

Об утверждении Положения о системе контроля организаторов торговли на рынке ценных бумаг и дополнительных требованиях к участникам торгов и эмитентам ценных бумаг

Постановление · № 28 · от 26.10.2001 · Федеральная комиссия по рынку ценных бумаг · Утратил силу

ПОСТАНОВЛЕНИЕ

Федеральной комиссии по рынку ценных бумаг

от 26 октября 2001 г. N 28

Об утверждении Положения о системе контроля организаторов торговли на рынке ценных бумаг и дополнительных требованиях к участникам торгов и эмитентам ценных бумаг

Зарегистрировано Министерством юстиции Российской Федерации

12 ноября 2001 г. Регистрационный N 3017

В соответствии с пунктами 3 и 4 статьи 42 и пунктом 3 статьи 44 Федерального закона от 22 апреля 1996 г. N 39-ФЗ "О рынке ценных бумаг" (Собрание законодательства Российской Федерации, 1996, N 17, ст. 1918; 1998, N 48, ст. 5857; 1999, N 28, ст. 3472; 2001, N 33, ст. 3424) Федеральная комиссия по рынку ценных бумаг постановляет:

Утвердить прилагаемое Положение о системе контроля организаторов торговли на рынке ценных бумаг и дополнительных требованиях к участникам торгов и эмитентам ценных бумаг.

ПОЛОЖЕНИЕ

о системе контроля организаторов торговли на рынке ценных бумаг и дополнительных требованиях к участникам торгов и эмитентам ценных бумаг

Утверждено постановлением Федеральной комиссии

по рынку ценных бумаг

от 26 октября 2001 г. N 28

1. Общие положения

1.1. Настоящее Положение регулирует отношения, связанные с осуществлением организаторами торговли на рынке ценных бумаг (далее - организаторы торговли) контроля за сделками с ценными бумагами, заключенными через организаторов торговли в течение торговой сессии, а также участниками торгов и эмитентами, ценные бумаги которых включены в котировальные листы организатора торговли.

1.2. В целях снижения рисков на рынке ценных бумаг организаторы торговли обязаны создать и обеспечить функционирование системы контроля за сделками с ценными бумагами, заключенными через организаторов торговли в течение торговой сессии, а также за участниками торгов и эмитентами, ценные бумаги которых включены в котировальные листы организатора торговли. Для осуществления указанного контроля организаторами торговли формируются отдельные подразделения (назначаются уполномоченные сотрудники) и создаются автоматизированные системы, обеспечивающие непрерывное в течение торговой сессии отслеживание организатором торговли цен, объемов и характера регистрируемых заявок и сделок в торговой системе (далее - мониторинг).

Целью мониторинга является выявление сделок, в том числе срочных сделок на рынке ценных бумаг, в обычном режиме торговли, при котором информация о совершаемых сделках между участниками торговой сессии используется при расчете фондовых индексов и средневзвешенных цен финансовых

инструментов, цена и объем которых или иные условия, в том числе с учетом предыдущих заявок и сделок, подпадают под установленные настоящим Положением сочетания критериев (нестандартные сделки).

1.3. Мониторинг и контроль в торговой системе ведутся организаторами торговли по предусмотренным настоящим Положением критериям нестандартных сделок, квалифицируемых таковыми при одновременном достижении установленных Таблицей критериев нестандартных сделок (приложение) сочетаний критериев и их параметров. Сочетания критериев и их параметры разрабатываются непосредственно организаторами торговли и подлежат регистрации в Федеральной комиссии по рынку ценных бумаг (далее - Федеральная комиссия). Нестандартные сделки проверяются организаторами торговли на предмет совершения действия участником (участниками) торгов, в том числе выставление заявки, совершение сделки, распространение ложной информации, создающего видимость или способствующего действительному повышению или понижению цен и (или) торговой активности на рынке ценных бумаг, которое вводит в заблуждение участников рынка ценных бумаг, инвесторов, эмитентов относительно уровня цен и (или) ликвидности рынка (далее - манипулирование ценами) или на предмет использования при их совершении служебной информации.

1.4. Контроль за участниками торгов и эмитентами осуществляется путем сбора и анализа финансовой и иной отчетности и сведений, информации об обязательствах, существенных фактах и событиях, указанных в настоящем Положении и иных нормативных актах Федеральной комиссии.

1.5. Структура и организация функционирования системы контроля организаторов торговли определяются следующими документами организаторов торговли:

регламентом мониторинга и контроля за сделками с ценными бумагами во всех режимах торгов, участниками торгов и эмитентами;

порядком проведения проверок нестандартных сделок;

перечнем мер, направленных на предотвращение манипулирования ценами;

перечнем мер, направленных на предотвращение неправомерного использования служебной информации;

кодексом мер дисциплинарного воздействия на участников торгов при нарушениях ими правил, иных документов организатора торговли;

Таблицей критериев нестандартных сделок.

Указанные документы, а также изменения и дополнения к ним до вступления их в силу представляются организаторами торговли для обязательной регистрации в Федеральную комиссию. Федеральная комиссия принимает решение о регистрации или отказе в регистрации таких документов не позднее 60 дней, а изменений и дополнений к ним - не позднее 30 дней после поступления. Федеральная комиссия направляет организатору торговли один экземпляр указанных документов, а также изменений и дополнений к ним с отметкой о регистрации или письменное уведомление с указанием причин отказа в регистрации не позднее 5 дней после принятия соответствующего решения.

2. Требования к системе мониторинга и контроля выставляемых заявок и совершаемых сделок в торговой системе

2.1. Система мониторинга и контроля выставляемых заявок и совершаемых сделок в торговой системе должна технически обеспечивать:

2.1.1. Ведение мониторинга и контроля по следующим критериям:

отклонение цены сделки от цены открытия на установленную величину;

отклонение цены сделки от цены закрытия предыдущих торгов на установленную величину;

отклонение цены заявки (сделки) от цены последней сделки на установленную величину;

отклонение цены сделки от средневзвешенной цены на установленную величину;

отклонение сводного фондового индекса на установленную величину;

ряд сделок участника торгов, ведущий к изменению цены в одном направлении;
сделки, заключаемые участником торгов за свой счет, в которых этот участник одновременно является продавцом и покупателем ценных бумаг (кросс-сделки);
сделки между участниками торгов, при которых стороны таких сделок меняются, выступая в качестве то продавцов, то покупателей (взаимные сделки);
неоднократное изменение и удаление заявок одним участником торгов;
превышение объема сделок участника торгов за торговую сессию установленного процента от общего объема торгов по ценной бумаге;
отклонение объема сделок участника торгов по ценной бумаге за торговую сессию от среднего значения такого оборота для этого участника торгов на установленную величину;
внесение заявок участником торгов после закрытия торговой сессии.

2.1.2. Режим непрерывного поступления информации о текущем состоянии хода торгов и нестандартных сделках на удаленный терминал, устанавливаемый в Федеральной комиссии, с возможностью взаимного информационного обмена и отображением вводимой Федеральной комиссией информации о принятых решениях по вопросам регулирования рынка ценных бумаг, деятельности профессиональных участников рынка ценных бумаг, саморегулируемых организаций профессиональных участников рынка ценных бумаг и контроля за соблюдением законодательства Российской Федерации и нормативных актов о ценных бумагах на контрольном мониторе торговой системы.

Указанная в данном пункте информация передается всем организаторам торговли одновременно согласно установленной между Федеральной комиссией и организатором торговли процедуре.

2.2. Параметры вышеназванных критериев устанавливаются в зависимости от:

периода торгового дня (открытия, торговли, закрытия);
статуса ценной бумаги (допущенные к торгам, включенные в котировальный лист второго уровня, включенные в котировальный лист первого уровня).

2.3. Организатор торговли вправе в установленном пункте 1.5 порядка настоящего Положения исключить или добавить в Таблицу критериев нестандартных сделок сочетания критериев, при которых сделки квалифицируются как нестандартные.

3. Требования к системе контроля участников торгов и эмитентов

3.1. Контроль участников торгов и эмитентов, ценные бумаги которых включены в котировальные листы организатора торговли, осуществляется на основе анализа предоставляемых ими сведений и документов в установленные организатором торговли сроки.

3.2. Участники торгов обязаны в дополнение к документам, установленным законодательством Российской Федерации и нормативными актами Федеральной комиссии, предоставлять организатору торговли следующие сведения и документы:

установленную нормативными актами Федеральной комиссии отчетность и сведения в отношении проведенных сделок;

еженедельно расчет собственных средств (капитала) и обязательств;

ежеквартально установленную законодательством Российской Федерации бухгалтерскую отчетность с приложениями;

копию аудиторского заключения, подготавливаемого в установленных законодательством случаях, в установленный организатором торговли срок;

запрошенные организатором торговли в ходе проведения проверки нестандартных сделок, прямо или косвенно касающиеся таких сделок, в установленный организатором торговли срок;

заверенные в установленном порядке копии документов, подтверждающих полномочия должностных лиц участника на подписание от его имени любых документов, а также документы, подтверждающие образцы подписей таких должностных лиц;

иные документы и сведения, установленные Правилами организатора торговли.

3.3. Эмитенты, ценные бумаги которых включены в котировальные листы, обязаны в дополнение к установленным законодательством Российской Федерации и нормативными актами Федеральной комиссии предоставлять организатору торговли следующие документы и сведения:

ежеквартально установленную законодательством о ценных бумагах отчетность и бухгалтерскую отчетность с приложениями;

запрошенные в ходе проведения проверки нестандартных сделок, прямо или косвенно касающиеся таких сделок, в установленный организатором торговли срок.

4. Требования к организаторам торговли

4.1. Организаторы торговли обязаны:

выявлять в ходе торговой сессии все нестандартные сделки;

проверять нестандартные сделки на предмет манипулирования ценами и использования служебной информации;

проверять нестандартные сделки на предмет нарушений Правил организатора торговли;

раскрывать в установленном порядке полученные от эмитентов или участников торгов сообщения о существенных событиях и действиях, затрагивающих финансово-хозяйственную деятельность эмитентов;

контролировать соблюдение участниками торгов установленных нормативными актами Федеральной комиссии показателей и нормативов.

4.2. Организаторы торговли обязаны представлять в Федеральную комиссию:

ежедневно сведения о всех выявленных в ходе торговой сессии нестандартных сделках;

ежедневно сведения о нарушениях участниками торгов установленных нормативными актами Федеральной комиссии показателей и нормативов;

не позднее следующего дня после окончания проверки нестандартной сделки отчет о ее результатах;

в тот же день сведения о приостановлении участия или исключении участника торгов;

незамедлительно информацию о принятии решения о приостановлении торгов по ценным бумагам (в том числе по одной ценной бумаге).

Указанные сведения представляются по средствам электронной связи, а по указанию Федеральной комиссии - в документарном виде.

5. Порядок действий организаторов торговли при выявлении нестандартных сделок

5.1. При выявлении нестандартной сделки подразделение контроля (уполномоченные сотрудники) организатора торговли осуществляет анализ возможных причин ее появления и проводит проверку такой сделки. При этом организатор торговли вправе проанализировать документы и сведения, полученные от контрагентов по нестандартной сделке, эмитента ценных бумаг и маркет-мейкеров по этой ценной бумаге.

5.2. Если в ходе проверки нестандартной сделки выявляется, что полномочий организатора торговли для установления правомерности действий сторон по сделке недостаточно либо ему оказывается противодействие в проведении проверки, организатор торговли направляет все имеющиеся материалы анализа в Федеральную комиссию.

5.3. При наличии оснований квалифицировать нестандартную сделку как нарушение Правил организатора торговли организатор торговли направляет материалы проверки в дисциплинарный комитет (комиссию) для вынесения решения и принятия мер к участникам торгов - сторонам такой сделки.

5.4. О принятых мерах воздействия к участникам торгов за нарушения Правил организатора торговли организаторы торговли извещают Федеральную комиссию не позднее следующего дня после принятия решения.

Если полномочия организатора торговли не позволяют применить санкции к участнику, нарушившему Правила организатора торговли, организатор торговли направляет все имеющиеся

