

«Утверждены»  
Решением Правления АО «Товарная биржа  
«ЕТС», протокол № 1039 от «28» июня 2017 года

**РАЗЪЯСНЕНИЕ**  
**АО «ТОВАРНАЯ БИРЖА «ЕТС» (БИРЖА ЕТС) КАСАТЕЛЬНО ИСПОЛЬЗОВАНИЯ**  
**ЧЛЕНАМИ БИРЖИ ЕТС ТЕХНОЛОГИЙ АВТОМАТИЗИРОВАННОЙ УСКОРЕННОЙ**  
**ОБРАБОТКИ И ПОДАЧИ ДАННЫХ (РОБОТОВ)**

АО «Товарная биржа «ЕТС» (далее - Биржа ЕТС) по вопросу применения Членами Биржи ЕТС технологий автоматизированной ускоренной обработки и подачи данных (роботов) согласно **Кодексу брокерской (дилерской) этики для членов АО «Товарная биржа «Евразийская Торговая Система»**, утвержденному решением Правления ЕТС, протокол № 901 от 28.11.2016 г. (далее – Кодекс брокерской этики), сообщает следующее.

1) Согласно п. 8 Кодекса брокерской этики: «Членам Биржи ЕТС запрещается использовать роботы (технологии автоматизированной ускоренной обработки и подачи данных) для выставления заявок и заключения сделок в процессе биржевых торгов, за исключением торгов на секции срочного рынка Биржи ЕТС, с целью манипулирования ценами (не рыночная конкуренция).»

В целях применения указанной нормы Кодекса брокерской этики, под роботами (технологиями автоматизированной ускоренной обработки и подачи данных) следует понимать внешние программно-технические системы членов Биржи ЕТС скорость обращений от которых к торговой системе Биржи ЕТС составляет более одного обращения в секунду.

Указанное ограничение по роботам призвано минимизировать потенциальный ущерб Биржи ЕТС и ее клиентов от нерыночных способов ограничения конкуренции в процессе биржевых торгов.

При этом, данные внешние программно-технические системы Членов Биржи ЕТС (далее - ВПТС) должны отвечать установленным Биржей ЕТС требованиям и быть сертифицированы Биржей ЕТС.

2) Требования к ВПТС установлены **Требованиями к внешним программно-техническим средствам и порядку их сопряжения с торговой системой АО «Товарная биржа «ЕТС»**, утвержденными решением Правления ЕТС, протокол № 447 от 01.10.2014 г. (далее – Требования).

Согласно Требованиям все внешние программно-технические средства Членов Биржи ЕТС – *«автоматизированные программно-технические средства сбора, подготовки заявок к вводу и направления заявок в Торговые системы, а также получения и обработки информации из Торговых систем, работающие в режиме, обеспечивающем контроль со стороны Пользователя ВПТС за всеми действиями, совершаемыми с ее использованием»* должны быть сертифицированы Биржей ЕТС. В случае принятия Биржей ЕТС решения о соответствии ВПТС Требованиям, ВПТС подлежит включению в Список ВПТС, соответствующих требованиям ЕТС при сопряжении с Торговой системой.

В соответствии с п. 2.1. Требованиям: «Сопряжения с Торговой системой и обмен данными между ними, должны осуществляться через универсальный аппаратно-программный шлюз (или аппаратно-программные шлюзы) в соответствии с требованиями, отраженными в специальном Приложении к договору, регламентирующему осуществление технического доступа к Торговой системе, в котором определяются условия использования и администрирования ВПТС и аппаратно-программных шлюзов ЕТС».

Таким образом, ВПТС Члена Биржи ЕТС должно пройти сертификацию Биржи ЕТС и подключаться к Торговой системе через универсальный аппаратно-программный шлюз (или аппаратно-программные шлюзы).

3) Ответственность Членов Биржи ЕТС за невыполнение вышеуказанных требований к ВПТС установлена внутренними нормативными документами Биржи ЕТС, обязательными для Членов Биржи ЕТС:

- Согласно п. 9.5, п. 9.7. Условий оказания услуг информационно-технического обеспечения АО «Товарная биржа «ЕТС», утвержденных решением СД ЕТС, протокол № 57 от 18.10.2011 г., временное отключение Клиента от Серверной части Программного обеспечения может быть осуществлено Биржей по решению Правления Биржи в случае нарушения Клиентом внутренних нормативных документов Биржи. Клиент, отключенный от Серверной части Программного обеспечения по решению Правления, подлежит обратному подключению только после устранения всех нарушений положений внутренних нормативных документов Биржи;

- Согласно пункту 11 Раздела 4. Кодекса брокерской этики, Биржа ЕТС, в случае выявления нарушений членом Биржи ЕТС Кодекса брокерской этики и других внутренних документов Биржи ЕТС и ее клиринговой организации, вправе применить к последнему дисциплинарные меры воздействия, предусмотренные статьей 7 Регламента биржевого арбитража АО «Товарная биржа «Евразийская Торговая Система», утвержденного решением Правления ЕТС, протокол № 233 от 12.06.2013 г. (далее - Регламент).

В соответствии с пунктом 7.1. статьи 7 Регламента, уполномоченный орган управления Биржи вправе применить к Участникам торгов следующие меры дисциплинарного воздействия:

- 1) Предписание;
- 2) Предписание с публичным извещением;
- 3) Приостановление на определенный срок доступа к торгам в секции торговли в предоставленном режиме доступа к торгам;

Указанные меры дисциплинарного воздействия могут быть применены уполномоченным органом управления Биржи к Участникам торгов, как по рекомендации Биржевого арбитража, так и без его рекомендации.

- Согласно п. 8.3. Положения о членстве АО «Товарная биржа «ЕТС», утвержденного решением СД ЕТС, протокол № 6 от 21.04.2009 г., исключение из Членов одной или нескольких Секций Биржи ЕТС осуществляется по решению Совета директоров Биржи ЕТС. Основаниями для исключения являются неисполнение или недобросовестное исполнение обязанностей, установленных внутренними документами Биржи ЕТС.

С учетом вышесказанного, за нарушение вышеуказанных требований к ВПТС (за не выполнение требований к ВПТС по допустимой скорости обращений к Торговой системе; за использование несертифицированной ВПТС; за неиспользование шлюза для сопряжения ВПТС с Торговой системой), Биржа ЕТС намерена применять к Членам Биржи ЕТС вышеперечисленные меры воздействия.

При этом результаты торгов, в ходе которых состоялось заключение сделки Членом Биржи ЕТС, нарушившим требования к ВПТС, подлежат аннулированию.

Председатель Правления



Оразаев К.Ч.

Handwritten marks and signatures at the bottom of the page, including the number '45' and a large signature.