



УТВЕРЖДЕНА

Правлением АО СПВБ

(протокол от 11.10.2024 № 54)

МЕТОДИКА

**расчета курсов иностранных валют Акционерного общества
«Санкт-Петербургская Валютная Биржа»**

(редакция 2)

1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

- 1.1 Настоящая Методика расчета курсов иностранных валют Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (далее – Методика) разработана в соответствии с Правилами организованных торгов Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»¹ (далее – Правила организованных торгов) и устанавливает порядок расчета Акционерным обществом «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (далее – АО СПВБ) курсов денежной единицы одной страны, выраженных в денежной единице другой страны (далее – курсы валют), с учетом требований законодательства Российской Федерации.
- 1.2 Термины, специально не определенные в настоящей Методике, используются в значениях, установленных Правилами организованных торгов, а также законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.
- 1.3 Текст настоящей Методики размещается на официальном сайте АО СПВБ в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (далее – Сайт АО СПВБ) не позднее, чем за один рабочий день до даты вступления ее в силу, если иное не предусмотрено решением АО СПВБ.
- 1.4 Настоящая Методика, а также изменения и дополнения к ней утверждаются Правлением АО СПВБ и вступают в силу в дату, определенную Правлением АО СПВБ.

2. ПОРЯДОК РАСЧЕТА КУРСОВ ВАЛЮТ

- 2.1 Курсы валют рассчитываются по каждой валюте лота валютных биржевых инструментов, торги которыми проводятся в Секции денежного и валютного рынков, в каждой из сопряженных валют (далее – курс АО СПВБ).
- 2.2 Курс АО СПВБ определенной иностранной валюты рассчитывается на основании договоров, заключенных на организованных торгах с кодом расчетов Т0 в Секции денежного и валютного рынков по валютному биржевому инструменту, лот которого номинирован в соответствующей иностранной валюте.
- 2.3 Курс АО СПВБ определенной иностранной валюты рассчитывается на основании договоров, заключенных в торговых режимах Секции денежного и валютного рынков, проводимых на основании безадресных заявок, и приравнивается к цене закрытия валютного биржевого инструмента, определенной в ходе последней торговой сессии каждого торгового дня соответствующим валютным биржевым инструментом.
- 2.3.1 В случае наличия нескольких биржевых инструментов с одной валютой лота и клирингом в разных клиринговых организациях, в целях расчета курса валюты используется цена закрытия валютного биржевого инструмента с централизованным клирингом.

¹ Правила организованных торгов АО СПВБ – внутренний документ Биржи, состоящий из документов «Правила допуска к торгам Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа», «Правила проведения организованных торгов в Фондовой секции Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа», «Правила проведения организованных торгов в Секции межбанковского кредитного рынка Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» и «Правила листинга (делистинга) ценных бумаг Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

- 2.4 В целях контроля лимитов изменения цены валютных биржевых инструментов в первый торговый день по валютному биржевому инструменту используется курс Банка России, установленный на дату, соответствующую первому торговому дню валютного биржевого инструмента, опубликованный на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (https://cbr.ru/currency_base/daily/).

3. ПОРЯДОК РАСЧЕТА ЦЕН ВАЛЮТНЫХ БИРЖЕВЫХ ИНСТРУМЕНТОВ

- 3.1 Текущая цена валютного биржевого инструмента рассчитывается не реже одного раза в минуту в течение торговой сессии как средневзвешенная цена данного валютного инструмента за предшествующие моменту расчета 10 (десять) минут торгов по всем договорам, заключенным на основании безадресных заявок.
- 3.2 В случае отсутствия в течение последних 10 (десяти) минут торговой сессии договоров, заключенных на основании безадресных заявок, текущая цена валютного биржевого инструмента определяется следующим образом:
- при наличии активных безадресных заявок на покупку и продажу – как среднее значение цен лучшей заявки на покупку (максимальная цена) и лучшей заявки на продажу (минимальная цена);
 - при наличии активных безадресных заявок только на покупку – как цена лучшей заявки на покупку (максимальная цена), если такая цена выше последнего рассчитанного значения текущей цены валютного биржевого инструмента, иначе – как последнее рассчитанное значение текущей цены валютного биржевого инструмента;
 - при наличии активных безадресных заявок только на продажу – как цена лучшей заявки на продажу (минимальная цена), если такая цена ниже последнего рассчитанного значения текущей цены валютного биржевого инструмента, иначе – как последнее рассчитанное значение текущей цены валютного биржевого инструмента в текущий торговый день.
- 3.3 В случае отсутствия в течение последней минуты торговой сессии договоров, заключенных на основании хотя бы одной безадресной заявки, а также заявок, удовлетворяющих условиям, предусмотренным пунктом 3.2 настоящей Методики, текущая цена валютного биржевого инструмента принимается равной последней рассчитанной текущей цене данного валютного биржевого инструмента.
- 3.4 **Цена открытия валютного биржевого инструмента** рассчитывается по всем договорам, заключенным на основании безадресных заявок, и приравнивается к первой рассчитанной текущей цене валютного биржевого инструмента в течение торговой сессии.
- 3.4.1 В случае отсутствия в течение торговой сессии договоров, заключенных на основании безадресных заявок, а также заявок, удовлетворяющих условиям, предусмотренным пунктом 3.2 настоящей Методики, цена открытия валютного биржевого инструмента не рассчитывается.
- 3.5 **Цена закрытия валютного биржевого инструмента** рассчитывается и приравнивается к последней рассчитанной текущей цене на момент окончания торговой сессии при условии наличия договоров, заключенных на основании безадресных заявок за предшествующие моменту окончания торгов 10 (десять)

минут торгов, или в случае отсутствия таких договоров и при наличии безадресных заявок определяется в соответствии с пунктом 3.2 настоящей Методики.

- 3.5.1 В случае отсутствия договоров, заключенных на основании безадресных заявок за предшествующие моменту окончания торгов 10 (десять) минут торгов, а также заявок, удовлетворяющих условиям, предусмотренным пунктом 3.2 настоящей Методики, цена закрытия валютного биржевого инструмента не рассчитывается. В этом случае в целях контроля лимитов изменения цены валютных биржевых инструментов на следующий торговый день по валютному биржевому инструменту используется курс Банка России, установленный на соответствующую дату, опубликованный на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (https://cbr.ru/currency_base/daily/).
- 3.6 **Средневзвешенная цена валютного биржевого инструмента** за установленный период времени определяется путем деления значения, полученного в результате суммы произведений цен каждого из договоров, заключенных в данный период времени, на сумму каждого из этих договоров в валюте лота, на общую сумму всех указанных договоров в валюте лота за тот же период времени.
- 3.7 Значение цен валютного биржевого инструмента, определяемых в соответствии с настоящей Методикой, содержит n число знаков после запятой с округлением по математическим правилам согласно точности (разрядности) цены, установленной в Спецификации соответствующего Биржевого инструмента.

4. РАСКРЫТИЕ КУРСОВ АО СПВБ И ЦЕН ВАЛЮТНЫХ БИРЖЕВЫХ ИНСТРУМЕНТОВ

- 4.1 Значения курсов АО СПВБ и цен валютных биржевых инструментов, определяемых в соответствии с настоящей Методикой, раскрываются (публикуются) на Сайте АО СПВБ ежедневно по итогам каждого торгового дня.