

Методика
расчета показателя «Текущая цена рынка»

1. Настоящая Методика расчета показателя «Текущая цена рынка» (далее – «Методика») устанавливает порядок расчета показателя «Текущая цена рынка» (далее – «Показатель»), а также условия и порядок использования и распространения информации о значениях Показателя.

2. Термины, специально не определенные в настоящей Методике, используются в значениях, установленных документами Акционерного общества «Клиринговый центр МФБ» (далее – «КЦ»).

3. Значения Показателя рассчитываются КЦ в период (периоды) времени, в течение которого (которых) в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности на рынке ценных бумаг Акционерного общества «Клиринговый центр МФБ» могут направляться Оферты ОТС.

4. Значения Показателя рассчитываются по каждой ценной бумаге, входящей в Список предметов обязательств из договоров, заключенных не на организованных торгах, в отношении которых Акционерное общество «Клиринговый центр МФБ» оказывает клиринговые услуги (далее – «Список»). КЦ вправе по своему усмотрению не рассчитывать значения Показателя в отношении одной или нескольких ценных бумаг, входящих в Список.

5. Значения Показателя рассчитываются в валюте расчетов ценной бумаги, по которой осуществляется расчет значения Показателя.

6. Значения Показателя рассчитываются исходя из следующих цен:

1) цен, указанных в обеспеченных Офертах ОТС (за исключением связанных Оферт ОТС);

2) цен Внебиржевых договоров купли-продажи ОТС (далее – «Договор») (за исключением связанных Оферт ОТС).

3) цен на покупку и цен на продажу на иностранной бирже, информацию о которых получает КЦ. Указанные в настоящем подпункте цены учитываются в расчете значения Показателя начиная с 7:30 часов утра стандартного восточного времени (7:30 a.m. EST) до момента прекращения приема КЦ указанной информации. Расчет Показателя, с использованием информации, указанной в настоящем подпункте, осуществляется КЦ по ценным бумагам, в отношении которых у КЦ имеется информация с иностранной биржи о ценах на покупку и ценах на продажу.

7. Значение Показателя рассчитывается в следующем порядке:

1) на начало периода времени, указанного в пункте 3 настоящей Методики, значение Показателя устанавливается равным последнему рассчитанному значению Показателя за предыдущий период, если иное не установлено КЦ на основании экспертной оценки;

2) в момент заключения Договора значение Показателя устанавливается равным цене заключенного Договора. При этом если на основании одной Заявки одновременно заключается несколько Договоров, значение Показателя устанавливается равным цене последнего из таких Договоров;

3) в момент направления Оферты значение Показателя устанавливается равным цене, указанной в обеспеченной Оферте, при одновременном соблюдении следующих условий:

– направление Оферты ОТС, направленной на покупку ценных бумаг, привело к изменению лучшей цены на покупку, а направление Оферты ОТС, направленной на продажу ценных бумаг, привело к изменению лучшей цены на продажу;

– цена за одну ценную бумагу, указанная в Оферте ОТС, направленной на покупку ценных бумаг, – выше, а цена за одну ценную бумагу, указанная в Оферте ОТС, направленной на продажу ценных бумаг, – ниже, чем последнее рассчитанное значение Показателя;

Для целей настоящего подпункта лучшей ценой на покупку считается наибольшая цена, указанная в Оферте ОТС, направленной на покупку ценных бумаг (среди Оферт ОТС, в отношении которых не направлен Акцепт ОТС), а лучшей ценой на продажу – наименьшая цена, указанная в

Оферте ОТС, направленной на продажу ценных бумаг (среди Оферт ОТС, в отношении которых не направлен Акцепт ОТС);

4) в момент получения информации об изменении цены на продажу или цены на покупку на иностранной бирже значение Показателя устанавливается равным указанной цене, если цена на покупку выше, а цена на продажу ниже, чем последнее рассчитанное значение Показателя.

8. Информация о значениях Показателя представляется КЦ Участникам клиринга в информационных целях. КЦ также вправе использовать Информацию о значениях Показателя иными способами по своему усмотрению, в том числе представлять иным лицам, помимо Участников клиринга, и распространять неограниченному кругу лиц, включая предоставление (распространение) на возмездной основе.