

Исх. № 287 от 18 мая 2021 года

О применении Сборника типологий
недобросовестных и неправомерных практик,
связанных с осуществлением сделок
с финансовыми инструментами на рынке
ценных бумаг

Уважаемый Валерий Владимирович!

Рабочей группой НАУФОР по вопросам регулирования злоупотреблений на рынке ценных бумаг был разработан Сборник типологий недобросовестных и неправомерных практик, связанных с осуществлением сделок с финансовыми инструментами на рынке ценных бумаг (далее – Сборник типологий).

Сборник содержит описания недобросовестных и неправомерных действий при совершении сделок с финансовыми инструментами и механизмы их выявления. Среди таких практик, например, действия, направленные на дестабилизацию цен на финансовые инструменты, искусственное формирование стоимости финансового инструмента с использованием высокочастотных торговых алгоритмов, создание ложного или вводящего в заблуждение спроса/ предложения на финансовые инструменты, создание видимости торговой активности и пр. Также сборник включает в себя подробные методы анализа форумов.

Сборник типологий в соответствии с установленной в НАУФОР процедурой был рассмотрен подкомитетом профессиональных участников рынка ценных бумаг Комитета НАУФОР по внутреннему контролю и утвержден 14.05.2021.

Просим Вас дать оценку Сборнику типологий на предмет его применимости для участников рынка ценных бумаг.

Приложение:

1. Сборник типологий недобросовестных и неправомερных практик – 1 (один) файл
в формате pdf.

С уважением,
Президент

А.В. Тимофеев