

Уведомление об особенностях механизма заключения договоров на организованных торгах ценными бумагами, проводимых ПАО «СПБ Биржа», с использованием механизма Котировок

Целью настоящего уведомления является предоставление инвесторам информации об особенностях механизма заключения договоров на организованных торгах ценными бумагами, проводимых ПАО «СПБ Биржа» (далее – «Биржа»), с использованием механизма Котировок.

Биржа просит Участников торгов довести указанную в настоящем уведомлении информацию до сведения своих Клиентов, в интересах которых Участники торгов заключают Договоры на организованных торгах ценными бумагами, проводимых Биржей.

Все термины, не определенные настоящим уведомлением, используются в значениях, определенных в соответствии с правилами проведения организованных торгов ценными бумагами Биржи (далее – «Правила торгов»).

Механизм подачи Котировок, предусмотренный статьей 14 Правил торгов, введен Биржей в рамках работы по повышению ликвидности на рынке иностранных ценных бумаг - данный механизм был запущен в целях проведения Биржей анализа цен, указываемых Участниками торгов в Котировках.

В целях объявления Заявок в Режиме основных торгов Участники торгов вправе подать в систему проведения Торгов Котировки, представляющие собой приглашения делать оферты путем направления Заявки на покупку/Заявки на продажу с целью заключения Договора купли-продажи по цене не ниже/не выше той, что указана в Котировке.

Если иное не установлено решением Биржи, Котировки могут подавать только Участники торгов категории А (Маркет-мейкеры) при условии указания в такой Котировке краткого кода Маркет-мейкера. В настоящее время подавать Котировки могут только Маркет-мейкеры.

Как уже было указано выше, Котировка не является Заявкой (и не регистрируется в реестре Заявок) и представляет собой приглашение делать оферты путем подачи Заявок на Торгах в Режиме основных торгов, которые являются встречными по отношению к Заявкам провайдера ликвидности (под Заявкой провайдера ликвидности понимается адресная, анонимная Заявка, подаваемая Участником торгов, направившим соответствующую Котировку; с более подробной информацией о Заявках провайдера ликвидности можно ознакомиться в Правилах торгов).

Котировка допускает частичное исполнение и действует до окончания Торгового дня (если иное не установлено в соответствии с Правилами торгов), в течение которого указанная Котировка была подана, или до полного исполнения Котировки. Котировка удаляется Биржей в неисполненной части в случае неполного исполнения до конца Торгового дня, в течение которого указанная Котировка была подана, либо в связи с получением Биржей уведомления о неподаче Участником торгов, подавшим указанную Котировку, Заявки провайдера ликвидности в соответствии с пунктом 14.7. Правил торгов. Участник торгов вправе отозвать Котировку, поданную на Торгах. Отзыв Котировки осуществляется путем подачи Участником торгов в Систему проведения торгов соответствующего запроса на отзыв Котировки.

При наличии обрабатываемой или объявленной Заявки, являющейся встречной по отношению к Котировке, Участник торгов, подавший Котировку, обязуется подать Заявку провайдера ликвидности, соответствующую Котировке, или предоставить Бирже уведомление о неподаче Заявки провайдера ликвидности (реализуя такое право). Уведомление о неподаче Заявки провайдера ликвидности передается Бирже посредством Системы проведения торгов. Уведомление о неподаче Заявки провайдера ликвидности должно содержать указание на идентификационный номер соответствующей Котировки.

Встречными по отношению к Котировке являются Заявки, указанные в пунктах 15.2.1. – 15.2.4. Правил торгов, с учетом особенностей, указанных в пункте 15.12 Правил торгов, с направлением, противоположным направлению Котировки, и с ценой не хуже, чем цена, указанная в Котировке. Котировка исполняется в полном объеме или частично в случае заключения Договора на основании Заявки провайдера ликвидности, объявленной на основании данной Котировки.

Таким образом, отличительными особенностями заключения Договоров на основании двух встречных Заявок от заключения Договоров с использованием механизма Котировок заключается в том, что Котировка, не являясь Заявкой, предоставляет собой приглашение делать оферты путем подачи Заявок на Торгах в Режиме основных торгов, которые являются встречными по отношению к Заявкам провайдера ликвидности, при этом Участник торгов, подавший Котировку, вправе предоставить Бирже уведомление о неподаче Заявки провайдера ликвидности, что приведет к невозможности заключить Договор с использованием механизма Котировок.

Также в настоящее время подача Котировок осуществляется без возможности подавать Заявки провайдера ликвидности. Таким образом, в настоящее время Договоры на основании Котировок не заключаются.

В соответствии с Правилами торгов, если иное не установлено решением Биржи, информация, содержащаяся в Котировке, после регистрации указанной Котировки в реестре Котировок, раскрывается всем Участникам торгов. На текущий момент обстоятельства, при которых Биржей может быть реализована предусмотренная пунктом 14.14 статьи 14 Правил торгов возможность принятия решения о

нераскрытии всем Участникам торгов Биржи сведений, содержащихся в Котировках, зарегистрированных в реестре Котировок Биржи, не возникали. В то же время Биржа оставляет за собой право не осуществлять раскрытие информации о Котировках в ситуации, когда раскрытие Котировок может привести к ухудшению качества сервиса для Участников торгов.

Котировка считается объявленной с момента ее регистрации в реестре Котировок. Если иное не установлено решением Биржи, информация, содержащаяся в Котировке, после регистрации указанной Котировки в реестре Котировок, раскрывается всем Участникам торгов. Если иное не установлено решением Биржи, Участник торгов вправе указать в Котировке признак «Допускать пересечение цены». В случае если признак «Допускать пересечение цены» указан в подаваемой Котировке, то Котировка на покупку (Котировка на продажу) будет зарегистрирована в реестре Котировок, несмотря на наличие в реестре Котировок ранее поданных Котировок на продажу (Котировок на покупку) с ценой не больше (не меньше) цены, указанной в подаваемой Котировке. В случае если признак «Допускать пересечение цены» не указан в подаваемой Котировке, то Котировка на покупку (Котировка на продажу) не будет зарегистрирована в реестре Котировок при наличии в реестре Котировок ранее поданных Котировок на продажу (Котировок на покупку) с ценой не больше (не меньше) цены, указанной в подаваемой Котировке.