

УТВЕРЖДЕНА

Правлением Акционерного общества
«Санкт-Петербургская Валютная Биржа»

(Протокол от 04.09.2023 № 39)

**Методика расчета цен ценных бумаг
Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»**

Санкт-Петербург
2023

1. Общие положения

1.1. Настоящая Методика расчета цен ценных бумаг Акционерного общества «Санкт - Петербургская Валютная Биржа» (далее - Методика) разработана в соответствии с Правилами организованных торгов Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (далее – Правила организованных торгов) и устанавливает правила и порядок расчета Акционерным обществом «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (далее – СПВБ) цен ценных бумаг, требования к которым установлены законодательством и иными нормативными правовыми актами 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. Настоящая Методика, а также изменения и дополнения к ней, утверждаются Правлением СПВБ и вступают в действие в дату, определенную Правлением СПВБ.

2. Порядок расчета текущих цен ценных бумаг

2.1. Текущие цены ценных бумаг рассчитываются по всем ценным бумагам, допущенным СПВБ к организованным торгам.

2.2. Текущая цена ценной бумаги рассчитывается в течение основной торговой сессии не реже одного раза в минуту в течение времени проведения торгов в торговых режимах Фондовой секции СПВБ, проводимых на основании безадресных заявок.

2.3. Текущая цена ценной бумаги рассчитывается как средневзвешенная цена данной ценной бумаги за предшествующие моменту расчета десять минут торгов по всем договорам, заключенным на основании безадресных заявок.

2.4. В случае отсутствия в течение последних 10 минут договоров, заключенных на основании безадресных заявок, текущая цена 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 ценной бумаги, иначе – как последнее рассчитанное значение текущей цены ценной бумаги;

- 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 ценной бумаги, иначе – как последнее рассчитанное значение текущей цены ценной бумаги.

2.5. В случае отсутствия в течение последней минуты торгов договоров, заключенных на основании безадресных заявок, а также заявок, удовлетворяющих условиям, предусмотренным пунктом 2.4 настоящей Методики, текущая цена ценной бумаги принимается равной последней рассчитанной текущей цене данной ценной бумаги.

2.6. В расчет текущей цены ценной бумаги не включаются цены договоров, заключенных в торговых режимах Фондовой секции СПВБ, в которых Участникам торгов предоставляется доступ к информации только о собственных заявках, поданных в данном режиме/периоде режима торгов, а также цены, содержащиеся в договорах РЕПО и другие цены по договорам, заключенным в иных режимах торгов, определенных решением СПВБ.

3. Порядок расчета цен открытия ценных бумаг

3.1. Цены открытия ценных бумаг рассчитываются по всем ценным бумагам, допущенным СПВБ к организованным торгам.

3.2. В случае если по ценной бумаге в течение основной торговой сессии проводится аукцион открытия, цена открытия приравнивается к цене аукциона открытия.

3.3. Если по ценной бумаге в течение основной торговой сессии не проводится аукцион открытия, цена открытия приравнивается к первой рассчитанной текущей цене данного торгового дня.

3.4. При определении цены открытия ценной бумаги могут учитываться только договоры, заключенные на основании безадресных заявок.

3.5. При расчете цены открытия не учитываются цены, содержащиеся в договорах РЕПО.

4. Порядок расчета цен закрытия ценных бумаг

4.1. Цены закрытия ценных бумаг рассчитываются по всем ценным бумагам, допущенным СПВБ к организованным торгам.

4.2. Цена закрытия ценной бумаги определяется по состоянию на момент окончания основной торговой сессии один раз в течение торгового дня.

4.3. Если по ценной бумаге в течение основной торговой сессии не проводится аукцион закрытия, цена закрытия приравнивается к последней рассчитанной текущей цене на момент окончания основной торговой сессии.

4.4. В случае если по ценной бумаге в течение основной торговой сессии проводится аукцион закрытия, цена закрытия приравнивается к цене аукциона закрытия.

4.5. Цена закрытия ценной бумаги рассчитывается исключительно по договорам, заключенным на основании безадресных заявок.

4.6. При расчете цены закрытия не учитываются цены, содержащиеся в договорах РЕПО.

4.7. Цена закрытия ценной бумаги, определенная по состоянию на момент окончания основной торговой сессии предыдущего торгового дня, в отношении которой была проведена консолидация или дробление, корректируется с учетом пропорционального изменения цены такой ценной бумаги.

5. Порядок расчета рыночных цен ценных бумаг

5.1. Рыночные цены ценных бумаг рассчитываются по всем ценным бумагам, допущенным СПВБ к организованным торгам.

5.2. Рыночная цена ценной бумаги рассчитывается за торговый день по договорам, заключенным в течение основной торговой сессии на основании хотя бы одной безадресной заявки.

5.3. Рыночная цена по каждой ценной бумаге определяется как средневзвешенная цена по итогам каждого торгового дня:

- по договорам, если число указанных договоров составляет не менее десяти и их объем составляет не менее 500 000 (пятьсот тысяч) рублей Российской Федерации;

- по последним десяти договорам, заключенным в течение последних 90 торговых дней, если в течение торгового дня, по итогам которого рассчитывается рыночная цена, заключено менее десяти договоров с ценными бумагами того же выпуска, и объем последних десяти договоров составляет не менее 500 000 (пятьсот тысяч) рублей Российской Федерации;

- по последним договорам, заключенным в течение последних 90 торговых дней, объем которых при заключении последнего договора составил 500 000 (пятьсот тысяч) рублей Российской Федерации или более, если объем договоров в течение торгового дня, по итогам которого рассчитывается рыночная цена, либо объем последних 10 договоров, заключенных в течение последних 90

торговых дней, но более чем за один торговый день, составил менее 500 000 (пятисот тысяч) рублей Российской Федерации.

5.4. При расчете рыночной цены не учитываются цены, содержащиеся в договорах РЕПО.

6. Порядок расчета средневзвешенных цен ценных бумаг

6.1. Средневзвешенные цены ценных бумаг рассчитываются по всем ценным бумагам, допущенным СПВБ к организованным торгам.

6.2. Средневзвешенная цена одной ценной бумаги за установленный период времени определяется путем деления суммы произведений цен каждого из договоров на количество ценных бумаг в соответствующем договоре, заключенном в данный период времени с указанной ценной бумагой, на сумму количества ценных бумаг в указанных договорах за тот же период времени.

6.3. При расчете средневзвешенной цены не учитываются цены, содержащиеся в договорах РЕПО.

7. Порядок расчета расчетных цен ценных бумаг

7.1. Расчетные цены ценных бумаг рассчитываются по всем ценным бумагам, допущенным СПВБ к организованным торгам.

7.2. Расчетная цена ценной бумаги приравнивается к цене закрытия по данной ценной бумаге.