной более короткий срок после возникновения конфликтной ситуации, направить уведомление о конфликтной ситуации Бирже.

## Уведомление о конфликтной ситуации должно содержать информацию о существе конфликтной ситуации и обстоятельствах, которые, по мнению Участника торгов - уведомителя, свидетельствуют о наличии конфликтной ситуации. В уведомлении должны быть указаны фамилия, имя и отчество, должность, контактные телефоны, факс, адрес электронной почты лица или лиц, уполномоченных вести переговоры по урегулированию конфликтной ситуации. Уведомление о наличии конфликтной ситуации составляется в письменной форме и направляется с нарочным, либо иным способом, обеспечивающим подтверждение вручения корреспонденции адресату.

## Биржа обязана незамедлительно, однако не позднее чем в течение следующего рабочего дня, проверить наличие обстоятельств, свидетельствующих о возникновении конфликтной ситуации, и направить Участнику торгов информацию о результатах проверки и, в случае необходимости, о мерах, принятых для разрешения возникшей конфликтной ситуации.

## Конфликтная ситуация признается разрешенной в рабочем порядке в случае, если Участник торгов удовлетворен информацией, полученной от Биржи. В ином случае для рассмотрения конфликтной ситуации формируется техническая комиссия.

## Не позднее чем на следующий рабочий день после того, как принято решение о необходимости сформировать техническую комиссию, или не позднее, чем на шестой рабочий день после получения уведомления о конфликтной ситуации, в случае, если конфликтная ситуация не была урегулирована в рабочем порядке, техническая комиссия должна быть сформирована.

## Если Участник торгов и Биржа, являющиеся сторонами в конфликтной ситуации не договорятся об ином, в состав технической комиссии входит равное количество, но не менее чем по одному уполномоченному представителю каждой из конфликтующих сторон. Полномочия представлять в технической комиссии соответствующую сторону должно подтверждаться доверенностью, выданной каждому представителю на срок работы технической комиссии.

## Сформированная техническая комиссия при рассмотрении конфликтной ситуации устанавливает на технологическом уровне наличие или отсутствие фактических обстоятельств, свидетельствующих о факте и времени формирования и подачи заявки Участником торгов в ТС, ее регистрации в ТС и отсутствии изменений условий заявки после ее регистрации в ТС.

## Все действия, предпринимаемые технической комиссией для выяснения фактических обстоятельств, а также выводы, сделанные комиссией, заносятся в Протокол работы технической комиссии. Протокол работы технической комиссии должен содержать следующие данные:

* состав комиссии с указанием сведений о квалификации каждого из членов комиссии;
* краткое изложение обстоятельств возникшей конфликтной ситуации;
* мероприятия, проводимые комиссией для установления причин и последствий возникшей конфликтной ситуации, с указанием даты времени и места их проведения;
* выводы, к которым пришла комиссия в результате проведенных мероприятий;
* подписи всех членов комиссии.

## Протокол составляется в двух экземплярах на бумажном носителе, по одному экземпляру для Участника торгов и Биржи.

## Конфликтная ситуация, которая может возникнуть в связи с использованием АСП Участника торгов в случае невозможности ее разрешения в рабочем порядке, подлежит разрешению путем проведения технической комиссией технической экспертизы в соответствии с изложенными ниже правилами:

## Для проведения технической экспертизы необходимы:

* информация от уведомителя о конфликтной ситуации (Участника торгов или Клирингового центра) о параметрах заявки, в отношении которой проводится техническая экспертиза:
* дата и время формирования заявки;
* номер заявки, зарегистрированной в ТС;
* параметры заявки, необходимые для рассмотрения уведомления о конфликтной ситуации;
* архив регистрации транзакций ТС на указанную дату (файл TransLog и начальные файлы данных ТС на указанную дату торгов);
* рабочее место, позволяющее просматривать и распечатывать информацию из файла TransLog в удобном для восприятия членами технической комиссии виде;
* отчетные документы, подтверждающие направление в установленном порядке уведомления о присвоении регистрационного кода уполномоченному представителю уведомителя о конфликтной ситуации (Участника торгов);
* в случае если заявка подавалась посредством РМ Рейтер/РМ Блумберг, протокол, переговоров между Участником торгов и Биржей по системе Рейтер/Блумберг.

## Проведение технической экспертизы включает в себя выполнение следующих действий:

* распечатку на бумажном носителе электронного сообщения, содержащего параметры соответственно заявки, в отношении которой проводится техническая экспертиза;
* повтор (имитацию) технологического процесса торгов на указанную дату путем «прогона» файла TransLog на рабочем месте, имеющем доступ к текущей версии программного обеспечения ТС, с целью получения результатов, подтверждающих целостность файла TransLog и соответствие результатов «прогона» результатам торгов на указанную дату;
* проверку соответствия результатов повтора (имитации) торгов на указанную дату информации, содержащейся в протоколе торгов, выписка из которого (операционный лист) предоставляется по требованию Участника торгов;
* фиксирование результатов «прогона» в протоколе работы технической комиссии;
* в случае если заявка подавалась посредством РМ Рейтер/РМ Блумберг, проверку соответствия параметров заявки, зарегистрированной в ТС, параметрам заявки, содержащимся в протоколе переговоров между Участником торгов и Биржей по системе Рейтер/Блумберг;
* фиксирование результатов проверки в протоколе работы технической комиссии;
* проверку соответствия АСП Участника торгов в копии электронного сообщения на бумажном носителе, который содержит параметры заявки, торговому идентификатору, присвоенному Биржей Участнику торгов в порядке, установленном внутренними документами Биржи;
* фиксирование результатов проверки в протоколе работы технической комиссии.

## В случае, если:

* заявка, в отношении которой проводится техническая экспертиза, найдена в файле TransLog;
* результаты повтора (имитации) основной сессии на указанную дату путем «прогона» файла TransLog через ТС соответствуют информации, содержащейся в протоколе торгов, выписка из которого (операционный лист) предоставляется по требованию Участника торгов;
* заявка подавалась посредством РМ Рейтер/РМ Блумберг и установлено соответствие параметров заявки, зарегистрированной в ТС, параметрам заявки, содержащимся в протоколе переговоров между Участником торгов и Биржей по системе Рейтер/Блумберг;
* установлено соответствие АСП Участника торгов в копии электронного сообщения на бумажном носителе, который содержит параметры заявки, торговому идентификатору, присвоенному Биржей Участнику торгов;

## считается установленным, что:

* заявка, в отношении которой возникла конфликтная ситуация, были сформированы в соответствии с Правилами торгов Участником торгов/Клиринговым центром;
* после подачи указанной заявки Участником торгов в ТС не было изменено ни одного параметра заявки и в ТС зарегистрирована сделка в соответствии с параметрами, указанными в заявке.

## По результатам проведения технической экспертизы техническая комиссии составляет протокол в соответствии с п. настоящих Правил торгов.

## В случае, если по результатам рассмотрения конфликтной ситуации технической комиссией она остается неурегулированной, то такая конфликтная ситуация подлежит рассмотрению в порядке, предусмотренном в Разделе 7 настоящих Правил торгов.

# Порядок разрешения споров

## Все споры и разногласия, возникшие в связи применением, нарушением, толкованием настоящих Правил торгов, в том числе, но не исключительно, споры, касающиеся исполнения обязательств, вытекающих из настоящих Правил торгов, а также споры, касающиеся заключения, изменения и прекращения сделок, заключенных в соответствии с настоящими Правилами торгов, признания сделок недействительными или незаключенными, подлежат рассмотрению и разрешению в Арбитражной комиссии при ОАО Московская Биржа в соответствии с документами, определяющими ее правовой статус и порядок разрешения споров, действующими на момент подачи искового заявления (за исключением споров и разногласий, стороной по которым является любая из компаний, входящих в Группу «Московская Биржа»).

## Все споры и разногласия, возникающие между Участником торгов и любой компанией, входящей в Группу «Московская Биржа» в связи с применением, нарушением, толкованием настоящих Правил торгов, признанием недействительными Правил торгов или их части, в том числе, но не исключительно, в связи с исполнением обязательств, вытекающих из Правил торгов, а также споры, касающиеся заключения, изменения или прекращения сделок, заключенных в соответствии с настоящими Правилами торгов, признания сделок недействительными или незаключенными, подлежат рассмотрению в Третейском суде НАУФОР в соответствии с его Регламентом, действующим на момент подачи искового заявления.

## Решения Арбитражной комиссии при ОАО Московская Биржа/Третейского суда НАУФОР являются окончательными и обязательными для исполнения. Неисполненное добровольно решение Арбитражной комиссии при ОАО Московская Биржа/Третейского суда НАУФОР подлежит принудительному исполнению в соответствии с законодательством Российской Федерации или законодательством страны места принудительного исполнения и международными соглашениями.