



Laidiens: 22.09.2004., Nr. 150

Rīgas Fondu biržas noteikumi

Biedru un tirdzniecības noteikumi

Apstiprināti Rīgas Fondu biržas padomes sēdē 2004.gada 31.augustā

Stājas spēkā 2004.gada 27.septembrī

1. Noteikumu mērķis

Rīgas Fondu biržas Biedru un tirdzniecības noteikumu (turpmāk — Noteikumi) mērķis ir noteikt finanšu instrumentu tirdzniecības kārtību AS “Rīgas Fondu birža” (turpmāk — Birža) regulētajos tirgos, Biržas biedra statusa iegūšanas, pārtraukšanas un anulēšanas kārtību un citus ar Biržas darbību saistītos jautājumus tādējādi, lai tiktu veicināta Biržas, tās regulēto tirgu un Biedru darbības atbilstība NOREX biržu aliansē noteiktajiem standartiem un darbības principiem. Noteikumi ir izstrādāti saskaņā ar Finanšu instrumentu tirgus likuma 28. pantu.

2. Terminu skaidrojumi (definīcijas un saīsinājumi)

Automātiski savietots darījums (Automatically Matched Trade) — darījums, kas tiek izpildīts Uzdevumu grāmatā, veicot automātisku uzdevumu savietošanu.

Automātiska uzdevumu savietošana (Automatic Order Matching) — pirkšanas un pārdošanas uzdevumu automātiska savietošana, kad Uzdevumu grāmatā ievadītajā uzdevumā finanšu instrumentu cena, apjoms un citi darījuma nosacījumi atbilst iepriekš Uzdevumu grāmatā ievadītā uzdevumā norādītajiem darījuma nosacījumiem.

Automatizētā tirdzniecība (Automated Trading) — uzdevumu ievadišana, tajā izdarīto izmaiņu un uzdevumu atcelšanas reģistrācija Tirdzniecības sistēmā, izmantojot programmnodrošinājumu, kas automātiski apvieno lielu skaitu uzdevumu, kuri atbilst ieprogrammētām īpašām (specifiskām) pazīmēm.

Automātiska uzdevumu maršrutēšana (Automatic Order Routing) — Biedra klienta izveidoto uzdevumu elektroniska un automātiska reģistrēšana Tirdzniecības sistēmā, izmantojot interneta vai citus tīkla savienojumus, kas ir izveidoti starp Biedru un tā klientu.

Biedrs (Member) — juridiska persona, kam ir piešķirts Biržas biedra statuss un kura ar Biržu ir noslēgusi Dalības līgumu.

Biržas brokeris (Exchange trader) — Biedra darbinieks, kas ir pilnvarots piedalīties Biržas organizētajā tirdzniecības sistēmā Biedra vārdā.

Biržas diena (Exchange day) — diena, kurā var veikt darījumus (kurā Biržā notiek tirdzniecība) Biržas regulētajos tirgos.

Biržas paziņojums (Exchange notice) — Tirdzniecības sistēmā ievadīts paziņojums, ar kuru tiek nodota informācija Biedriem vai Tirgum kopumā.

Biržas noteikumi — Rīgas fondu biržas izstrādāti un apstiprināti noteikumi, kas regulē Biržas biedru uzņemšanu, Biedru darbību Biržā, darījumu slēgšanu Biržas regulētajos tirgos un norēķinu veikšanu par Biržā noslēgtajiem vai reģistrētajiem darījumiem, kā arī citus jautājumus, kurus saskaņā ar Finanšu instrumentu tirgus likumu Biržai ir jāregulē, lai nodrošinātu atklātu un regulāru finanšu instrumentu darījumu slēgšanu.

Bloka darījums — Tiešais darījums, kas tiek slēgts par finanšu instrumentu skaitu, kas ir vienāds vai lielāks kā Biržas noteiktais Standarta Lotu skaits.

Cenas intervāls (Spread) — intervāls starp augstāko pirkšanas un zemāko pārdošanas cenu, kas attiecīgajam instrumentam ir norādīta uzdevumā.

Dalībvalsts — Eiropas Savienības dalībvalsts vai Eiropas Ekonomikas zonas valsts.

Darījums (Trade) — vienošanās par finanšu instrumentu pirkšanu vai pārdošanu, kas ir izpildīta kā automātiski savietots darījums vai reģistrēta kā tiešais darījums.

Darījuma laiks (Time of the Trade) — laiks, kurā automātiski savietojams darījums ir savietots (*matched*) vai Tiešais darījums ir reģistrēts (noslēgts).

Fiksētā ienākuma instrumentu tirgus (Fixed-income market) — tirgus segmenti, kuros notiek tirdzniecība ar fiksētā ienākuma instrumentiem.

Iekšējais darījums (Internal trade) — tiešais darījums, kas tiek noslēgts starp Biedru un tā klientu vai starp diviem Biedra klientiem.

Finanšu instrumenti (turpmāk arī — Instrumenti)(*Instrument*) — pārvedami vērtspapīri un citi finanšu instrumenti, kas ir iekļauti un tiek tirgoti Biržas regulētajos tirgos.

Kapitāla vērtspapīru tirgus (Equity market) — tirgus segmenti, kuros notiek tirdzniecība ar akcijām, emisijas instrumentiem, variantiem, ieguldījumu fondu apliecībām (daļām) un citiem tiem pielīdzināmiem finanšu instrumentiem.

Kotēšanas solis (Tick Size) — mazākās iespējamās cenas izmaiņas diviem atsevišķiem Uzdevumu grāmatā ievadītiem uzdevumiem.

Komisija — Finanšu un kapitāla tirgus komisija.

Likums — Finanšu instrumentu tirgus likums un citi tiesību akti, kuri regulē finanšu instrumentu publisko apgrozību, regulētā tirgus organizētāja un to izveidoto tirgu darbību un citus ar to saistītus jautājumus.

Labākā cena — zemākā cena, kas ir norādīta finanšu instrumentu pārdošanas uzdevumā vai augstākā cena, kas ir norādīta finanšu instrumentu pirkšanas uzdevumā.

Labākais pieprasījums (Best Bid) — labāko pieprasījumu konkrētajam finanšu instrumentam nosaka, ņemot vērā attiecīgajā Uzdevumu grāmatā reģistrētos pirkšanas uzdevumus, kuros norādītais finanšu instrumentu apjoms ir viena Lote vai lielāks.

Labākais piedāvājums (Best Ask) — labāko piedāvājumu konkrētajam finanšu instrumentam nosaka, ņemot vērā attiecīgajā Uzdevumu grāmatā reģistrētos pārdošanas uzdevumus, kuros norādītais finanšu instrumentu apjoms ir viena Lote vai lielāks.

Lote (Round Lot) — instrumentu minimālais skaits, par kādu noslēgtajos darījumos (Automātiski savietotajos uzdevumos vai Tiešajos darījumos) norādīto cenu ņem vērā, nosakot Pēdējo fiksēto cenu.

Nepilna Lote (Odd Lot) — instrumentu skaits, kas ir mazāks kā Lote.

Pirmstirdzniecības sesija (Pre-trading session) — laika periods Tirdzniecības dienā pirms Tirdzniecības sesijas, kurā Uzdevumu grāmatā drīkst ievadīt uzdevumus un drīkst reģistrēt tiešos darījumus, kā arī veikt citas Pirmstirdzniecības sesijas laikā atļautās darbības.

Pēctirdzniecības sesija (Post-trading session) — laika periods Tirdzniecības dienā pēc Tirdzniecības sesijas, kurā drīkst izdarīt izmaiņas uzdevumos vai darījumos vai atcelt tos un kurā drīkst reģistrēt tiešos darījumus, kā arī veikt citas Pēctirdzniecības sesijā atļautās darbības.

Pēdējā fiksētā cena (Latest Paid Price) — pēdējā tirdzniecības sistēmā noslēgtā darījuma cena par vienu Loti vai reģistrētā (*reported*) Tiešā darījuma cena, ja darījuma veids ir standarta.

Publiska tirgus informācija — tā informācija par Tirgu, ko iegūst un apkopo, ņemot vērā Tirdzniecības sistēmā esošos datus (Biržas publicētā informācija par tirdzniecību un citiem ar Tirgus darbību saistītiem apstākļiem), kura tiek izplatīta un ir pieejama par brīvu visiem interesentiem.

Standarta Lote — minimālais Lotu skaits, ko nosaka tiem pirkšanas un pārdošanas uzdevumiem, kurus Tirgus uzturētājam ir jāievada uzdevumu grāmatā.

SAXESS — elektroniska tirdzniecības sistēma, kura nodrošina darījumu slēgšanu ar finanšu instrumentiem Kapitāla vērtspapīru un Fiksētā ienākuma instrumentu tirgū.

Tehnoloģiskais aprīkojums (Technology equipment) — Biedra informācijas sistēmas sastāvdaļa, kurā ietilpst sistēmprogrammas, lietojumprogrammas, palīgprogrammas, sistēmfaili, datori, datortikli, aparatūra un citas iekārtas, kas tiek izmantotas, lai Biedrs varētu piekļūt tirdzniecības sistēmai un veikt tajā darījumus un norēķinus.

Tiešais darījums (Manual trade) — vienošanās par Biržas regulētā tirgū iekļautu finanšu instrumentu pirkšanu vai pārdošanu, par kuru darījuma puses vienojas ārpus Uzdevumu grāmatas un kas ir jāreģistrē Biržā atbilstoši šo Noteikumu prasībām.

Tirgus (Market) — Biržas regulētais finanšu instrumentu tirgus, kas darbojas atbilstoši noteiktām finanšu instrumentu iekļaušanas, tirdzniecības, kotēšanas un norēķinu veikšanas prasībām.

Tirgus uzturētājs (Market maker) — Biedrs, kas, noslēdzot līgumu, ir apņēmis nodrošināt konkrēta finanšu instrumenta aktīvāku tirdzniecību (likviditāti), Tirdzniecības dienas laikā ievadot Uzdevumu grāmatā pirkšanas un pārdošanas uzdevumu vismaz par tādu apjomu, kas atbilst attiecīgajam finanšu instrumentam noteiktajai Standarta Lotei.

Tirgus segments (Sub-Market) — Tirgus daļa, kas darbojas atbilstoši vienādiem tirdzniecības noteikumiem.

Tirdzniecības uzsākšanas izsole (Opening Call Auction) — laika periods Tirdzniecības dienas laikā, kurā Pirmstirdzniecības sesijas laikā ievadītie uzdevumi vai Uzdevumu grāmatā esošie uzdevumi tiek izpildīti (*matched*) par aprēķināto līdzsvara cenu, t.i. cenu, kas veidojas, kad kopējo pieprasījumu var apmierināt ar kopējo piedāvājumu.

Tirdzniecības sesija (Trading Session) — laika periods Tirdzniecības dienā, kur veic automātisku uzdevumu savietošanu un reģistrē Tiešos darījumus, kā arī veic citas Tirdzniecības sesijā atļautās darbības.

Tirdzniecības diena (Trading Hours) — laika periods Biržas dienā, kurā notiek Pirmstirdzniecības sesija, Tirdzniecības sesija un Pēctirdzniecības sesija.

Tirdzniecības sistēma (Trading System) — elektroniska sistēma (tehniskais nodrošinājums, programmnodrošinājums un ar to saistītās komunikāciju sistēmas), ko administrē Birža un kas nodrošina tirdzniecību ar instrumentiem Biržas regulētajos tirgos. Birža nodrošina tirdzniecību ar *SAXESS* tirdzniecības sistēmas starpniecību.

Vidējā darījumu cena (Average Traded Price) — vidējā svērtā cena visiem vienā Uzdevumu grāmatā reģistrētajiem darījumiem.

Uzdevums (Order) — saistošs piedāvājums pirkt (Pirkšanas uzdevums) vai pārdot (Pārdošanas uzdevums) finanšu instrumentus atbilstoši nosacījumiem, kurus Biedrs ir norādījis Uzdevumu grāmatā ievadītajā uzdevumā.

Uzdevumu grāmata (Order book) — Tirdzniecības sistēmā ievadīto pirkšanas un pārdošanas uzdevumu uzskaites sistēma, kas tiek izveidota konkrētam instrumentam un kurā par attiecīgo instrumentu tiek iekļauta (ja tas ir nepieciešams un iespējams) informācija par norēķinu veikšanu, cenas noteikšanu (decimāldaļu skaits), Lotes apjomu, darījuma minimālo apjomu u.c.

3. Vispārīgie jautājumi

3.1. Noteikumu piemērošana un grozīšanas kārtība

3.1.1. Šie Noteikumi regulē Biedru darbību Biržas organizētajos regulētajos tirgos un citus ar to saistītos jautājumus. Noteikumi un to grozījumi ir pieejami Biržas mājaslapā internetā.

3.1.2. Noteikumi ir saistoši Biedram no datuma, kad tam ir piešķirts Biedra statuss un Biedrs ir parakstījis Dalības līgumu. Grozījumi šajos Noteikumos ir saistoši Biržai un Biedriem bez iepriekšēja apstiprinājuma saņemšanas no Biedriem, ja ir ievēroti šo Noteikumu 3.1.3. punkta nosacījumi.

3.1.3. Birža veic grozījumus šajos Noteikumos, ievērojot šādu kārtību:

1) pirms grozījumu veikšanas Noteikumos Birža informē Vērtspapīru tirgus profesionālo dalībnieku asociāciju un Latvijas Komercbanku asociāciju, kā arī citas profesionālās asociācijas (ja ir nepieciešams) par plānotajiem grozījumiem. Šīs personas ne vēlāk kā 10 Biržas dienas pēc paziņojuma saņemšanas drīkst pieprasīt, lai Birža sniedz konsultācijas (paskaidrojumus) par plānotajiem grozījumiem;

2) ja profesionālo asociāciju pārstāvji nav pieprasījuši paskaidrojumus (konsultācijas) par plānotajiem grozījumiem, Birža sagatavo grozījumu projektu un ne vēlāk kā 30 dienas pirms grozījumu apstiprināšanas nosūta to profesionālo asociāciju pārstāvjiem, kā arī Komisijai saskaņošanai;

3) grozījumi Noteikumos stājas spēkā Biržas padomes noteiktajā datumā, taču ne ātrāk kā nākamajā dienā pēc attiecīgo grozījumu publicēšanas Finanšu instrumentu tirgus likumā noteiktajā kārtībā.

3.1.4. Ārkārtas situācijās, ja tās ir izraisījušas nozīmīgas izmaiņas tirgū, tiesību aktu izmaiņas, tiesu lēmumi, valsts iestāžu lēmumi vai līdzīgi apstākļi, pēc Komisijas iepriekšēja saskaņojuma saņemšanas Birža drīkst nolemt, ka grozījumi Noteikumos stājas spēkā bez iepriekšējas to saskaņošanas šo Noteikumu 3.1.3. punktā noteiktajā kārtībā. Šādā gadījumā Birža nekavējoties pēc attiecīgo Noteikumu grozījumu apstiprināšanas informē par to Vērtspapīru tirgus profesionālo dalībnieku asociāciju un Latvijas Komercbanku asociāciju, kā arī citas profesionālo pārstāvju asociācijas (ja tas ir nepieciešams).

3.1.5. Biržai ir tiesības šajos Noteikumos noteiktās Biržas tiesības un pienākumus nodot citai sabiedrībai, kam ir atbilstoša kvalifikācija un pieredze nodoto pienākumu izpildē un kas apņemas nodrošināt Biržas regulēto tirgu darbību un pārvaldīt Tirdzniecības sistēmu, vai uzņēmumu apvienošanās gadījumā — kopuzņēmumam. Šāds piešķirums stājas spēkā ne ātrāk kā 4 nedēļas pēc datuma, kad Birža ir saņēmusi Komisijas apstiprinājumu un nosūtījusi Biedriem paziņojumu par šādu piešķirumu. Biedram šajos Noteikumos noteiktās tiesības un pienākumus ir tiesības nodot citai personai, tajā skaitā Biedra reorganizācijas gadījumā, vienīgi ar Biržas iepriekšēju atļauju.

3.2. Tehniskie noteikumi

Tirdzniecības sistēma

3.2.1. Birža lieto *SAXESS* Tirdzniecības sistēmu tirdzniecības nodrošināšanai Kapitāla vērtspapīru un Fiksētā ienākuma instrumentu tirgū. Šie Noteikumi piemērojami tikai tirdzniecībai ar Biržas regulētajos tirgos iekļautajiem un kotētajiem finanšu instrumentiem.

Birža var izdot atsevišķus dokumentus, kuros ir sniegti *SAXESS* tehniskie apraksti, kā arī sniegta detalizētāka informācija par Tirdzniecības sistēmas lietošanu.

Pieslēgums Tirdzniecības sistēmai

3.2.2. Biedra pieslēgumu Tirdzniecības sistēmai nodrošina ar datu pārraides tīklu starpniecību atbilstoši Biržas noteiktajai kārtībai. Birža drīkst iecelt konkrētus datu pārraides tīkla piegādātājus. Visas izmaiņas attiecībā uz īpaši ieceltiem tīkla piegādātājiem ir jāapspriež ar profesionālajām asociācijām šo Noteikumu 3.1.3. punkta otrajā un trešajā apakšpunktā noteiktajā kārtībā. Biedrs sedz visas izmaksas, kas saistītas ar Biedra datu pārraides tīkla ierīkošanu un ekspluatāciju.

Biedra Tehnoloģiskais aprīkojums

3.2.3. Pieslēgumu Tirdzniecības sistēmai var arī veikt, izmantojot Biržas sertificētu(-as) datoru lietojumprogrammu(-as). Birža nodrošina, ka Biedriem ir pieejams sertificēto datoru lietojumprogrammu saraksts.

3.2.4. Biedrs ir atbildīgs par piemērota Tehnoloģiskā aprīkojuma ierīkošanu tā pieslēgšanai Tirdzniecības sistēmai un komunikācijai ar to. Tehniskajam aprīkojumam ir jāatbilst prasībām, kuras nosaka Birža. Biedra pienākums ir izstrādāt lietojumprogrammu un režīmus saskaņā ar Biržas protokoliem datoru pieslēgumam Tirdzniecības sistēmai (darījuma, sesijas un piekļuves protokols) un nepārtraukti pielāgot lietojumprogrammas un režīmus, lai nodrošinātu, ka Tehnoloģiskais aprīkojums, kas pieslēgts Tirdzniecības sistēmai, ir projektēts tā, lai vienmēr tiktu ievēroti šie Noteikumi.

3.2.5. Biedru Tehnoloģiskajam aprīkojumam ir jādarbojas atbilstoši noteiktajām prasībām un tā, lai tas būtu pieslēgts un uzturētu pieslēgumu Tirdzniecības sistēmai.

3.2.6. Biedrs sedz visas izmaksas par Tehnoloģisko aprīkojumu un tā ierīkošanu Biedra telpās, tai skaitā izmaksas, kas ir saistītas ar komunikāciju ar Tirdzniecības sistēmu.

Sistēmas pārbaudes

3.2.7. Biedra Tehnoloģisko aprīkojumu (elektronisko pieslēgumu), kuru izmantojot ir paredzēts pieslēgties Tirdzniecības sistēmai, pirms pieslēguma veikšanas pārbauda Tirdzniecības sistēmas testa vidē. Testēšanu veic Biržas noteiktā kārtībā un saskaņā ar Biržas izdotiem norādījumiem. Biržai pirms pieslēguma veikšanas ir tiesības pārbaudīt Tehnoloģiskā aprīkojuma funkcionalitāti un Biedra elektronisko pieslēgumu Tirdzniecības sistēmai. Birža drīkst pieprasīt, lai Biedrs piedalītos šādās pārbaudēs.