

ЗАРЕЄСТРОВАНО
рішенням Національної комісії з
цінних паперів та фондового ринку

від «20» червня 2013р. № 123



Голова Комісії
Д.М. Тевелєв

ЗАТВЕРДЖЕНО
рішенням Біржової ради
ПАТ «Українська біржа»

Протокол № 8 від «29» травня 2013р.



Голова Біржової ради
І.О. Мазєпа

ПОРЯДОК
торгівлі державними цінними паперами
ПАТ «УКРАЇНСЬКА БІРЖА»

м. Київ, 2013

Стаття 1. Загальні положення

1.1. Порядок торгівлі державними цінними паперами на ПАТ «Українська біржа» (надалі – Порядок) розроблений відповідно до Законів України "Про цінні папери та фондовий ринок", "Про державне регулювання ринку цінних паперів в Україні", "Про захист інформації в автоматизованих системах", а також, «Положення про депозитарну діяльність Національного банку України», затвердженого Постановою Правління НБУ від 13.03.03 №114 (в редакції Постанови НБУ № 456 від 15.12.2011р., зареєстрованого в Міністерстві юстиції України 20 січня 2012р. за № 83/20396) зі змінами (далі – Постанова НБУ), нормативних документів Національної комісії з цінних паперів та фондового ринку (надалі - НКЦПФР), які регламентують діяльність фондових бірж, а також Статуту ПАТ «Українська біржа».

1.2. Цей порядок встановлює особливості організації та проведення біржових торгів державними цінними паперами.

1.3. Порядок торгівлі державними цінними паперами ПАТ «Українська біржа» є частиною Правил Публічного акціонерного товариства «Українська біржа» (надалі – Правила Біржі). Питання, які не врегульовані цим Порядком, регулюються Правилами Біржі.

1.4. Порядок, а також зміни та доповнення до нього, затверджуються Біржовою радою ПАТ "Українська біржа" і набувають чинність після їх реєстрації в Національній комісії з цінних паперів та фондового ринку.

1.5. Вимоги Порядку та Правил Біржі є обов'язковими для виконання Біржею, учасниками торгів членами Біржі, а також у випадках, передбачених законодавством України, іншими особами та державними органами, які згідно з Порядком отримали право оголошувати заявки та укладати біржові контракти (договори) з державними цінними паперами.

1.6. Всі розрахунки за контрактами (договорами) щодо державних цінних паперів, укладеними на Біржі, здійснює Національний банк України, як Депозитарій за договором про участь в торгах та розрахунки за контрактами (договорами) з державними цінними паперами.

Стаття 2. Загальні терміни та визначення

2.1. В Порядку застосовуються наступні терміни та визначення:

Біржа – ПАТ «Українська біржа»;

Банк - Головне управління НБУ по м. Києву та Київській області.

Депозитарій – НБУ, як депозитарій державних цінних паперів

Державні цінні папери – цінні папери, випущені відповідно до вимог законодавства України, емітентом яких є уповноважений державний орган (далі - ДЦП).

Учасник торгів ДЦП - член Біржі, а також у випадках, передбачених законодавством України, інші особи та державні органи, які згідно з Правилами Біржі отримали право оголошувати заявки та укладати біржові контракти (договори) з державними цінними паперами.

Невиконання зобов'язань за контрактами (договорами) – не підтвердження розрахунків за контрактом (договором) продавцем чи покупцем або несплата покупцем суми контракту (договору) в день T+n.

2.2. Інші терміни, що вживаються в цьому Порядку, використовуються відповідно до Правил Біржі та законодавства України.

Стаття 3. Учасники торгів державними цінними паперами

3.1. В біржових торгах державними цінними паперами можуть брати участь:

- Члени Біржі, які є клієнтами Депозитарію;
- Національний банк України;
- Інші особи та державні органи, у випадках, передбачених законодавством України.

Стаття 4. Порядок організації та проведення біржових торгів державними цінними паперами.

4.1. Біржа організовує та проводить регулярні торги ДЦП, та забезпечує укладання біржових контрактів (договорів), визначає умови і порядок виконання укладених контрактів (договорів) та здійснює контроль за їх виконанням.

4.2. Торгівля ДЦП здійснюється в ЕТС Біржі.

4.3. Торгівля ДЦП проводиться в режимі:

- ринку котировок - цей режим передбачає можливість укладання контрактів (договорів) на підставі адресних та безадресних заявок без зобов'язання попереднього блокування активів;

- ринку заявок – цей режим передбачає можливість виставляти заявки на купівлю ДЦП та укласти контракти (договори) за умови обов'язкового повного попереднього блокування грошових коштів у розмірі не меншому суми контракту (договору) та виставляти заявки на продаж ДЦП за умови обов'язкового повного попереднього блокування ДЦП у розмірі не меншому кількості, яка вказана в заявці.

4.4. Ціна в заявках вказується у відсотках від номінальної ціни ДЦП.

4.5. Укладення контракту (договору) на підставі адресних та безадресних заявок допускається із строками розрахунку від T+0 до T+10.

4.6. Сума укладеного контракту (договору) визначається шляхом додання до вартості придбаного пакета ДЦП накопиченого купонного доходу на дату розрахунків за контрактом (договором) по відповідним цінним паперам.

4.7. Особливості укладання контрактів (договорів) на підставі заявок з повним забезпеченням (код розрахунків GTS).

Подання Учасником торгів заявки з кодом розрахунків GTS означає, що Учасник торгів подав, а Центральний контрагент отримав оферту на укладення контракту (договору) відповідно до цього Порядку.

В момент подання зустрічної заявки по відношенню до поданої заявки, Центральний контрагент зобов'язаний прийняти (акцептувати) адресовані йому оферти, зроблені шляхом подання вказаних заявок.

Центральний контрагент акцептує оферти, які зробили учасники торгів, шляхом направлення їм відповідного повідомлення з інформацією про кількість та ціну цінних паперів, що є предметом контракту (договору). Вказані повідомлення не є заявками.

Повідомлення Центрального контрагента про акцептування оферт, зроблених учасниками торгів, направляються учасникам торгів засобами ЕТС Біржі. Момент надходження такого повідомлення вважається моментом укладання контракту (договору) Центральним контрагентом з ними.

Центральний контрагент укладає контракти (договори) з Учасниками торгів виключно з метою забезпечення режиму повної анонімності в процесі торгів та розрахунків.

4.8. Укладання контрактів (договорів) без обов'язкового повного попереднього блокування активів можливе на умовах відкладеного виконання. Термін виконання контракту (договору) з відкладеним виконанням не може перевищувати 30 (тридцять) робочих днів.

В день виконання контракту (договору) з відкладеним виконанням учасники торгів, які уклали цей контракт (договір) повинні здійснити повне блокування активів в кількості зазначеній в контракті (договорі) для забезпечення розрахунків за принципом «поставка проти оплати».

4.9. Особливості укладання контрактів (договорів) з відкладеним виконанням на підставі двох зустрічних адресних заявок Учасника торгів в інтересах різних його клієнтів, поданих цим Учасником торгів до ЕТС відповідно до договорів комісії, укладених Учасником торгів зі своїми клієнтами (Пов'язані контракти).

Подання Учасником торгів двох зустрічних адресних заявок в інтересах різних його клієнтів означає, що Учасник торгів подав, а Центральний контрагент отримав оферту на укладення двох контрактів (договорів) з відкладеним виконанням з цим Учасником торгів відповідно до Правил Біржі. При цьому, ці контракти (договори) є Пов'язані контракти).

В момент подання зустрічної адресної заявки по відношенню до поданої заявки, Центральний контрагент зобов'язаний прийняти (акцептувати) адресовані йому оферти, зроблені шляхом подання вказаних заявок.

Центральний контрагент акцептує оферти, які зробив Учасник торгів, шляхом направлення йому відповідних повідомлень з інформацією про кількість та ціну цінних паперів, що є предметом контракту (договору). Вказані повідомлення не є заявками.

Повідомлення Центрального контрагента про акцептування оферт, зроблених учасником торгів, направляються Учаснику торгів засобами ЕТС Біржі. Момент надходження таких повідомлень вважається моментом укладання контракту (договору) Центральним контрагентом з ним.

Центральний контрагент укладає контракт (договір) з відкладеним виконанням з Учасником торгів виключно з метою забезпечення можливості укладання контракту (договору) з відкладеним виконанням на Біржі між клієнтами одного Учасника торгів.

Стаття 5. Розрахунки за контрактами (договорами) з ДЦП (з одностороннім забезпеченням розрахунків)

5.1. Для участі у торгах ДЦП, які проводить Біржа, учасник торгів (член Біржі) повинен здійснити попереднє блокування ДЦП в Депозитарії (на відповідних рахунках щодо обліку ДЦП, заблокованих для участі у торгах) шляхом подання відповідного розпорядження на переказ ДЦП.

5.2. Біржа до початку торгів та протягом торгівельного дня отримує від Депозитарію інформацію щодо заблокованих ДЦП.

5.3. Після отримання від Депозитарію інформації про стан відповідних рахунків щодо обліку ДЦП, заблокованих для участі у торгах, учасник торгів може подавати на Біржу Заявки на продаж ДЦП.

5.4. Біржа перевіряє забезпечення поданих Заявок на продаж ДЦП.

5.5. За результатами проведених торгів Біржа складає відомість сквитованих розпоряджень, яку надає Депозитарію.

5.6. Депозитарій здійснює перевірку розпоряджень та забезпечення укладених контрактів (договорів) щодо ДЦП.

У випадку негативних результатів перевірки Депозитарій вносить реквізити таких розпоряджень до електронної відомості про відмову в прийнятті до виконання, визначає обсяги недостатності забезпечення ДЦП відповідного контракту (договору) та надає цю інформацію Біржі.

Біржа аналізує отриману інформацію про відбраковані Депозитарієм розпорядження, виправляє помилки, складає нову відомість сквитованих розпоряджень та надає Депозитарію.

За позитивними результатами перевірки Депозитарій переводить ДЦП на відповідні рахунки щодо обліку ДЦП, заблокованих для здійснення розрахунків.

5.7. Депозитарій надає до банку клієнта-одержувача повідомлення про необхідність перерахування коштів за контрактами (договорами) щодо ДЦП.

Учасник торгів здійснює перерахування коштів за придбані ДЦП у порядку, передбаченому Постановою НБУ.

5.8. Якщо на дату, яка визначена у відомості сквитованих розпоряджень Біржі за контрактами (договорами) купівлі-продажу ДЦП, що виконуються в режимі одиночних розрахунків, від учасника торгів (або його депонента) надійшли кошти за контрактами (договорами) щодо ДЦП, то Депозитарій здійснює переказ ДЦП з рахунку учасника торгів - постачальника ДЦП на рахунок учасника торгів – одержувача ДЦП і відповідну інформацію надає Біржі.

5.9. Якщо на дату, яка визначена у відомості сквитованих розпоряджень Біржі за контрактами (договорами) купівлі-продажу ДЦП, що виконуються в режимі одиночних розрахунків, від учасника торгів (або його депонента) не надійшли кошти за контрактами (договорами) щодо ДЦП, то Депозитарій не здійснює переказ ДЦП з рахунку учасника торгів - постачальника ДЦП на рахунок учасника торгів – одержувача ДЦП. У цьому разі Депозитарій надає Біржі інформацію про неплатників за укладеними контрактами (договорами) щодо ДЦП на торгах, які проводилися Біржею.

5.10. Зобов'язання сторін стосовно поставки та оплати ДЦП за контрактом (договором) з одностороннім забезпеченням розрахунків припиняються шляхом їх виконання. У випадку невиконання зобов'язань сторін стосовно поставки та оплати ДЦП за контрактом (договором), ці зобов'язання припиняються на наступний робочий день після дати, визначеної в контракті (договорі) як дата виконання.

5.11. Припинення зобов'язань сторін стосовно поставки та оплати ДЦП за контрактом (договором) не є підставою для звільнення винної сторони від своєчасної та в повному обсязі оплати біржового збору та оплати штрафу.

5.12. До неплатників за контрактами (договором) з ДЦП Біржа застосовує санкції відповідно до статті 33 Правил Біржі.

5.13. У разі укладання контракту (договору) з ДЦП на умовах самостійних розрахунків учасник торгів покупець повинен проінформувати Біржу про проведення розрахунків та виконання біржового контракту (договору) протягом дня виконання такого контракту (договору) електронною поштою на адресу: trade@ux.ua та учасник-торгів продавець протягом 2-х днів, шляхом надання належним чином оформленої копії платіжного доручення.

Стаття 6. Розрахунки за контрактами (договорами) з ДЦП (з двостороннім забезпеченням розрахунків)

6.1. Депозитарій та Біржа здійснюють розрахунки учасників торгів - торговців цінними паперами з двостороннім забезпеченням за умови, якщо торговець цінними паперами є зберігачем (має відповідну ліцензію на провадження професійної діяльності на фондовому ринку - депозитарної діяльності зберігача цінних паперів та є клієнтом Депозитарію), а також депозитарного обслуговування таким зберігачем клієнтів торговця цінними паперами, в інтересах яких цей торговець укладає на Біржі контракти (договори) щодо ДЦП.

6.2. Для участі у торгах ДЦП, які проводить Біржа, учасник торгів (член Біржі) повинен здійснити попереднє блокування ДЦП в Депозитарії (на відповідних рахунках щодо обліку ДЦП, заблокованих для участі у торгах) шляхом подання відповідного розпорядження на переказ ДЦП.

6.3. Біржа до початку торгів та протягом торгівельного дня отримує від Депозитарію інформацію щодо заблокованих ДЦП.

6.4. Учасник торгів перераховує грошові кошти щодо забезпечення заявок на торги для купівлі ДЦП на банківський рахунок Біржі, відкритий в Банку.

6.5. Біржа до початку торгів та протягом торгівельного дня отримує від Банку інформацію про надходження коштів від учасників торгів.

6.6. Після отримання від Депозитарію інформації про стан відповідних рахунків щодо обліку ДЦП, заблокованих для участі у торгах, учасник торгів може подавати на Біржу Заявки на продаж ДЦП.

6.7. Після отримання від Біржі інформації про зарахування коштів для участі у біржових торгах, учасник торгів може подавати на Біржу Заявки на купівлю ДЦП.

6.8. Біржа перевіряє забезпечення Заявок (ДЦП та коштів) .

6.9. За результатами проведених торгів Біржа складає відомість сквитованих розпоряджень, яку надає Депозитарію.

6.10. Депозитарій здійснює перевірку відомості сквитованих розпоряджень та забезпечення укладених контрактів (договорів) щодо ДЦП.

У випадку негативних результатів перевірки Депозитарій вносить реквізити таких розпоряджень до електронної відомості про відмову в прийнятті до виконання, визначає обсяги недостатності забезпечення ДЦП відповідного контракту (договору) з обрахуванням сальдо обов'язків/прав учасника торгів щодо ДЦП та надає цю інформацію Біржі.

Біржа разом аналізує отриману інформацію про відбраковані Депозитарієм розпорядження, виправляє помилки, складає нову відомість сквитованих розпоряджень та надає Депозитарію.

За позитивними результатами перевірки Депозитарій переводить ДЦП на відповідні рахунки щодо обліку ДЦП, заблокованих для здійснення розрахунків, та здійснює взаємозалік в одиночному або нетинговому режимах.

6.11. Депозитарій на підставі відомості сквитованих розпоряджень за контрактами (договорами) купівлі-продажу ДЦП під час проведення розрахунків в одиночному або нетинговому режимах надає Біржі повідомлення про необхідність перерахування коштів за контрактами (договорами) щодо ДЦП. Депозитарій на підставі відомості сквитованих розпоряджень за контрактами (договорами) купівлі-продажу ДЦП, що виконуються в режимі нетингових розрахунків, здійснює взаємозалік зобов'язань/прав за цими контрактами (договорами) та формує відомість проведення взаємозаліку в порядку, визначеному пунктами 8.6 та 8.7 розділу 8 Постанови НБУ.

6.12. Біржа надає платіжні доручення Банку відповідно до повідомлень Депозитарію про необхідність перерахування коштів на рахунок учасників торгів - постачальників ДЦП. Зазначена норма діє у випадку, якщо Біржа не отримує від учасника торгів - постачальника ДЦП інших розпоряджень стосовно грошових коштів, які належать йому внаслідок укладених біржових контрактів (договорів).

6.13. За результатами проведення грошових розрахунків за контрактами (договорами) щодо ДЦП Біржа надає Депозитарію повідомлення про перерахування коштів на рахунок учасників торгів - постачальників ДЦП.

6.14. Депозитарій здійснює звірку реквізитів повідомлення про перерахування коштів з відповідними реквізитами розпоряджень з відомості сквитованих розпоряджень/проведення взаємозаліку. Якщо звірка відбулась, то здійснює розрахунки в цінних паперах (переводить ДЦП на відповідні рахунки учасників торгів – одержувачів щодо обліку ДЦП, заблокованих для участі в торгах) і надає відповідну інформацію Біржі про стан відповідних рахунків щодо обліку ДЦП, заблокованих для участі у торгах.

6.15. У випадку, якщо звірка реквізитів повідомлення про перерахування коштів з відповідними реквізитами розпоряджень з відомості сквитованих розпоряджень/проведення взаємозаліку не відбулась, Депозитарій переказує ДЦП з відповідних рахунків учасників торгів-постачальників щодо обліку ДЦП, заблокованих для здійснення розрахунків за результатами торгів, на відповідні рахунки учасників торгів-постачальників щодо обліку ДЦП, заблокованих для участі в торгах і надає відповідну інформацію Біржі.

6.16. У випадку надходження від Депозитарію інформації стосовно не розрахунків учасниками торгів за придбані ДЦП, Біржа повинна разом з учасниками торгів усунути причини не проведення розрахунків та здійснити грошові розрахунки за результатами Біржових торгів за придбані ДЦП.

6.17. За письмовим розпорядженням учасника торгів (щодо окремої суми грошових коштів та/або сум грошових коштів, які отримані від операцій з ДЦП за певний період, визначений учасником торгів) Біржа з метою організації торгів ДЦП та централізованого укладення і виконання контрактів (договорів) щодо ДЦП, в тому числі здійснення розрахунків за ними, не перераховує зазначені грошові кошти на банківський рахунок учасника торгів, а здійснює блокування зазначених коштів на наступні операції з купівлі ДЦП та розрахунки за придбання ДЦП.

В разі отримання Біржею розпорядженням учасника торгів щодо здійснення блокування грошових коштів, отриманих за продані ДЦП, на наступні операції з купівлі ДЦП та розрахунки за придбання ДЦП, Біржа повідомляє Депозитарій про проведення розрахунку учасником торгів-постачальника ДЦП на підставі внутрішнього аналітичного обліку Біржі.

6.18. Зобов'язання сторін стосовно поставки та оплати ДЦП за контрактом (договором) з двостороннім забезпеченням розрахунків припиняються шляхом їх виконання. У випадку невиконання зобов'язань сторін стосовно поставки та оплати ДЦП за контрактом (договором), ці зобов'язання припиняються у відповідності до Правил Біржі

6.19. До неплатників за контрактами (договорами) з ДЦП Біржа застосовує санкції відповідно до статті 33 Правил Біржі.