

Изменения в порядке расчета средневзвешенной цены

В настоящее время средневзвешенная цена рассчитывается в нескольких режимах торгов независимо друг от друга по сделкам, заключенным в соответствующих режимах торгов.

Теперь вместо отдельных средневзвешенных цен будет рассчитываться единая средневзвешенная цена, т.е. по каждой ценной бумаге за каждый торговый день существует только одна средневзвешенная цена (при этом допускается расчет средневзвешенных ставок РЕПО в режимах торгов РЕПО). При расчете единой средневзвешенной цены учитываются цены сделок с отдельной ценной бумагой, заключенные во всех режимах торгов, за исключением:

1. режимов торгов РЕПО;
2. режимов размещения/выкупа ценных бумаг;
3. режима торгов крупными пакетами акциями и облигациями
4. предторгового периода режимов основных торгов.

Т.о. в расчет средневзвешенной цены попадают сделки в режимах (бордах):

<i>Market</i>	<i>Boards</i>
FOND	Все борды кроме AUCT, AUBB, EQDP
FNDT	Все борды кроме TQDB
RPS	Все борды режима РПС (тикер начинается с PS..) кроме режимов размещения и выкупа (PSAU, PSBB, PACY, PAEU, PAGB, PAUS), а также ИРК2: PSDB, PSDE, PSEO, PSEQ, PSEU, PSGO, PSIF, PSOB, PSQI, PSSD, PSTC, PSTD, PSTF, PSYO, IRK2
RPST	Все борды кроме SPEQ

В расчет средневзвешенной цены включаются сделки следующих периодов:

- Аукциона открытия
- Торгового периода
- Аукциона закрытия
- Послеторгового периода
- Дискретного аукциона

Отдельно считается средневзвешенная цена (ставка) по каждому из бордов режима РЕПО с ЦК безадр.: у EQRП, EQWP, EQRD, EQRE (т.е. поведение не меняется).

Средневзвешенная цена одной ценной бумаги за установленный период времени определяется путем деления суммы произведений цен каждой из сделок на количество ценных бумаг в соответствующей сделке, заключенной в данный период времени с указанной ценной бумагой, на сумму количества ценных бумаг в указанных сделках за тот же период времени. Установленный период времени – 1 торговый день. Пересчет объемов и цен для сделок в разных валютах осуществляется по курсу ЦБ на дату заключения сделки.

При определении средневзвешенной цены облигации цена сделки выражается в процентах от номинальной стоимости облигации.

Средневзвешенная цена публикуется в валюте расчетов борда для всех бордов, сделки которых учитываются в ее расчете. Пересчет осуществляется по курсу ЦБ на дату заключения сделки.

Средневзвешенная цена не рассчитывается и не публикуется для бордов, не перечисленных в таблице выше (SPEQ, SPOB, RPMO, RPMA и др.).

Для бордов режимов РЕПО междил., РЕПО с БР и РЕПО с ЦК адресн. отключается расчет и трансляция следующих котировок: цена первой сделки, цена последней сделки, минимальная, максимальная.

Информация по средневзвешенной цене публикуется в поле WAPRICE таблицы SECURITIES шлюзового интерфейса ASTS Bridge. В протоколе FAST UDP multicast market data это соответствует значению MDEntryPx(270) для MDEntryType(269)='9' потока Statics.