



Правління Національного банку України

ПОСТАНОВА

03 листопада 2015 року

м. Київ

№ 762

Про затвердження Порядку купівлі/продажу  
цінних паперів України шляхом ініціювання аукціонів  
на торговельних майданчиках фондових бірж

Відповідно до статей 6, 7, 15, 25, 42 та 56 Закону України “Про Національний банк України” та Положення про застосування Національним банком України стандартних інструментів регулювання ліквідності банківської системи, затвердженого постановою Правління Національного банку України від 17 вересня 2015 року № 615 (далі – Положення), з метою регулювання грошово-кредитного ринку, а також задоволення вимог за операціями з рефінансування та прямого репо шляхом продажу цінних паперів, що використовуються як предмет застави, Правління Національного банку України **постановляє:**

1. Затвердити Порядок купівлі/продажу цінних паперів України шляхом ініціювання аукціонів на торговельних майданчиках фондових бірж, що додається.

2. Департаменту відкритих ринків (Пономаренко С. В.) довести зміст цієї постанови до відома банків України та фондових бірж, які відповідають вимогам пункту 85 глави 11 розділу V Положення, для використання в роботі.

3. Постанова набирає чинності з 01 грудня 2015 року.

4. Контроль за виконанням цієї постанови покласти на заступника Голови Національного банку України Чурія О. Є.

Голова

В. О. Гонтарева

ЗАТВЕРДЖЕНО  
Постанова Правління  
Національного банку України  
03 листопада 2015 року №762

Порядок  
купівлі/продажу цінних паперів України шляхом ініціювання аукціонів на  
торговельних майданчиках фондових бірж

1. Цей Порядок установлює процедуру та основні умови купівлі/продажу Національним банком України цінних паперів України (державних облігацій України та облігацій міжнародних фінансових організацій) шляхом ініціювання аукціонів на торговельних майданчиках фондових бірж.

2. У цьому Порядку терміни вживаються в такому значенні:

1) акцепт – створений ініціатором аукціонів електронний документ, який адресований учасникам аукціонів та містить безумовну згоду на укладання договорів (контрактів) із цими учасниками згідно із зазначеними в їх заявках умовами в межах обсягу, що може бути задоволений Національним банком України (допускається частковий акцепт);

2) аукціон – спосіб проведення біржових торгів;

3) відомість правочинів – документ, що надається фондовою біржею до ПУБЛІЧНОГО АКЦІОНЕРНОГО ТОВАРИСТВА “РОЗРАХУНКОВИЙ ЦЕНТР З ОБСЛУГОВУВАННЯ ДОГОВОРІВ НА ФІНАНСОВИХ РИНКАХ” (далі – Розрахунковий центр) та містить інформацію про укладені на фондовій біржі договори (контракти) та розпорядження на розблокування активів;

4) електронна торговельна система фондової біржі – сукупність організаційних, технологічних та технічних засобів, що використовуються фондовою біржею для забезпечення укладання договорів (контрактів);

5) учасники аукціонів – члени відповідної фондової біржі, а також у випадках, передбачених законодавством України, інші особи та державні органи, які згідно з правилами відповідної фондової біржі отримали право подавати заявки та укладати договори (контракти) на фондовій біржі.

3. Національний банк України ініціює аукціони з метою:

1) регулювання грошово-кредитного ринку;

2) задоволення вимог за операціями з рефінансування та прямого репо шляхом продажу цінних паперів, які використовуються як предмет застави (операції).

4. Умовою для ініціювання Національним банком України аукціонів є укладений договір про проведення аукціонів між Національним банком України та відповідною фондовою біржею.

5. Аукціони ініціюються на фондових біржах, які відповідають вимогам пункту 85 глави 11 розділу V Положення про застосування Національним банком України стандартних інструментів регулювання ліквідності банківської системи, затвердженого постановою Правління Національного банку України від 17 вересня 2015 року № 615, шляхом підписання уповноваженими особами Національного банку України та фондових бірж регламентів аукціонів із зазначенням основних умов їх проведення.

6. Національний банк України під час ініціювання аукціонів дотримується правил відповідних фондових бірж, затверджених радами цих фондових бірж та зареєстрованих Національною комісією з цінних паперів та фондового ринку.

7. Інформація про проведення аукціонів із зазначенням основних їх умов оголошується відповідними фондовими біржами не пізніше ніж за один робочий день до дати проведення аукціонів.

8. Регламенти проведення аукціонів мають обов'язково включати таку інформацію:

1) міжнародний ідентифікаційний код цінного папера;

2) дату або період проведення аукціонів;

3) період надходження заявок;

4) вимоги до подання учасниками аукціонів заявок;

5) порядок розрахунків за результатами аукціонів;

6) вимоги до сценарію проведення аукціонів;

7) період акцептування Національним банком України заявок учасників аукціонів.

Кількість цінних паперів, які Національний банк України планує купити (продати), та їх початкова ціна в регламентах проведення аукціонів може не зазначатися.

9. Участь в аукціонах відбувається шляхом подання учасниками аукціонів заявок. Заявки подаються, якщо інше не встановлено регламентами проведення аукціонів, у робочі дні з 10.00 до 15.00 за київським часом. Учасники аукціонів до завершення терміну надходження заявок можуть зняти подану заявку або змінити її умови. Після завершення терміну надходження заявок до завершення терміну їх акцепту їх зняття або зміна їх умов не допускається.

Під час аукціонів їх учасники можуть подавати лише заявки із зазначенням кількості цінних паперів, які вони готові безумовно придбати за зазначеною ними ціною (конкурентні заявки).

10. Усі подані учасниками аукціонів заявки мають бути забезпечені відповідними активами. Учасники аукціонів можуть подавати заявки на купівлю цінних паперів лише за умови попереднього блокування грошових коштів, а заявки на продаж цінних паперів за умови попереднього блокування цінних паперів.

11. Під час проведення аукціонів їх учасники мають доступ лише до інформації про власні подані заявки. Національний банк України має доступ до інформації про параметри заявок учасників аукціонів лише після завершення терміну їх надходження в анонімному режимі (без зазначення контрагентів).

12. Подані учасниками аукціонів заявки акумулюються фондовими біржами до завершення терміну їх надходження, після чого Національний банк України здійснює їх аналіз та приймає рішення стосовно обсягів їх задоволення з урахуванням цінових параметрів, зазначених у заявках учасників аукціонів.

13. Національний банк України в разі проведення аукціонів з продажу цінних паперів України подає:

1) розпорядження на поставку цінних паперів щодо їх блокування для продажу Депозитарію Національного банку України/Центральному

депозитарію цінних паперів після оголошення інформації про проведення аукціонів відповідно до пункту 7 цього Порядку;

2) за допомогою програмно-технологічного забезпечення клірингової системи Розрахункового центру інформацію, у якій зазначає обсяг цінних паперів України та визначені фондові біржі, на торговельних майданчиках яких планується укладання договорів (контрактів) з їх продажу після прийняття Національним банком України відповідного рішення.

14. Національний банк України в разі проведення аукціонів з купівлі цінних паперів України:

1) надає за допомогою програмно-технологічного забезпечення клірингової системи Розрахункового центру інформацію, у якій зазначає обсяг грошових коштів та визначені фондові біржі, на торговельних майданчиках яких планується укладання договорів (контрактів) з купівлі цінних паперів України після прийняття Національним банком України відповідного рішення;

2) здійснює перерахування грошових коштів на кореспондентський рахунок Національного банку України, відкритий у Розрахунковому центрі, з подальшим зарахуванням цих коштів на рахунки для здійснення розрахунків відповідно до Договору про клірингове обслуговування, укладеного з Розрахунковим центром.

15. Національний банк України акцептує заявки учасників аукціонів за допомогою засобів програмного забезпечення (електронних торговельних систем) фондових бірж, якщо інше не встановлено регламентами аукціонів, у робочі дні з 15.00 до 17.00 за київським часом шляхом установаження обсягу їх задоволення.

16. Задоволення заявок учасників аукціонів з продажу цінних паперів відбувається, починаючи з найвищої ціни, а з купівлі цінних паперів, починаючи з найнижчої ціни, до вичерпання обсягу їх задоволення.

Якщо заявки подавалися за однаковими цінами, а їх обсяг перевищує обсяг, що може бути задоволений Національним банком України, то такі заявки задовольняються згідно з правилами відповідної фондової біржі (пропорційно обсягу або за часом надходження).

Якщо передбачається частковий акцепт заявок учасників аукціонів щодо кількості цінних паперів, зазначених у них, то в момент здійснення такого акцепту автоматично фіксується укладення договору (контракту) щодо кількості цінних паперів, стосовно якої було здійснено частковий акцепт.

17. Фондова біржа в день укладення договорів (контрактів) надсилає відомість правочинів до Розрахункового центру.

18. Розрахунки за результатами аукціонів відбуваються за принципом “поставка цінних паперів проти оплати” у день укладення договору (контракту) відповідно до законодавства України.

Директор Департаменту  
відкритих ринків

С. В. Пономаренко

ПОГОДЖЕНО  
Заступник Голови  
Національного банку України  
\_\_\_\_\_ О. Є. Чурій  
(підпис)  
\_\_\_\_\_ 2015 року  
(дата)