

Утверждены
протоколом заседания Биржевого
комитета Республики Казахстан
от 5 марта 2020 года № 3

*С учетом изменений и дополнений
внесенных Протоколом Биржевого
комитета Республики Казахстан
от 2 июня 2021 года №10*

Рекомендации (секционные правила) по реализации битума через товарные биржи

Глава 1. Общие положения

1. Настоящие Рекомендации по реализации битума через товарные биржи (далее – Рекомендации) разработаны в целях обеспечения взаимодействия между участниками биржевой торговли битумом, товарными биржами и уполномоченным органом в области регулирования и оборота нефтепродуктов.
2. Рекомендации носят рекомендательный характер и содержат:
описание участников биржевой торговли битумом;
рекомендуемый порядок организации биржевой торговли битумом;
рекомендуемый порядок проведения биржевых торгов битумом.
3. Рекомендации подлежат применению до утверждения специального нормативного правового акта, регламентирующего правовые отношения в сфере реализации битума через товарные биржи.

Глава 2. Описание участников биржевой торговли битумом

4. Участниками биржевой торговли битумом являются продавцы и покупатели битума, аккредитованные на товарной бирже в качестве дилера либо действующие через аккредитованных брокеров.
5. Продавцами битума на товарной бирже являются производители битума и собственники битума, произведенного в процессе переработки принадлежащего им на праве собственности или иных законных основаниях углеводородного сырья.
6. Покупателями битума на товарной бирже являются физические и юридические лица, осуществляющие деятельность в сфере строительства и ремонта автомобильных дорог и имеющих опыт подобной деятельности не

менее года, а также лица имеющие соответствующую инфраструктуру для хранения битума.

Глава 3. Рекомендуемый порядок организации биржевой торговли битумом

7. Для проведения биржевых торгов битумом товарная биржа, имеющая намерение осуществлять организацию биржевых торгов битумом, обеспечивает наличие:

- 1) лицензии на право занятия деятельностью товарных бирж;
- 2) электронной торговой системы товарной биржи на праве собственности с использованием механизма двойного встречного анонимного аукциона;
- 3) уставного капитала товарной биржи не менее трехсоттысячекратного размера месячного расчетного показателя, установленного на соответствующий финансовый год законом Республики Казахстан о республиканском бюджете;
- 4) техническое обеспечение электронной биржевой регистрации внебиржевых договоров по реализации битума в течение каждого рабочего дня с 10.00 до 17.00 часов.

8. Электронная торговая система товарной биржи должна быть введена в промышленную эксплуатацию и иметь действующий акт по результатам испытаний на соответствие требованиям информационной безопасности полученный в порядке установленном Законом Республики Казахстан «Об информатизации», а также соответствовать следующим функциональным техническим требованиям:

обеспечивать постоянный обмен информацией с зарегистрированными пользователями при подаче ими торговых заявок в систему, в режиме реального времени, не менее до 0,1 секунды;

обеспечивать подключение не менее ста активных клиентов в режиме «просмотр торгов»;

иметь синхронизацию с государственной информационной системой уполномоченного органа в области регулирования и оборота нефтепродуктов.

9. Товарная биржа, планирующая осуществлять организацию биржевых торгов битумом предварительно проводит для членов Биржевого комитета Республики Казахстан удаленные биржевые торги в тестовом режиме с участием в одних торгах по условному торговому инструменту не менее трех условных продавцов и не менее пяти условных покупателей, позволяющие подтвердить возможность электронной торговой системы товарной биржи выполнить технические требования согласно пункту 8 настоящих Рекомендаций.

Проведение удаленных тестовых биржевых торгов проводится в соответствии с описанием бизнес-процессов при торговле в режиме двойного встречного аукциона, приведенным в приложении к настоящим Рекомендациям.

10. По итогам проведения тестовых торгов, а также оценки полноценности работы торговой и клиринговой систем Биржевой комитет Республики

Казахстан принимает решение о соответствии или несоответствии товарной биржи принципам создания благоприятных условий для добросовестной и анонимной конкуренции биржевой торговли битумом.

11. Биржевой комитет Республики Казахстан протоколом информирует товарную биржу о своем решении и выносит заключение о соответствии или несоответствии товарной биржи принципам создания благоприятных условий для добросовестной и анонимной конкуренции биржевой торговли битумом участникам биржевой торговли битумом.

Товарная биржа, в отношении которой Биржевым комитетом Республики Казахстан принято решение о соответствии требованиям установленных в настоящих Рекомендациях, в дальнейшем при организации собственной торговой деятельности руководствуется требованиями главы 4 настоящих Рекомендаций.

Биржевой комитет в случае принятия решения о соответствии информирует отраслевые ассоциации и участников рынка о принятом решении в отношении товарной биржи.

Глава 4. Рекомендуемый порядок проведения биржевых торгов битумом

12. Для участия в биржевых торгах участники биржевой торговли битумом вносят денежное биржевое обеспечение на счет клиринговой организации, обслуживающей товарную биржу.

Размер биржевого обеспечения для участия в биржевых торгах устанавливается в размере пяти процентов от предполагаемой суммы биржевой сделки.

Порядок внесения, удержания и возврата биржевого обеспечения определяется клиринговой организацией товарной биржи.

13. Товарная биржа рассчитывает цены, а также индексы по показателям битума, основанные на информации о сделках, заключенных на биржевых торгах в рамках торгового дня.

14. Товарная биржа организует систему управления рисками, связанными с организацией биржевой торговли битумом.

15. Товарная биржа проводит пять основных торговых сессий по каждому торговому инструменту.

16. Об изменении графика и периодичности проведения торговых дней и торговых сессий, участники биржевой торговли битумом извещаются с использованием торговой системы товарной биржи или другим доступным способом, не позднее, чем за 24 часа до начала торгового дня.

17. Минимальный размер партии биржевого товара, возможного к приобретению через товарную биржу, составляет один лот. Размер лота при вагонной поставке составляет одну вагонную партию, при поставке автомобильным транспортом лот равен одной тонне.

18. Заявки на реализацию выставляются продавцами битума в лотах.

19. Биржевые торги битумом проводятся в режиме двойного встречного аукциона в следующем порядке:

1) в течение торговой сессии участники биржевой торговли битумом подают в электронную торговую систему товарной биржи заявки на покупку (продажу) битума;

2) в течение торгового дня проводится одна торговая сессия;

3) продолжительность торговой сессии составляет один час, время начала торговой сессии 15.00 по времени города Нур-Султан;

4) базисами поставки определяются пункты отпуска производителями нефтепродуктов на условиях EXW Инкотермс-2020;

в заявке на покупку (продажу) битума указываются следующие сведения:

наименование участника торгов битумом;

вид заявки (на покупку или продажу);

наименование покупаемого (продаваемого) битума;

цена битума, указываемая в тенге;

количество битума, заявляемого на покупку (продажу);

5) все принятые заявки сводятся в очереди неудовлетворенных заявок на продажу и на покупку битума:

заявки на покупку ранжируются в порядке убывания указанных в них цен, а при равных ценах – в порядке очередности их поступления в торговую систему;

заявки на продажу ранжируются в порядке возрастания указанных в них цен, а при равных ценах – в порядке очередности их поступления в торговую систему;

б) вновь поступившая заявка на продажу удовлетворяется за счет имеющихся заявок на покупку, в которых цены покупки выше или равны цене поступившей заявки, начиная с заявки на покупку, содержащей наивысшую цену. Данный процесс продолжается до полного удовлетворения такой заявки на продажу либо до исчерпания приемлемых по цене заявок на покупку;

7) вновь поступившая заявка на покупку удовлетворяется за счет имеющихся заявок на продажу, в которых цены продажи ниже или равны цене поступившей заявки, начиная с заявки на продажу, содержащей самую низкую цену. Данный процесс продолжается до полного удовлетворения такой заявки на покупку либо до исчерпания приемлемых по цене заявок на продажу.

На основании вновь поступившей заявки совершаются одна или более сделок, в зависимости от числа востребованных встречных заявок на покупку (продажу) битума. Сделки совершаются по ценам, указанным в востребованных встречных заявках;

8) полностью удовлетворенные заявки на покупку (продажу) в дальнейшем в биржевых торгах не участвуют. Частично удовлетворенные заявки продолжают участвовать в биржевых торгах в части неудовлетворенных объемов на покупку (продажу);

9) участники биржевой торговли битумом вправе подавать неограниченное количество заявок на покупку (продажу) битума. При этом

участник биржевой торговли битумом может снять поданную заявку в любой момент до заключения биржевой сделки;

10) сделки, зарегистрированные в торговой системе товарной биржи, с ценами, не соответствующими в заявке на покупку (продажу) битума, подлежат незамедлительному аннулированию товарной биржи, о чем участники биржевой торговли битумом извещаются с использованием торговой системы товарной биржи или другим доступным способом.

20. Минимальный уровень цены битума, формируемый в течение торговой сессии, не должен быть менее девяноста пяти процентов от базовой цены, а максимальный уровень цены не должен быть более ста пяти процентов от базовой цены.

21. На торговых сессиях в качестве базовой цены битума признаются следующие цены:

1) на первых биржевых торгах битумом по вновь утвержденному торговому инструменту базовая цена устанавливается на уровне среднеарифметического значения текущих заключаемых контрактов оптовых цен соответствующего вида битума на базисе поставки соответствующего производителя битума.

2) *Исключен Протоколом Биржевого комитета Республики Казахстан от 2 июня 2021 года №10.*

3) если по итогам торговой сессии были заключены сделки по не менее чем 70% объема битума, подлежащего реализации в данную торговую сессию в соответствии с пунктом 22 настоящих Рекомендаций, - на следующей торговой сессии базовая цена устанавливается на уровне средневзвешенной цены битума, сложившейся за такую торговую сессию;

4) если по итогам торговой сессии были заключены сделки по менее 70% объема битума, подлежащего реализации в данную торговую сессию в соответствии с пунктом 22 настоящих Рекомендаций, но при этом средневзвешенная цена битума сложилась на уровне или выше базовой цены данной торговой сессии, то на следующей торговой сессии базовая цена не изменяется;

5) если по итогам торговой сессии были заключены сделки по менее 70% объема битума, подлежащего реализации в данную торговую сессию в соответствии с пунктом 22 настоящих Рекомендаций, но при этом средневзвешенная цена битума сложилась ниже базовой цены данной торговой сессии, то на следующей торговой сессии базовая цена устанавливается на уровне средневзвешенной цены битума, сложившейся за такую торговую сессию;

б) если по итогам торговой сессии были заключены сделки по менее чем 20% объема битума, подлежащего реализации в данную торговую сессию в соответствии с пунктом 22 настоящих Рекомендаций, либо сделки не заключались, то на следующей торговой сессии базовая цена уменьшается на пять процентов.

22. Продавцы битума выставляют на реализацию объем битума, обязательный для реализации на внутреннем рынке Республики Казахстан через товарные биржи.

23. *Исключен Протоколом Биржевого комитета Республики Казахстан от 2 июня 2021 года №10.*

24. *Исключен Протоколом Биржевого комитета Республики Казахстан от 2 июня 2021 года №10.*

25. *Исключен Протоколом Биржевого комитета Республики Казахстан от 2 июня 2021 года №10.*

26. В случае если продавцом битума выставлялся на реализацию на пяти основных торговых сессиях, но не был реализован объем битума, продавец уведомляет об этом уполномоченный орган в области оборота нефтепродуктов, а такой объем битума реализуется на внутреннем рынке Республики Казахстан по прямым контрактам.

27. Результаты биржевых торгов битумом публикуются на собственном интернет-ресурсе товарной биржи с соблюдением условий об конфиденциальности сторон биржевых сделок, не позднее одного рабочего дня, следующего за торговым днем, в специальном разделе для размещения результатов биржевых торгов битумом.

28. Продавец обеспечивает регистрацию на товарной бирже заключенных внебиржевых сделок битумом в объеме не менее 50 % от плана поставки на планируемый месяц.

29. Товарная биржа на основании заключенных сделок рассчитывает биржевые и внебиржевые индексы и с учетом полученных данных выводит биржевой коридор цены битума с его опубликованием на интернет ресурсе товарной биржи. При этом, товарная биржа ежемесячно доводит до сведения членов Биржевого комитета Республики Казахстан отчет об итогах биржевых торгов битумом с указанием сформировавшихся биржевых и внебиржевых индексов.

30. В случае наличия на внутреннем рынке Республики Казахстан форс мажорных ситуаций, вызванных снижением объема производства битума (плановый и внеплановый ремонт, аварийные ситуации, планово-предупредительные работы и т.п.) Биржевой комитет Республики Казахстан по согласованию с уполномоченным органом в области оборота нефтепродуктов вправе до периода стабилизации ситуации на рынке выносить рекомендации по базовым ценам для основных торговых сессий либо о приостановлении биржевых торгов битумом.

Приложение
к Рекомендациям по
реализации битума через
товарные биржи

**Описание бизнес-процессов при торговле
в режиме двойного встречного аукциона**

1. Биржевые торги в режиме двойного встречного аукциона проводятся в течение торговой сессии в порядке непрерывного автоматического сопоставления электронной торговой системой товарной биржи заявок на покупку и продажу, по которому каждая подаваемая заявка проверяется на совпадение по количеству товара и цене со встречными заявками, которые образуют реестр (очередь) заявок.

2. При совпадении параметров подаваемой заявки с параметрами встречных заявок происходит заключение биржевой сделки.

3. Основные базовые характеристики двойного встречного аукциона в торговой системе товарной биржи:

1) наличие информации в режиме онлайн обо всех выставленных участниками торгов заявках, как на покупку, так и на продажу. При этом торговая система должна позволять иметь информацию о ходе торгов по всем инструментам;

2) возможность выставления (редактирования) заявок на покупку или на продажу по любому из инструментов, к которому допущен участник торгов, не выходя из торговой системы, где отображается ход торгов. Выставленная (отредактированная) заявка должна в режиме реального времени отражаться в торговой системе по конкретному торговому инструменту;

3) участники в ходе торгов вправе подавать неограниченное количество заявок, при условии наличия достаточного количества гарантийного (биржевого) обеспечения на их счетах в расчетно-клиринговой системе;

4) торговая система контролирует достаточность гарантийного (биржевого) обеспечения участника. Денежные средства блокируются в ходе торгов под каждую выставленную заявку и заключенную сделку, в соответствии с установленным товарной биржей размером гарантийного обеспечения. Участник может выставить заявку только в размере свободных денежных средств (денежных средств, не заблокированных под заявки или сделки);

5) размер заблокированного биржевого обеспечения определяется в порядке, определенным законодательством Республики Казахстан о товарных биржах;

б) в торговой системе имеется возможность контроля средств биржевого обеспечения (информация о свободных и заблокированных средствах);

7) заключение сделки осуществляется по следующему алгоритму:

каждая подаваемая заявка проверяется на совпадение с встречными заявками, которые поданы в систему;

при пересечении параметров подаваемой заявки с параметрами встречных заявок происходит заключение сделок;

при равенстве цен заявка, поданная раньше, удовлетворяется раньше, чем заявка, поданная позже;

сделка заключается всегда по цене лучшей заявки, находящейся в очереди встречных заявок;

8) заявки имеют возможность частичного исполнения (сделка заключается на объявленную часть товара), при этом неисполненная ее часть может быть снята участником торгов в любое время до ее акцепта;

9) в торговой системе имеется информация обо всех заключенных в ходе торгов сделках, с отображением основных параметров каждой сделки: уникальный номер, дата и время заключения, наименование либо код товара, цена, объем, контрагенты и иные параметры;

10) не допускаются шаг цены и заключение кросс-сделок;

11) сделки заключаются непрерывно и не требуют дополнительных действий со стороны участников торгов.

Согласовано

07.06.2021 13:06 Тушиев Евгений Турпалэлиевич

07.06.2021 13:16 Ортақбаева Асель Б

Подписано

07.06.2021 17:45 Самбетов Болат Куанышбекович

Агентство по защите и развитию конкуренции Республики Казахстан - Самбетов А.Д.