



Протокол № 3
заседания Совместного Совета по валютному рынку
СРО НФА – ACI Russia

г. Москва

04 октября 2018 г.

Форма проведения заседания: очное голосование по вопросам повестки дня, поставленным на голосование.

Место проведения заседания: Москва, Большой Сергиевский переулок, дом 10.

Члены Совета, принявшие участие в заседании:

1. Романчук Сергей (Металлинвестбанк) – Председатель Совета
2. Лях Валерий (Банк России) – заместитель Председателя Совета
3. Антипова Светлана (Атон)
4. Видов Павел (ФК "ИНТРАСТ")
5. Капранова Вероника (Банк России)
6. Егоров Евгений (Банк ВЕСТА)
7. Козлов Илья (AIM Capital)
8. Пискулов Дмитрий (Московская Биржа)
9. Сенина Анна (Томсон Рейтер)
10. Скабелин Андрей (Московская Биржа)
11. Соловьев Михаил (Морган Стенли Банк)
12. Щепилов Сергей

Приглашенные:

1. Катышева Ирина (Банк России)
2. Майборода Дмитрий (Ассоциация форекс-дилеров)
3. Мещеряков Вадим (ВТБ)
4. Мухлынов Роман (Банк России)
5. Царенко Алина (Росбанк)

Общее число членов Совета составляет 27 человек, число принявших участие в заседании – 12 человек, а также 7 доверенностей, выданных на имя Председателя Совета Сергея Романчука.

Итого 19 голосов, что составило более 2/3 от общего числа членов Совета. Кворум для проведения заседания имеется.

Повестка дня:

1. Об информационном письме Банка России об участии физических лиц в деятельности участников торгов по выполнению функций и обязанностей маркет-мейкеров. Докладчик – Валерий Лях, Банк России.
2. О возможности приведения практик торговли на российском валютном рынке в соответствие с принципами Кодекса: подведение итогов опроса и детальное обсуждение затронутых принципов Кодекса.

3. О подписании Московской Биржей заявления о приверженности принципам Кодекса и готовности других участников валютного рынка к присоединению к Кодексу.
4. Разное.

Обсудили:

Вопрос 1. Об информационном письме Банка России об участии физических лиц в деятельности участников торгов по выполнению функций и обязанностей маркет-мейкеров.

Представители Банка России пояснили, что основной задачей информационного письма¹ является дополнительное разъяснение действующих норм Федерального закона 224-ФЗ² в части того, что на лицо, не являющееся участником торгов, не распространяется изъятие, предусмотренное нормами закона для маркет-мейкеров – участников торгов, и данное лицо не освобождается от ответственности за действия, являющиеся по сути манипулированием. Письмо рекомендует маркет-мейкерам - участникам торгов информировать об этом своих клиентов.

Представители Банка России также указали на то, что ситуация, при которой клиенты участника торгов выполняют действия, которые по форме могут выглядеть как манипулирование, однако по сути являются маркет-мейкингом, не приведет в конечном счете к возникновению к ним претензий, однако создаст повышенную нагрузку на Банк России из-за необходимости сбора информации и анализа каждого конкретного случая. При этом было подчеркнуто, что действующее законодательство не освобождает от ответственности ни участников торгов, ни их клиентов, если осуществляемые ими действия по сути являются манипулированием.

Участники также обсудили особенности заключения кросс-сделок на валютном рынке и отношение регулятора к таким сделкам. Дополнительно представителями Банка России были обозначены намерения по разработке методических рекомендаций в отношении практик маркет-мейкинга в рамках общего направления на развитие регулирования деятельности маркет-мейкеров.

Решили:

1. Принять к сведению информацию из доклада представителей Банка России.

Голосование: за – 19, против – 0, воздержался – 0.

Вопрос 2. О возможности приведения практик торговли на российском валютном рынке в соответствие с принципами Кодекса: подведение итогов опроса и детальное обсуждение затронутых принципов Кодекса.

Сергей Романчук представил окончательные результаты опроса, проводимого среди членов Совета и членов СРО НФА в рамках исследования возможности приведения практик торговли участников валютного рынка в соответствие с принципами Кодекса.

Участники обсудили вопросы соответствия подходов, применяемых Московской биржей к обработке заявлений участников торгов, принципам Кодекса, в частности, принципу

¹ Информационное письмо Банка России от 07 августа 2018 года № ИН-06-59/53 об участии физических лиц в деятельности участников торгов по выполнению функций и обязанностей маркет-мейкеров

² Федеральный закон от 27 июля 2010 года № 224-ФЗ «О противодействии неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком и о внесении изменений в отдельные законодательные акты Российской Федерации»

добропроводности и прозрачности обработки поручений (Принцип 9). В ходе обсуждения было подчеркнуто, что принципы Кодекса носят общий характер, и каждый участник валютного рынка самостоятельно определяет механизм и степень их имплементации в своей деятельности на валютном рынке.

С учетом состоявшихся на предыдущих заседаниях Совета подробных обсуждений отдельных принципов Кодекса и итогов проведенного среди членов Совета и членов СРО НФА опроса было внесено предложение об утверждении на Совете рекомендации российским участникам присоединиться к Кодексу.

Решили:

2. Рекомендовать российским участникам валютного рынка привести свои практики торговли в соответствие принципам Кодекса и подписать заявление о приверженности Кодексу.

Голосование: за – 19, против – 0, воздержался – 0.

Вопрос 3. О подписании Московской Биржей заявления о приверженности принципам Кодекса и готовности других участников валютного рынка к присоединению к Кодексу.

Представитель Московской биржи высказал соображения о целесообразности создания российского реестра участников валютного рынка, присоединившихся к Кодексу. Данный вопрос ранее обсуждался на заседании Совета и для того этапа был признан преждевременным³. С учетом появления российских участников, подписавших заявление о приверженности Кодексу, предполагается вынести вопрос создания российского реестра на одно из следующих заседаний Совета.

Вопрос 4. Разное.

С учетом анализа активности участников заседаний Совета было внесено предложение о включении Вадима Мещерякова, ВТБ в состав Совета в качестве постоянного члена.

Дополнительно Сергей Романчук анонсировал проведение 20 ноября 2018 года саммита ACI Russia 2018 по электронной торговле на валютном рынке и пригласил организации к участию и сотрудничеству по данному мероприятию.

Решили:

4. Рекомендовать Президенту СРО НФА включить Вадима Мещерякова, ВТБ в состав Совета.

Голосование: за – 19, против – 0, воздержался – 0.

Председатель Совета

Романчук С.А.

³ Пункт 4.1 протокола N 1 заседания Совета от 19 апреля 2018 года