

Обучение

**Ознакомление трейдеров с
законодательными, нормативными
правовыми и иными актами Российской
Федерации в области противодействия
неправомерному использованию
инсайдерской информации и
манипулированию рынком (ПНИИИМР)**

«ФИНАМ»
www.finam.ru





Оглавление

1 Основные термины и определения

3

2 Федеральный закон от 27.07.2010 № 224-ФЗ «О противодействии неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком и о внесении изменений в отдельные законодательные акты Российской Федерации»

5

3 Действия, относящиеся в манипулированию рынка

6

4 Условия совершения операций с финансовыми инструментами инсайдерами

7

5 Ответственность (уголовная, административная, дисциплинарная)

8

6 Список законодательных, нормативных правовых и иных актов, регулирующих деятельность в области ПНИИИМР

9

7 Пример недобросовестных практик

10



1. Основные термины и определения

Инсайдерская информация

– точная, конкретная, непубличная информация, распространение которой может оказать существенное влияние на цены финансовых инструментов, иностранной валюты и (или) товаров.

Операции с финансовыми инструментами, иностранной валютой и (или) товарами

– совершение сделок и иные действия, направленные на приобретение, отчуждение, иное изменение прав на финансовые инструменты, иностранную валюту и (или) товары, а также действия, связанные с принятием обязательств совершить указанные действия, в том числе выставление заявок (дача поручений) или отмена таких заявок.

Организатор торговли (Биржа)

– хозяйственное общество, осуществляющее деятельность по заключению сделок купли-продажи финансовых инструментов, иностранной валюты и (или) товаров между участниками рынка ценных бумаг.



1. Основные термины и определения

Манипулирование рынком

– умышленные действия, в результате которых цена, спрос, предложение или объем торгов финансовым инструментом, иностранной валютой и (или) товаром отклонились от уровня или поддерживались на уровне, существенно отличающемся от того уровня, который сформировался бы без таких действий.

Товары

– вещи, за исключением ценных бумаг, которые допущены к торговле на организованных торгах на территории Российской Федерации или в отношении которых подана заявка о допуске к торговле на указанных торгах.

Предоставление информации

– действия, направленные на получение информации определенным кругом лиц в соответствии с законодательством Российской Федерации О ценных бумагах.

Распространение информации

– действия, направленные на получение информации неопределенным кругом лиц или передачу информации неопределенному кругу лиц, а также опубликование информации в средствах массовой информации, в том числе в электронных, информационно-телекоммуникационных сетях, доступ к которым не ограничен определенным кругом лиц.

2. Федеральный закон от 27.07.2010 № 224-ФЗ «О противодействии неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком и о внесении изменений в отдельные законодательные акты Российской Федерации»

Целью настоящего Федерального закона является обеспечение справедливого ценообразования на финансовые инструменты, иностранную валюту и (или) товары, равенства инвесторов и укрепление доверия инвесторов путем создания правового механизма предотвращения, выявления и пресечения злоупотреблений на организованных торгах в форме неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком.

Настоящий Федеральный закон регулирует отношения, связанные с финансовыми инструментами, иностранной валютой и (или) товарами, которые допущены к торговле на организованных торгах на территории Российской Федерации и (или) в отношении которых подана заявка о допуске к торговле на указанных торгах, с финансовыми инструментами, цена которых зависит от финансовых инструментов, иностранной валюты и (или) товаров, допущенных к торговле на организованных торгах и (или) в отношении которых подана заявка о допуске к торговле на указанных торгах.





3. Действия, относящиеся к манипулированию рынком

Манипулированием рынка считаются действия, которые искусственно приводят к существенному отклонению цены, спроса, предложения или объема торгов финансового инструмента, иностранной валюты и (или) товара от того уровня, который бы сформировался без постороннего вмешательства.

К манипулированию рынком относятся следующие действия:

- ❑ Умышленное распространение заведомо ложные сведения через публичные информационные ресурсы.
- ❑ Совершение операции по предварительному сговору между участниками торгов и их работниками.
- ❑ Совершение сделки, обязательства по которым исполняются за счет или в интересах одного лица.
- ❑ Выставление заявки за счет или в интересах одного лица, если в результате появились две или более заявки противоположной направленности, в которых цена покупки финансового инструмента, иностранной валюты и (или) товара выше цены либо равна цене продажи такого же финансового инструмента
- ❑ Неоднократное совершение сделки на основании заявок с наибольшей ценой покупки либо с наименьшей ценой продажи в течение торгового дня.
- ❑ Совершение сделки с целью ввести в заблуждение относительно цены финансового инструмента.
- ❑ Неоднократное и преднамеренное уклонение от исполнения обязательств по операциям с одним и тем же финансовым инструментом.
- ❑ Действия, исчерпывающий перечень которых определяется нормативным актом Банка России в целях реализации функций, предусмотренных статьей 13 N 224-ФЗ .





7. Условия совершения операций с финансовыми инструментами инсайдерами

Инсайдеры, а также связанные лица вправе совершать операции с финансовыми инструментами при условии соблюдения ограничений на использование инсайдерской информации, а именно:

1. запрещается осуществлять операции с финансовыми инструментами, иностранной валютой и (или) товарами, в результате совершения которых может возникнуть основание полагать, что была неправомерно использована полученная ими инсайдерская информация;
2. запрещается использовать инсайдерскую информацию для извлечения имущественной выгоды;
3. запрещается передавать инсайдерскую информацию третьим лицам, за исключением случаев передачи этой информации лицу, включенному в список инсайдеров, в связи с исполнением обязанностей, установленных федеральными законами, либо в связи с исполнением трудовых обязанностей или исполнением договора;
4. запрещается передавать инсайдерскую информацию путем дачи рекомендаций третьим лицам, обязывания или побуждения их иным образом к приобретению или продаже финансовых инструментов, иностранной валюты и (или) товаров.





8. Ответственность

Уголовная

- ▶ Манипулирование рынком, которое причинило крупный ущерб гражданам, организациям или государству либо сопряжено с извлечением излишнего дохода или избежанием убытков в крупном размере (**ст. 185.3 УК РФ**)
- ▶ Умышленное использование инсайдерской информации для осуществления операций с финансовыми инструментами, иностранной валютой и (или) товарами за свой счет или за счет третьего лица, неправомерную передачу ее третьему лицу, а также дачу рекомендаций третьим лицам, обязывания или побуждения их иным образом к приобретению или продаже финансовых инструментов, иностранной валюты и (или) товаров, если такое использование причинило крупный ущерб гражданам, организациям или государству либо сопряжено с извлечением дохода или избежанием убытков в крупном размере (**ст. 185.6 УК РФ**)

Административная

- ▶ Неправомерное использование инсайдерской информации (**ст. 15.21 КоАП**)
- ▶ Манипулирование рынком (**ст. 15.30 КоАП**)
- ▶ Нарушение требований законодательства о противодействии неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком (**ст. 15.35 КоАП**)

Дисциплинарная

- ▶ Соблюдение требований доступа к инсайдерской информации и охраной конфиденциальности такой информации



9. Список законодательных, нормативных правовых и иных актов, регулирующих деятельность в области ПНИИИМР

- ✓ Федеральный закон от 27.07.2010 № 224-ФЗ «О противодействии неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком и о внесении изменений в отдельные законодательные акты Российской Федерации»;
- ✓ Федеральный закон от 22.04.1996 г. № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг»;
- ✓ Федеральный закон от 29.11.2001 г. № 156-ФЗ «Об инвестиционных фондах»;
- ✓ Указание Банка России от 01.08.2019 № 5222-У «О требованиях к правилам внутреннего контроля по предотвращению, выявлению и пресечению неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком юридических лиц, указанных в пунктах 1, 3 - 8, 11 и 12 статьи 4 Федерального закона 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»;
- ✓ Указание Банка России от 27.09.2021 № 5946-У «О перечне инсайдерской информации юридических лиц, указанных в пунктах 1, 3, 4, 11 и 12 статьи 4 Федерального закона от 27 июля 2010 года N 224-ФЗ "О противодействии неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком и о внесении изменений в отдельные законодательные акты Российской Федерации", а также о порядке и сроках ее раскрытия»;
- ✓ Постановление Правительства РФ от 05.04.2022 № 586 «О некоторых особенностях раскрытия и (или) предоставления информации в соответствии с отдельными законодательными актами Российской Федерации»;
- ✓ Постановление Правительства РФ от 09.04.2019 № 416 «Об особенностях раскрытия инсайдерской информации, подлежащей раскрытию в соответствии с требованиями Федерального закона "О противодействии неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком и о внесении изменений в отдельные законодательные акты Российской Федерации».



Примеры недобросовестных практик



- Циклические серии сделок / систематически убыточная имитация торговой активности
- Использование стратегии Layering / Spoofing
- Использование стратегии Pump&Dump
- Подача чрезмерно агрессивного поручения
- Кросс-сделки



Циклические серии сделок / систематически убыточная имитация торговой активности

Циклические серии сделок - многократная перепродажа одного и того же инструмента, для создания видимости активности на нем.

Систематически убыточная имитация торговой активности – регулярный отрицательный финансовый результат по счету у одного из контрагентов сделки, а у другого контрагента регулярный положительный финансовый результат.

Дата	Тип операции	Номер	Наименование	ISIN	Кол-во	Валюта ц...	Цена	Сумма
28.02.2023 13:06:25	Покупка ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351391124	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		283.40	2 834.00
28.02.2023 13:06:42	Продажа ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351392874	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		282.00	2 820.00
28.02.2023 13:06:43	Покупка ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351392985	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		283.40	2 834.00
28.02.2023 13:06:45	Продажа ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351393125	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		282.00	2 820.00
28.02.2023 13:06:45	Покупка ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351393223	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		283.40	2 834.00
28.02.2023 13:06:47	Продажа ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351393306	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		282.00	2 820.00
28.02.2023 13:06:48	Покупка ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351393408	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		283.40	2 834.00
28.02.2023 13:06:49	Продажа ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351393504	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		282.00	2 820.00
28.02.2023 13:06:50	Покупка ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351393588	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		283.40	2 834.00
28.02.2023 13:06:50	Продажа ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351393631	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		282.00	2 820.00
28.02.2023 13:06:52	Покупка ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351393765	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		283.40	2 834.00
28.02.2023 13:06:53	Покупка ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351393808	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		283.60	2 836.00
28.02.2023 13:06:53	Продажа ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351393861	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		282.00	2 820.00
28.02.2023 13:06:53	Продажа ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351393896	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		281.80	2 818.00
28.02.2023 13:06:56	Покупка ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351394099	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		283.60	2 836.00
28.02.2023 13:06:56	Продажа ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351394121	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		281.20	2 812.00
28.02.2023 13:06:58	Покупка ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351394292	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		283.60	2 836.00
28.02.2023 13:06:59	Продажа ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351394336	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		281.40	2 814.00
28.02.2023 13:07:01	Покупка ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351394499	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		283.60	2 836.00
28.02.2023 13:07:03	Продажа ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351394711	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		281.80	2 818.00
28.02.2023 13:07:07	Покупка ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351394959	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		283.60	2 836.00
28.02.2023 13:07:12	Продажа ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351395342	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		282.00	2 820.00
28.02.2023 13:07:13	Покупка ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351395460	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		283.60	2 836.00
28.02.2023 13:07:14	Продажа ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	7351395594	НПО Наука, АО, 001	RU000AQJRPX9	10 Рубль		282.20	2 822.00



Использование стратегии Spoofing / Layering

Spoofing / Layering – выставление одной крупной заявки или серии мелких заявок на покупку/продажу на короткое время с целью стимуляции роста/падения цены без намерения исполнить выставленную заявку и последующего исполнения собственной заявки другой направленности.

Суть стратегии Spoofing/Layering заключается во введении в заблуждение участников торгов или их клиентов в части спроса и предложения финансового инструмента.

Поручение							Инструмент		Объем			Дополнительно	
Дата	Время	Биржа	Бирж. №	Тип	Вид	Статус	Наименование	Колво	Цена	Сумма	Валюта	Торговая сист...	
28.03.2023	09:53:00	MMBB	35171496108	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 496.50	12 482.50	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	09:54:25	MMBB	35171511823	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 497.00	12 485.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:00:41	MMBB	35171768665	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.50	12 457.50	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:01:47	MMBB	35171959578	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 497.50	12 487.50	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:02:52	MMBB	35172083950	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.00	12 455.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:03:58	MMBB	35172200234	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Исполнено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 498.50	12 492.50	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:04:36	MMBB	35172250643	Продажа ЦБ	Биржа с о/р	Исполнено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	1	2 493.50	2 493.50	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:05:02	MMBB	35172286138	Продажа ЦБ	Биржа с о/р	Исполнено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	4	2 500.00	10 000.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:05:03	MMBB	35172288485	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	1	2 491.00	2 491.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:06:09	MMBB	35172385133	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 497.50	12 487.50	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:10:24	MMBB	35172712617	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.00	12 455.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:11:46	MMBB	35172842649	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.00	12 455.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:13:24	MMBB	35172982879	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 489.50	12 447.50	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:14:58	MMBB	35173085737	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 489.00	12 445.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:16:04	MMBB	35173180176	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.50	12 457.50	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:17:10	MMBB	35173253296	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.00	12 455.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:18:19	MMBB	3517330390	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.00	12 455.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:19:36	MMBB	35173415408	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 489.50	12 447.50	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:20:43	MMBB	35173482622	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.00	12 455.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:21:48	MMBB	35173556176	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.50	12 457.50	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:22:57	MMBB	35173623735	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.00	12 455.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:25:44	MMBB	35173789886	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.00	12 455.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:26:49	MMBB	35173862067	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 489.50	12 447.50	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:27:56	MMBB	35173939736	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 488.50	12 442.50	Рубль	Tansaaq	

Всего поручений: 325

Поручение							Инструмент		Объем			Дополнительно	
Дата	Время	Биржа	Бирж. №	Тип	Вид	Статус	Наименование	Колво	Цена	Сумма	Валюта	Торговая сист...	
28.03.2023	09:53:00	MMBB	35171496108	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 496.50	12 482.50	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	09:54:25	MMBB	35171511823	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 497.00	12 485.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:00:41	MMBB	35171768665	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.50	12 457.50	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:01:47	MMBB	35171959578	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 497.50	12 487.50	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:02:52	MMBB	35172083950	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.00	12 455.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:05:03	MMBB	35172288485	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	1	2 491.00	2 491.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:06:09	MMBB	35172385133	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 497.50	12 487.50	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:10:24	MMBB	35172712617	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.00	12 455.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:11:46	MMBB	35172842649	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.00	12 455.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:13:24	MMBB	35172982879	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 489.50	12 447.50	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:14:58	MMBB	35173085737	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 489.00	12 445.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:16:04	MMBB	35173180176	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.50	12 457.50	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:17:10	MMBB	35173253296	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.00	12 455.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:18:19	MMBB	3517330390	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.00	12 455.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:19:36	MMBB	35173415408	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 489.50	12 447.50	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:20:43	MMBB	35173482622	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.00	12 455.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:21:48	MMBB	35173556176	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.50	12 457.50	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:22:57	MMBB	35173623735	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.00	12 455.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:25:44	MMBB	35173789886	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 491.00	12 455.00	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:26:49	MMBB	35173862067	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 489.50	12 447.50	Рубль	Tansaaq	
28.03.2023	10:27:56	MMBB	35173939736	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	TCS Group Holding PLC ГДР, ДР...	5	2 488.50	12 442.50	Рубль	Tansaaq	

(Поручение * Статус = Отменено)

Всего поручений: 315



Использование стратегии Pump&Dump

Разгон цены актива до максимальных уровней, на фоне резкого увеличения объемов торгов (накачка), с последующим мгновенным обвалом тренда (сброс).

Дата	Вре...	Тип	Наименован...	Кол-во	Цена	Сумма
16.03.2023	12:25:01	Покупка валюты	USDRUB_TOD	100 000	76.245	7 624 500.00.2
16.03.2023	12:25:01	Покупка валюты	USDRUB_TOD	100 000	76.23	7 623 000.00.2
16.03.2023	12:25:04	Покупка валюты	USDRUB_TOD	100 000	76.265	7 626 500.00.2
16.03.2023	12:25:05	Продажа валюты	USDRUB_TOD	50 000	76.32	3 816 000.00.2
16.03.2023	12:25:09	Покупка валюты	USDRUB_TOD	50 000	76.33	3 816 500.00.2
16.03.2023	12:25:09	Покупка валюты	USDRUB_TOD	50 000	76.34	3 817 000.00.2
16.03.2023	12:25:10	Покупка валюты	USDRUB_TOD	50 000	76.35	3 817 500.00.2
16.03.2023	12:25:12	Покупка валюты	USDRUB_TOD	50 000	76.3625	3 818 125.00.2
16.03.2023	12:25:13	Покупка валюты	USDRUB_TOD	50 000	76.39	3 819 500.00.2
16.03.2023	12:25:13	Покупка валюты	USDRUB_TOD	50 000	76.375	3 818 750.00.2
16.03.2023	12:25:14	Покупка валюты	USDRUB_TOD	100 000	76.3625	7 636 250.00.2
16.03.2023	12:25:15	Продажа валюты	USDRUB_TOD	100 000	76.4125	7 641 250.00.2
16.03.2023	12:25:18	Покупка валюты	USDRUB_TOD	50 000	76.46	3 823 000.00.2
16.03.2023	12:25:18	Покупка валюты	USDRUB_TOD	100 000	76.465	7 646 500.00.2
16.03.2023	12:25:20	Покупка валюты	USDRUB_TOD	100 000	76.4475	7 644 750.00.2
16.03.2023	12:25:24	Покупка валюты	USDRUB_TOD	50 000	76.5025	3 825 125.00.2
16.03.2023	12:25:24	Покупка валюты	USDRUB_TOD	50 000	76.54	3 827 000.00.2
16.03.2023	12:25:24	Покупка валюты	USDRUB_TOD	50 000	76.54	3 827 000.00.2
16.03.2023	12:25:26	Продажа валюты	USDRUB_TOD	50 000	76.7275	3 836 375.00.2
16.03.2023	12:25:26	Покупка валюты	USDRUB_TOD	50 000	76.66	3 833 000.00.2
16.03.2023	12:25:27	Продажа валюты	USDRUB_TOD	50 000	76.7525	3 837 625.00.2
16.03.2023	12:25:29	Покупка валюты	USDRUB_TOD	50 000	76.80	3 840 000.00.2
16.03.2023	12:25:29	Покупка валюты	USDRUB_TOD	100 000	76.825	7 682 500.00.2
16.03.2023	12:25:31	Покупка валюты	USDRUB_TOD	50 000	76.80	3 840 000.00.2
16.03.2023	12:25:33	Покупка валюты	USDRUB_TOD	100 000	76.785	7 678 500.00.2
16.03.2023	12:25:35	Покупка валюты	USDRUB_TOD	50 000	76.8525	3 842 625.00.2
16.03.2023	12:25:36	Покупка валюты	USDRUB_TOD	50 000	76.895	3 844 750.00.2
16.03.2023	12:25:36	Покупка валюты	USDRUB_TOD	50 000	76.92	3 846 000.00.2
16.03.2023	12:25:38	Покупка валюты	USDRUB_TOD	100 000	77.05	7 705 000.00.2
16.03.2023	12:25:38	Покупка валюты	USDRUB_TOD	50 000	77.0075	3 850 375.00.2
16.03.2023	12:25:39	Покупка валюты	USDRUB_TOD	100 000	77.0075	7 700 750.00.2
16.03.2023	12:25:39	Покупка валюты	USDRUB_TOD	100 000	77.0025	7 700 250.00.2





Подача чрезмерно агрессивного поручения

Выставление одной крупной заявки на покупку/продажу по завышенной/заниженной цене без информационного повода, создающей значительный объем по сравнению с остальными участниками торгов.

Поручение							Инструмент				Объем		
Дата	Время	Биржа	Бирж. №	Тип	Вид	Статус	Наименование	Кол-во	Цена	Сумма	Валюта		
02.02.2023	10:50:27	MMB	34416496419	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Исполнено	ГАЗПРОМ, АО, 002	10	157.72	1 577.20	Рубль		
02.02.2023	10:51:04	MMB	34416524763	Продажа ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	ГАЗПРОМ, АО, 002	10 000	158.16	1 581 600.00	Рубль		
02.02.2023	11:08:05	MMB	34417226850	Продажа ЦБ	Биржа с о/р	Исполнено	ГАЗПРОМ, АО, 002	10	157.72	1 577.20	Рубль		
02.02.2023	11:08:06	MMB	34417227681	Продажа ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	ГАЗПРОМ, АО, 002	10 000	157.81	1 578 100.00	Рубль		
02.02.2023	11:08:09	MMB	34417228835	Продажа ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	ГАЗПРОМ, АО, 002	10 000	157.80	1 578 000.00	Рубль		
02.02.2023	11:10:47	MMB	34417301839	Продажа ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	ГАЗПРОМ, АО, 002	10 000	157.89	1 578 900.00	Рубль		
02.02.2023	11:10:54	MMB	34417305288	Продажа ЦБ	Биржа с о/р	Исполнено	ГАЗПРОМ, АО, 002	10	157.89	1 578.90	Рубль		
02.02.2023	11:10:56	MMB	34417306130	Продажа ЦБ	Биржа с о/р	Исполнено	ГАЗПРОМ, АО, 002	10	157.88	1 578.80	Рубль		
02.02.2023	11:11:04	MMB	34417309378	Продажа ЦБ	Биржа с о/р	Исполнено	ГАЗПРОМ, АО, 002	10	157.87	1 578.70	Рубль		
02.02.2023	11:11:06	MMB	34417310154	Продажа ЦБ	Биржа с о/р	Исполнено	ГАЗПРОМ, АО, 002	10	157.80	1 578.00	Рубль		
02.02.2023	11:12:04	MMB	34417341387	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Исполнено	ГАЗПРОМ, АО, 002	50 920	174.63	8 892 159.60	Рубль		
02.02.2023	11:54:01	MMB	34418624246	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Исполнено	ГАЗПРОМ, АО, 002	100	157.92	15 792.00	Рубль		
02.02.2023	11:56:23	MMB	34418685306	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	ГАЗПРОМ, АО, 002	100	157.91	15 791.00	Рубль		
02.02.2023	11:57:07	MMB	34418705783	Продажа ЦБ	Биржа с о/р	Исполнено	ГАЗПРОМ, АО, 002	50	157.95	7 897.50	Рубль		
02.02.2023	11:57:17	MMB	34418711866	Продажа ЦБ	Биржа с о/р	Исполнено	ГАЗПРОМ, АО, 002	50	157.95	7 897.50	Рубль		
02.02.2023	12:00:05	MMB	34418780074	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	ГАЗПРОМ, АО, 002	100	155.56	15 556.00	Рубль		
02.02.2023	12:00:07	MMB	34418780551	Покупка ЦБ	Биржа с о/р	Отменено	ГАЗПРОМ, АО, 002	100	155.55	15 555.00	Рубль		

Дата и время	Операция	Статус	Цена	Кол-во	Сумма
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.94	50	7 897.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.94	50	7 897.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.94	5 000	789 700.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.94	500	78 970.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.94	50	7 897.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.94	500	78 970.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.94	400	63 176.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.95	300	47 385.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.95	4 010	633 379.50
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.95	5 000	789 750.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.95	900	142 195.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.95	2 000	315 900.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.95	160	25 272.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.95	20	3 159.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.96	3 000	473 880.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.97	20	3 159.40
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.97	50	7 898.50
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.97	190	30 014.30
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.97	500	78 985.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.98	100	15 798.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.98	2 000	315 960.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.98	10	1 579.80
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.98	5 000	789 900.00

Дата и время	Операция	Статус	Цена	Кол-во	Сумма
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.99	10	1 579.90
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.99	10	1 579.90
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.99	10	1 579.90
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.99	10	1 579.90
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.99	10	1 579.90
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.99	50	7 899.50
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.99	50	7 899.50
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.99	10	1 579.90
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.99	500	78 995.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.99	10	1 579.90
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.99	500	78 995.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.99	100	15 799.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.99	5 000	789 950.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.99	1 420	224 345.80
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.99	1 500	236 985.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	157.99	500	78 995.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	158.00	20	3 160.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	158.00	10	1 580.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	158.00	10	1 580.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	158.00	30	4 740.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	158.00	500	79 000.00
02.02.2023 11:12:04	Покупка ЦБ	Исполнена	158.00	7 230	1 142 340.00



Кросс-сделки

Кросс-сделка – операция, в которой один и тот же участник торгов выступает одновременно покупателем и продавцом финансового инструмента, иностранной валюты и (или) товара.

Клиент может совершать кросс-сделки двумя способами:

1. По своему брокерскому счету

Дата	Тип операции	Номер	Раздел	Наименование	ISIN	Кол-во	Валюта цены	Цена	Сумма
21.10.21 10:00:21	Покупка ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	4540001708	ММВБ (Прочие)	Группа Ренессанс Страхование, АО, 001	RU000A0ZZM04	10	Рубль	136,4	1364
21.10.21 10:00:21	Продажа ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	4540001708	ММВБ (Прочие)	Группа Ренессанс Страхование, АО, 001	RU000A0ZZM04	10	Рубль	136,4	1364
21.10.21 10:00:31	Покупка ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	4540004867	ММВБ (Прочие)	Группа Ренессанс Страхование, АО, 001	RU000A0ZZM04	10	Рубль	135,78	1357,8
21.10.21 10:00:31	Продажа ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	4540004867	ММВБ (Прочие)	Группа Ренессанс Страхование, АО, 001	RU000A0ZZM04	10	Рубль	135,78	1357,8
21.10.21 10:00:35	Покупка ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	4540005614	ММВБ (Прочие)	Группа Ренессанс Страхование, АО, 001	RU000A0ZZM04	100	Рубль	133,8	13380
21.10.21 10:00:35	Продажа ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	4540005614	ММВБ (Прочие)	Группа Ренессанс Страхование, АО, 001	RU000A0ZZM04	100	Рубль	133,8	13380
21.10.21 10:00:37	Покупка ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	4540005852	ММВБ (Прочие)	Группа Ренессанс Страхование, АО, 001	RU000A0ZZM04	20	Рубль	133,2	2664
21.10.21 10:00:37	Продажа ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	4540005852	ММВБ (Прочие)	Группа Ренессанс Страхование, АО, 001	RU000A0ZZM04	20	Рубль	133,2	2664
21.10.21 10:00:57	Покупка ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	4540009443	ММВБ (Прочие)	Группа Ренессанс Страхование, АО, 001	RU000A0ZZM04	10	Рубль	129,4	1294
21.10.21 10:00:57	Продажа ЦБ::Биржа с о/р::Стандартная	4540009443	ММВБ (Прочие)	Группа Ренессанс Страхование, АО, 001	RU000A0ZZM04	10	Рубль	129,4	1294

2. С себя по счету брокера и агрегированного счета у субброкера/проп-трейдера

Дата	Тип операции	Номер	Счет клиента	Наименование	ISIN	Кол-во	Цена	Сумма
28.02.23 9:35:41	Продажа ПИ::Биржа::Маржируем	1965287261243179019	Клиент 1	FEES, Фьючерсы ФОРТС, FEES-6.23	FEES-6.23	1	8951	8951
28.02.23 9:35:41	Покупка ПИ::Биржа::Маржируем	1965287261243179019	Клиент 2	FEES, Фьючерсы ФОРТС, FEES-6.23	FEES-6.23	1	8951	8951
28.02.23 9:38:52	Покупка ПИ::Биржа::Маржируем	1965287261243179020	Клиент 1	FEES, Фьючерсы ФОРТС, FEES-6.23	FEES-6.23	1	9016	9016
28.02.23 9:38:52	Продажа ПИ::Биржа::Маржируем	1965287261243179020	Клиент 2	FEES, Фьючерсы ФОРТС, FEES-6.23	FEES-6.23	1	9016	9016