

РЕШЕНИЕ
по делу № 1 17/110-11
г. Москва

Резолютивная часть решения оглашена 10 ноября 2011г.
В полном объеме решение изготовлено 24 ноября 2011г.

Комиссия Федеральной антимонопольной службы по рассмотрению дела о нарушении антимонопольного законодательства в составе: Председателя Комиссии – заместителя руководителя ФАС России А.Б. Кашеварова, членов Комиссии: начальника Управления контроля финансовых рынков ФАС России О.С. Сергеевой, начальника Управления контроля топливно-энергетического комплекса ФАС России Н.И. Диановой, заместителя начальника Управления контроля финансовых рынков ФАС России А.В. Андросенко, заместителя начальника Правового управления Е.А. Кузнецовой, заместителя начальника Аналитического управления ФАС России В.А. Шипунова (далее – Комиссия ФАС России), рассмотрев дело № 1 17/110-11 по признакам нарушения Закрытым акционерным обществом «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа» (191119, г. Санкт-Петербург, ул. Марата, д. 69-71, лит. А) (далее - ЗАО «СПБМТСБ») части 1 статьи 17 Федерального закона от 26.07.2006 №135-ФЗ «О защите конкуренции» (далее – Закон о защите конкуренции),

УСТАНОВИЛА:

1. Основанием для возбуждения дела явились результаты проведенных Федеральной антимонопольной службой на основании приказов ФАС России от 21.02.2011 № 121, от 28.04.2011 № 316, от 13.05.2011 № 363, от 27.05.2011 № 400 внеплановых выездных проверок соблюдения требований антимонопольного законодательства ЗАО «СПБМТСБ» за период с сентября 2010 года по апрель 2011 года (далее – Проверки).

По результатам проведения Проверок инспекция ФАС России установила следующее:

- регистрацию сделок в системе электронных торгов до поступления заявки на покупку/продажу;

- нарушение порядка определения победителей биржевых торгов.

Документы и сведения, полученные в ходе проведения внеплановых выездных проверок, а также акты проверок от 22.03.2011 и от 14.06.2011 приобщены к материалам дела № 1 17/110-11 о нарушении антимонопольного законодательства. ЗАО «СПБМТСБ» зарегистрировано в Едином государственном реестре юридических лиц 07.05.2008 за ОГРН 1089847188903.

ЗАО «СПБМТСБ» осуществляет деятельность по организации биржевой торговли на основании лицензии ФСФР России № 153 от 05.06.2008, предусматривающей право ЗАО «СПБМТСБ» на организацию биржевой торговли на территории Российской Федерации по товарным секциям:

секция нефти;

секция нефтепродуктов;

секция металлов;

секция строительных материалов;

секция зерна;

секция драгоценных металлов;

секция газа;

секция продукции нефтехимического производства;
секция срочного рынка;
секция электроэнергия;
секция энергоносители;
секция металлы и сплавы;
секция лес и лесоматериалы;
секция сельскохозяйственная продукция и продукция пищевой промышленности;
секция фармацевтическая продукция;
секция водные биологические ресурсы;
секция агрохимикаты;
секция минеральное сырье;
секция удобрения.

Согласно информации, размещенной на официальном сайте ЗАО «СПБМТСБ» в сети Интернет по адресу: <http://www.s-pimex.ru>, биржевая торговля на ЗАО «СПБМТСБ» организована в следующих секциях: нефтепродукты, нефть, агрохимикаты, зерно, лес, энергоносители, срочный рынок и газ.

В настоящее время организованы биржевые торги в секции «Нефтепродукты» (далее – Секция) нефтепродуктами и продукцией нефтехимического производства. Такие торги проводятся с использованием системы электронных торгов ЗАО «СПБМТСБ» (далее - СЭТ), разработчиком которой, согласно письму ЗАО «СПБМТСБ» от 16.05.2011 № 37-05, является филиал Компании «СМА Смол Системз АБ» в г. Москве.

Правилами биржевой торговли нефтепродуктами в Секции ЗАО «СПБМТСБ», утвержденными решением Совета директоров ЗАО «СПБМТСБ» от 23.01.2009 № 05 (в редакции, утвержденной решением Совета директоров от 06.08.2010 № 24) (далее – Правила биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» от 23.01.2009), и Правилами биржевой торговли нефтепродуктами в Секции ЗАО «СПБМТСБ», утвержденными решением Совета директоров ЗАО «СПБМТСБ» от 03.03.2011 (Протокол № 33) (в редакции, утвержденной решением Совета директоров от 28.03.2011 № 35) (далее – Правила биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» от 03.03.2011), установлены особенности биржевой торговли, порядок подготовки и проведения биржевых торгов в Секции, определены понятия торгов, торговой сессии, торгового дня, биржевого товара, участника торгов, базиса поставки, заявки, лота, сделки, товара и иных понятий, используемых при организации биржевой торговли нефтепродуктами.

В соответствии с Правилами биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» от 23.01.2009 и от 03.03.2011 (далее – Правила биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ»):

СЭТ является совокупность программно-технических средств, баз данных, телекоммуникационных средств и иного оборудования, составляющая подсистему программно-технического комплекса Биржи, предназначенная для заключения Сделок;

под биржевым товаром понимаются нефтепродукты и продукция нефтехимического производства определенной категории (вида, марки, качества), не изъятые из оборота и допущенные Биржей к биржевой торговле в Секции;

участником торгов является Член Биржи, Член Секции, Постоянный посетитель, Разовый посетитель, прошедший аккредитацию Биржи;

клиентом является юридическое или физическое лицо, зарегистрированное на Бирже на основании данных, полученных от участников торгов;

базисом поставки считается определенное Спецификацией биржевого товара место, куда доставляется реальный товар для исполнения обязательств продавца по сделке;

лотом является минимально допустимое количество единиц Биржевого товара в Заявке. Размер лота определяется Спецификацией биржевого товара;

заявкой считается электронный документ, поданный участником торгов и зарегистрированный в электронной торговой системе и представляющий собой электронную публичную оферту всем остальным участникам торгов заключить сделку на указанных в заявке условиях;

сделкой является зарегистрированное в СЭТ соглашение о купле-продаже Биржевого товара, заключенное между Участниками торгов в соответствии с Правилами биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ»;

под торгами понимается подача в СЭТ заявок и заключение сделок в ходе торговой сессии;

под торговой сессией понимается период торгового дня, в течение которого в соответствии с Правилами биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» участниками торгов подаются заявки и заключаются сделки в Секции;

под торговым днем понимается дата, в которую проводится торговая сессия или торговые сессии.

Согласно Разделу 8 Правил биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» сделки, совершаемые в Секции, являются сделками в отношении реального товара (биржевого товара, имеющегося в наличии у продавца, а также биржевого товара, который будет создан или приобретен продавцом в будущем, и выставленного на торги). Основным режимом торгов в Секции является двухсторонний встречный аукцион, организуемый путем выставления участниками торгов заявок на покупку и продажу реального товара в СЭТ.

Также Правилами биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» допускается в течение торгового дня, как во время торговой сессии, так и в дополнительное время, проведение одностороннего аукциона, когда в качестве заказчика аукциона по продаже/покупке биржевого товара выступает один из участников торгов (пункт 8.4 раздела 8 Правил биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ»).

ЗАО «СПБМТСБ» организует проведение односторонних аукционов в соответствии с Регламентом организации и проведения Односторонних аукционов в ЗАО «СПБМТСБ» по продаже/покупке Биржевых товаров, утвержденным приказом президента ЗАО «СПБМТСБ» от 29.11.2010 № 230 (далее – Регламент проведения аукционов).

В соответствии с Правилами биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» и Регламентом проведения аукционов односторонним аукционом является режим биржевой торговли, подразумевающий единственного продавца (покупателя) и несколько покупателей (продавцов), когда сделки заключаются при совпадении (пересечении) параметров встречных заявок по окончании фиксированного промежутка времени (один или несколько раз в день), достаточного для аккумуляции спроса и предложения. Односторонним аукционом считаются дискретный аукцион, а также аукцион на повышение/понижение.

2. Согласно письмам ЗАО «СПБМТСБ» от 16.05.2011 № 37-05, от 26.09.2011 № 33-09 и от 27.09.2011 №35-09 СЭТ состоит из сервера доступа, интеграционного модуля, ядра системы и базы данных. Участник торгов (трейдер) может ввести новую или снять свою заявку с удаленного рабочего места, в том числе использовать пакетную загрузку заявок из подготовленного списка заявок («корзины»). Во всех случаях постановки заявок они поступают на сервер доступа, где проводится начальная синтаксическая проверка допустимости приема заявки. Независимо от способа ввода (индивидуальная заявка или пакетом) каждая заявка имеет уникальный шестнадцатизначный номер <...> который присваивается ей сервером

доступа автоматически при ее отправке в интеграционный модуль. Обработка заявок на покупку и продажу происходит по одинаковому алгоритму.

После обработки заявки сервером доступа заявка попадает на интеграционный модуль, который проводит первичные проверки допустимости регистрации заявки в ядре системы (в том числе синтаксическую проверку). В случае отрицательного результата проверок участнику торгов (трейдеру) формируется уведомление о причинах отказа в регистрации заявки, при успешном завершении проверок заявка передается в ядро системы для регистрации. После поступления заявки в ядро системы в отношении нее проводится ряд проверок (в частности, проводится проверка реквизитов заявки, режим работы системы и т.п.), по результатам которых принимается решение о регистрации/отказе в регистрации заявки в ядре. В случае отрицательного результата проверок участнику торгов (трейдеру) формируется уведомление о причинах отказа в регистрации заявки, при положительном завершении проверок заявка регистрируется в ядре системы, где фиксируется время ее регистрации.

В соответствии с разделом 10 Правил биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» сделки в Секции заключаются в ходе торговой сессии в электронном режиме на основе заявок, подаваемых участниками торгов и принятых ЗАО «СПБМТСБ». При регистрации заявки в СЭТ автоматически фиксируется время ее подачи и ей присваивается уникальный порядковый номер <...>

В материалах дела № 1 17/110-11 о нарушении антимонопольного законодательства содержатся Реестры заявок и Сводные реестры сделок по итогам торгов нефтепродуктами в Секции, зарегистрированных в СЭТ за период с 01.09.2010 по 28.04.2011 (далее – Реестры заявок и Сводные реестры сделок), представленные ЗАО «СПБМТСБ» актами приема-передачи документов от 28.04.2011 № 1, от 24.05.2011 № 2, письмами от 01.03.2011 № 46-02, от 26.05.2011 № 56-05, от 27.09.2011 № 35-09, от 27.10.2011 № 28-10.

Реестры заявок, представленные ЗАО «СПБМТСБ», содержат информацию о времени регистрации заявок, поданных участниками торгов за период с 01.09.2010 по 28.04.2011, сервером доступа СЭТ и ядром системы.

Комиссия ФАС России по результатам рассмотрения содержащейся в Реестрах заявок информации установила, что время прохождения заявки от сервера доступа СЭТ до ядра системы колеблется в период одной торговой сессии, как в большую, так и в меньшую сторону.

Согласно письменным пояснениям ЗАО «СПБМТСБ» от 26.09.2011 № 33-09 программно-аппаратный комплекс СЭТ состоит из четырех отдельных аппаратных серверов, на каждом из которых запущена служба времени операционной системы Компании «Майкрософт». Программное обеспечение СЭТ в своей работе использует время операционной системы Компании «Майкрософт», которое фиксируется в базе данных при проведении различных транзакций и событий в СЭТ. При этом, по информации Компании «Майкрософт», даже при бесперебойной, идеальной работе службы времени операционной системы Компании «Майкрософт» расхождение времени на отдельных аппаратных серверах составляет 1-2 секунды сразу после проведения синхронизации. Кроме того, в промежутках между синхронизируемыми периодами добавляется погрешность работы внутренних часов сервера, которая может составлять до 1 секунды в сутки. В связи с этим, наблюдаемые расхождения происходят вследствие сравнения времени постановки заявок и совершения сделок по ним, полученного из разных аппаратных серверов.

Согласно устным пояснениям представителей ЗАО «СПБМТСБ» все заявки, попадающие на сервер доступа, выстраиваются в очередь и после проведения

всех проверок попадают в ядро системы в той же последовательности. В письменных пояснениях ЗАО «СПБМТСБ» от 26.09.2011 № 33-09 также указано, что последовательность поступления заявок на сервер доступа соответствует последовательности их регистрации в ядре системы после проверки на обеспеченность.

Вместе с тем, в Реестрах заявок содержатся сведения о нарушении очередности регистрации заявок в СЭТ.

Так, например, 08.02.2011 «***» проводился односторонний аукцион на повышение бензина А-76 н/э с базиса поставки ЛПДС Черкассы.

Сведения о заявках на покупку/продажу бензина А-76 н/э с базиса поставки ЛПДС Черкассы, зарегистрированных в СЭТ 08.02.2011, приведены в Таблице № 1.

Таблица № 1 «***»

Как указано в Таблице № 1, заявка № «***» на покупку «***» бензина А-76 н/э с базиса поставки ЛПДС Черкассы зарегистрирована сервером доступа СЭТ в «***». В ядре системы указанная заявка зарегистрирована через 4 минуты 8,350 секунды в «***». Вместе с тем, время прохождения проверок заявок на покупку бензина А-76 н/э с базиса поставки ЛПДС Черкассы, поданных остальными участниками одностороннего аукциона на повышение, не достигало 1,5 секунд.

Представитель ЗАО «СПБМТСБ» на заседании Комиссии ФАС России пояснил, что заявка «***» со старой ценой из очереди заявок была снята, и появилась новая заявка.

Согласно письменным пояснениям ЗАО «СПБМТСБ» от 26.09.2011 № 33-09 и от 04.10.2011 № 04-10 при проведении односторонних аукционов на повышение/понижение первой поданной участником торгов заявке присваивается уникальный номер <...> который содержит метку о времени сервера доступа. При этом, все последующие заявки от данного участника торгов имеют точно такой же уникальный номер <...> но время приема ее в ядре системы отличается.

В соответствии с пунктом 4 раздела V Регламента проведения аукционов снятие с торгов заявки в рамках мини-сессии (временной интервал, в рамках которого проводится односторонний аукцион по закупке/продаже аукционного лота) не допускается.

В течение периода проведения аукциона и до его завершения участники аукциона имеют возможность выставлять и редактировать свои заявки. Снятие (удаление) заявок запрещено. Если в ходе мини-сессии от участника аукциона уже была подана заявка, то его новая заявка отменяет действие предыдущей заявки (пункт 6 раздела VI Регламента проведения аукционов).

Согласно пункту 7 раздела V Регламента проведения аукционов время регистрации заявки фиксируется в СЭТ.

Подпунктом 10.1.13 пункта 10.1 раздела 10 Правил биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» от 23.01.2009 установлено, что при регистрации заявки в СЭТ ей присваивается уникальный порядковый номер <...>

Согласно письменным пояснениям ЗАО «СПБМТСБ» от 16.05.2011 № 37-05, от 26.09.2011 № 33-09 и от 27.09.2011 №35-09 уникальный номер содержит информацию о времени регистрации заявки сервером доступа.

Таким образом, все новые заявки участника аукциона, редактирующие ранее поданные, не могут быть зарегистрированы под одним уникальным номером.

В Таблице № 2 приведены сведения о заявках на покупку бензина Регуляр-92 Евро с базиса поставки Самарская группа НПЗ, зарегистрированных в СЭТ при проведении 23.03.2011 двухстороннего встречного аукциона, где колебание времени между сервером доступа СЭТ и ядром системы повлияло на

последовательность регистрации заявок в ядре системы.

Таблица № 2«***»

Согласно Таблице № 2 в ядре системы заявки на покупку бензина Регуляр-92 Евро с базиса поставки Самарская группа НПЗ были зарегистрированы в следующей последовательности:

1. «***»;
2. «***»;
3. «***».

Таким образом, заявка «***» зарегистрирована в ядре системы с нарушением последовательности регистрации заявок сервером доступа СЭТ.

В связи с изложенным, Комиссия ФАС России установила, что последовательность поступления заявок в ядро системы после прохождения всех предусмотренных ЗАО «СПБМТСБ» проверок не соответствует последовательности их регистрации сервером доступа СЭТ.

Кроме того, в Реестрах заявок содержатся сведения о колебании времени регистрации заявок между сервером доступа СЭТ и ядром системы, как в меньшую, так и в большую сторону (примеры, Таблица № 3).

Таблица № 3«***»

В связи с изложенным, Комиссия ФАС России установила, что колебание времени между сервером доступа СЭТ и ядром системы влияет на последовательность регистрации заявок в ядре системы.

Комиссия ФАС России также отметила, что ЗАО «СПБМТСБ» письмом от 02.11.2011 № 05-11 сообщило о техническом несовершенстве системы синхронизации времени операционной системы Компании «Майкрософт», используемой ЗАО «СПБМТСБ». Такое техническое несовершенство системы привело к отражению в Реестрах сделок и Реестрах заявок сделок, зарегистрированных в системе электронных торгов, до поступления заявки на покупку/продажу.

Письмами от 16.05.2011 № 37-05, от 26.09.2011 № 33-09 и от 27.09.2011 №35-09 ЗАО «СПБМТСБ» сообщило, что активизация заявки происходит после прохождения проверки обеспечения, и такая заявка становится доступна для заключения сделок.

Раздел 10 Правил биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» устанавливает, что при регистрации заявки в СЭТ автоматически формируется и направляется в Клиринговую организацию запрос на обеспечение заявки. В случае подтверждения обеспеченности заявки она принимается ЗАО «СПБМТСБ», в противном случае СЭТ отклоняет ее. Сделки могут заключаться только на основании заявок, прошедших контроль обеспечения в Клиринговой организации с положительным результатом и принятых ЗАО «СПБМТСБ».

Таким образом, колебания времени прохождения заявок от сервера доступа СЭТ до ядра системы в период одной торговой сессии, как в большую, так и в меньшую сторону могут привести к созданию преимущественных условий для заключения сделок тем участникам торгов, у заявок которых время прохождения проверок короче.

Законом Российской Федерации от 20.02.1992 № 2383-1 «О товарных биржах и биржевой торговле» установлено, что товарная биржа формирует оптовый рынок путем организации и регулирования биржевой торговли.

Материалы дела № 1 17/110-11 о нарушении антимонопольного законодательства содержат документы, предусматривающие право ЗАО «СПБМТСБ» на самостоятельную адаптацию программного обеспечения СЭТ в рамках штатной

возможности. Кроме того, ЗАО «СПБМТСБ» вправе получать любые услуги Компании «СМА Смол Системз АБ», в том числе на доработку, администрирование и сопровождение программного обеспечения СЭТ.

Учитывая изложенное, действия ЗАО «СПБМТСБ», связанные с использованием для проведения биржевых торгов в Секции программного обеспечения и аппаратно-технических средств СЭТ, допускающих колебание времени прохождения заявок от сервера доступа СЭТ до ядра системы в период одной торговой сессии, как в большую, так и в меньшую сторону, создают участнику торгов или нескольким участникам торгов преимущественные условия участия в торгах.

3. Реестры заявок и Сводные реестры сделок содержат информацию о сделках, зарегистрированных в СЭТ на основании заявок, поданных в СЭТ после закрытия торговой сессии, а также заявках, которые не проверялись на наличие встречных заявок с совпадающей или пересекающейся ценой до их занесения в очередь заявок.

3.1. Согласно разделу 10 Правил биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» торги в Секции проводятся в течение торговых сессий в торговые дни, предусмотренные спецификациями биржевого товара, за исключением официально установленных в Российской Федерации выходных и праздничных дней. Время начала и окончания торговых сессий устанавливается в Приложении №1 к Правилам биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ».

Правилами биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» от 23.01.2009 установлены две торговые сессии:

- первая торговая сессия с 11.00 до 12.30;
- вторая торговая сессия с 14.00 до 15.00.

Также Правилами биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» от 23.01.2009 установлен период открытия с 10.45 до 11.00.

Согласно разделу 8 Правил биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» от 23.01.2009 в течение периода открытия участники торгов могут выставлять в СЭТ заявки на покупку и продажу, снимать и изменять параметры выставленных в СЭТ заявок. При этом, во время периода открытия заключение сделок не осуществляется.

Правилами биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» от 03.03.2011 также установлены две торговые сессии:

- первая торговая сессия с 10.45 до 12.30;
- вторая торговая сессия с 14.00 до 15.00.

Период открытия Правилами биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» от 03.03.2011 не установлен.

Вместе с тем, Реестры заявок и Сводные реестры сделок содержат сведения о сделках, зарегистрированных в СЭТ, на основании заявок, поданных в СЭТ после закрытия торговой сессии (Таблица № 4).

Таблица № 4 «***»

Правилами биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» предусмотрено изменение времени проведения операций при возникновении технических сбоев в СЭТ (пункт 3 Приложения №1 к Правилам биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» от 03.03.2011). Такое изменение может осуществляться ЗАО «СПБМТСБ» без предварительного оповещения участников торгов.

ЗАО «СПБМТСБ» письмом от 26.05.2011 №56-05 представило сведения о технических и операционных сбоях СЭТ за период с 01.09.2010 по 28.04.2011, согласно которому технические и операционные сбои происходили в следующие дни: 30.11.2010, 16.12.2010, 20.12.2010, 01.02.2011, 01.03.2011, 04.03.2011, 15.03.2011,

25.03.2011, 29.03.2011, 07.04.2011, 13.04.2011, 19.04.2011 и 20.04.2011.

Учитывая изложенное, регистрация в СЭТ указанных в Таблице № 4 сделок на основании заявок, поданных в СЭТ после закрытия торговой сессии, не являлось следствием технических и операционных сбоев СЭТ.

Порядок заключения сделок на биржевых торгах в Секции ЗАО «СПБМТСБ» при проведении двухстороннего встречного аукциона установлен разделом 10 Правил биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ».

В соответствии с пунктом 10.3 раздела 10 Правил биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» от 23.01.2009 сделки в ходе торговой сессии заключаются как на основании заявок, поданных участниками торгов и принятых ЗАО «СПБМТСБ» в течение периода открытия, так и на основании заявок, поданных участниками торгов и принятых ЗАО «СПБМТСБ» в течение торговой сессии.

Пунктом 10.2 раздела 10 Правил биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» от 03.03.2011 установлено, что сделки в ходе торговой сессии заключаются на основании заявок, поданных участниками торгов и принятых ЗАО «СПБМТСБ» в течение торговой сессии.

В связи с изложенным, ЗАО «СПБМТСБ» нарушило порядок заключения сделок, установленный пунктом 10.3 раздела 10 Правил биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» от 23.01.2009 и пунктом 10.2 раздела 10 Правил биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» от 03.03.2011.

3.2. Согласно Реестрам заявок в СЭТ 22.03.2011 зарегистрированы следующие заявки на покупку/продажу бензина Нормаль-80 с базиса поставки Комсомольский НПЗ:

- «***»;
- «***»;
- «***»;
- «***».

В соответствии с порядком проведения торгов, установленным разделом 10 Правил биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» от 03.03.2011, после приема ЗАО «СПБМТСБ» заявка до ее занесения в очередь заявок проверяется на наличие встречных заявок с совпадающей или пересекающейся ценой и на возможность выполнения условия исполнения данной заявки. Если условие исполнения заявки может быть выполнено и при наличии для заявки при ее приеме ЗАО «СПБМТСБ» хотя бы одной пересекающейся встречной заявки происходит заключение сделки. Сделка заключается по цене лучшей пересекающейся встречной заявки. При равенстве цен в заявках одинаковой направленности приоритет имеет заявка, поданная раньше. Заявка будет находиться в очереди заявок либо до тех пор, пока не сможет быть исполнена, либо пока не будет снята.

Вместе с тем, заявка на продажу «***» до ее занесения в очередь заявок не прошла проверку на наличие встречных заявок с совпадающей или пересекающейся ценой и на возможность выполнения условия исполнения данной заявки. В связи с этим, сделка купли-продажи бензина Нормаль-80 с базиса поставки Комсомольский НПЗ объемом «***» на основании встречной заявки «***», поданной «***», не заключена.

Согласно Реестрам заявок в СЭТ 24.03.2011 зарегистрированы следующие заявки на покупку/продажу бензина Премиум-95 Евро с базиса поставки Самарская группа НПЗ:

- «***»;
- «***»;
- «***»;
- «***».

Вместе с тем, заявка на продажу «***» до ее занесения в очередь заявок не прошла проверку на наличие встречных заявок с совпадающей или пересекающейся ценой и на возможность выполнения условия исполнения данной заявки, установленную разделом 10 Правил биржевой торговли ЗАО «СПбМТСБ» от 03.03.2011. В связи с этим, сделка купли-продажи бензина Премиум-95 Евро с базиса поставки Самарская группа НПЗ объемом «***» на основании встречной заявки «***», поданной «***», не заключена.

Согласно письменным пояснениям ЗАО «СПбМТСБ» от 02.11.2011 № 05-11 в марте 2011 года, то есть в период резкого увеличения спроса на нефтепродукты, количество подаваемых заявок в СЭТ увеличилось в несколько раз. Кроме того, торговая активность участников торгов резко сместилась на начало торговой сессии. Это привело к тому, что в некоторые торговые дни, начиная с 14.03.2011, формировалась очередь заявок в промежутке между событием «Торговая сессия» и событием «Открыть Нефтепродукты» без заключения сделок (даже при наличии теоретически пересекающихся цен у заявок противоположной направленности). После обработки второго события «Открыть Нефтепродукты» запускалась процедура заключения сделок, которая не учитывала последовательность поступления заявок в СЭТ в течение 10 секунд технологического периода, рассматривая их, как поступившие в одинаковое время, равное времени отработки второго события, и СЭТ выбирала лучшие заявки, начиная с заявок на покупку с самой высокой ценой, и заявок на продажу с самой низкой ценой.

Вместе с тем, Реестры заявок содержат сведения о заявках, которые не проходили проверку на наличие встречных заявок с совпадающей или пересекающейся ценой и на возможность выполнения условия исполнения данной заявки вне промежутка между событием «Торговая сессия» и событием «Открыть Нефтепродукты» до марта 2011 года (Таблица № 5).

Таблица № 5 «***»

Разделом 10 Правил биржевой торговли ЗАО «СПбМТСБ» от 23.01.2009 предусмотрен аналогичный алгоритм прохождения проверки заявки на наличие встречных заявок с совпадающей или пересекающейся ценой и на возможность выполнения условия исполнения данной заявки. При этом, сделка заключается по цене лучшей пересекающейся заявки продавца.

Таким образом, указанная в Таблице №5 заявка «***» на покупку до ее занесения в очередь заявок не прошла проверку на наличие встречных заявок с совпадающей или пересекающейся ценой и на возможность выполнения условия исполнения данной заявки, установленную разделом 10 Правил биржевой торговли ЗАО «СПбМТСБ» от 23.01.2009. В связи с этим, сделка купли-продажи бензина Регуляр-92 с базиса поставки Самарская группа НПЗ объемом «***» по лучшей пересекающейся цене «***» за тонну по отношению к встречной заявке «***», поданной «***», не заключена.

Согласно письменным пояснениям ЗАО «СПбМТСБ» от 27.10.2011 № 28-10 обработка заявки «***» остановилась на шаге приема. Таким образом, указанная заявка не была занесена СЭТ в очередь заявок. Вместе с тем, ЗАО «СПбМТСБ» не сообщило в письме от 26.05.2011 №56-05 о технических и операционных сбоях СЭТ при проведении 13.09.2010 биржевых торгов в Секции.

Учитывая изложенное, Комиссия ФАС России пришла к выводу, что ЗАО «СПбМТСБ» нарушает порядок определения победителей биржевых торгов, который установлен разделом 10 Правил биржевой торговли ЗАО «СПбМТСБ».

4. Сводные реестры сделок содержат информацию о сделках, заключенных на

основании заявок на продажу, поданных «***», и заявок на покупку, поданных «***» в интересах иных клиентов, а также заявок на продажу, поданных «***», и заявок на покупку, поданных «***» в интересах иных клиентов.

ЗАО «СПБМТСБ» письмом от 26.09.2011 №33-09 представило списки участников торгов (покупателей), имеющими технический доступ к СЭТ через автоматизированное рабочее место (далее – АРМ), установленное в торговом зале ЗАО «СПБМТСБ» и вынесенное за пределы торгового зала ЗАО «СПБМТСБ» (удаленный доступ).

Согласно указанным спискам «***» и «***» имеют в торговом зале ЗАО «СПБМТСБ» по 2 АРМ.

Также, письмом от 26.09.2011 №33-09 ЗАО «СПБМТСБ» представлены сведения о сделках за период с 01.09.2010 по 28.04.2011 в Секции, заключенных участниками торгов, имеющих технический доступ к СЭТ через АРМ, установленное в торговом зале ЗАО «СПБМТСБ» или вынесенное за пределы торгового зала ЗАО «СПБМТСБ» (удаленный доступ).

Согласно указанным сведениям «***», а также «***» заключали сделки на основании поданных ими встречных заявок с АРМ, установленных в торговом зале ЗАО «СПБМТСБ» (Таблица № 6).

Таблица № 6 «***»

По мнению Комиссии ФАС России, заключение сделок на основании поданных одним участником торгов встречных заявок с АРМ, установленных в торговом зале ЗАО «СПБМТСБ», создает его клиентам преимущественные условия заключения сделок в ходе биржевых торгов.

В соответствии с разделом 8 Правил биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ» участвовать в торгах при проведении одностороннего аукциона могут все участники торгов, аккредитованные в Секции на день проведения одностороннего аукциона (как от своего имени, так и от имени клиентов). Не допускается регистрация сделки на основании встречных заявок, поданных от имени одного участника торгов или одного клиента или одного юридического или физического лица. Запрещается заключение сделки, контрагентами по которой являются участник торгов и его клиент, за исключением сделки, заключенной от имени клиентов участника торгов.

Согласно письменным пояснениям от 02.11.2011 № 05-11 ЗАО «СПБМТСБ» допускает, что возможны ситуации, при которых сделка в СЭТ будет заключена на основании разнонаправленных заявок одного биржевого брокера, действующего в интересах различных клиентов. Кроме того, ЗАО «СПБМТСБ» сообщило, что единственной моделью оформления отношений между профессиональными биржевыми посредниками и их клиентами, позволяющей исключить или свести к минимуму возможность совершения в СЭТ недействительных (ничтожных) сделок при одновременной подаче разнонаправленных заявок, является коммерческое представительство.

Таким образом, ЗАО «СПБМТСБ» допускает заключение сделок на основании встречных заявок, поданных одним участником торгов с АРМ, установленных в торговом зале ЗАО «СПБМТСБ».

В связи с изложенным, Комиссия ФАС России установила, что действия ЗАО «СПБМТСБ» создают преимущественные условия для заключения сделок в ходе биржевых торгов на основании поданных одним участником торгов встречных заявок с АРМ, установленных в торговом зале ЗАО «СПБМТСБ».

5. В соответствии с частью 1 статьи 17 Закона о защите конкуренции при проведении торгов запрещаются действия, которые приводят или могут привести к

недопущению, ограничению или устранению конкуренции, в том числе:

- создание участнику торгов или нескольким участникам торгов преимущественных условий участия в торгах, в том числе путем доступа к информации, если иное не установлено федеральным законом (пункт 2 части 1 статьи 17 Закона о защите конкуренции);

- нарушение порядка определения победителя или победителей торгов (пункт 3 части 1 статьи 17 Закона о защите конкуренции).

Учитывая изложенное, Комиссия ФАС России пришла к следующим выводам:

1. ЗАО «СПБМТСБ» создает участникам торгов преимущественные условия участия в торгах следующими способами:

- использованием для проведения биржевых торгов в Секции программного обеспечения и аппаратно-технических средств СЭТ, допускающих колебание времени прохождения заявок от сервера доступа СЭТ до ядра системы в период одной торговой сессии, как в большую, так и в меньшую сторону;

- созданием условий для заключения сделок в ходе биржевых торгов на основании поданных одним участником торгов встречных заявок с АРМ, установленных в торговом зале ЗАО «СПБМТСБ».

2. ЗАО «СПБМТСБ» нарушает порядок определения победителей биржевых торгов, который установлен разделом 10 Правил биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ».

Указанные действия, по мнению Комиссии ФАС России, могут привести к недопущению, ограничению или устранению конкуренции.

В связи с изложенным, Комиссия ФАС России пришла к выводу о том, что ЗАО «СПБМТСБ» при проведении биржевых торгов нефтепродуктами в Секции нарушает:

- пункт 2 части 1 статьи 17 Закона о защите конкуренции в связи с использованием для проведения биржевых торгов в Секции программного обеспечения и аппаратно-технических средств СЭТ, допускающих колебание времени прохождения заявок от сервера доступа СЭТ до ядра системы в период одной торговой сессии, как в большую, так и в меньшую сторону и созданием условий для заключения сделок в ходе биржевых торгов на основании поданных одним участником торгов встречных заявок с АРМ, установленных в торговом зале ЗАО «СПБМТСБ»;

- пункт 3 части 1 статьи 17 Закона о защите конкуренции в связи с нарушением порядка определения победителей биржевых торгов, который установлен разделом 10 Правил биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ».

При рассмотрении дела № 1 17/110-11 о нарушении антимонопольного законодательства Комиссия ФАС России учла следующие обстоятельства.

Согласно письму от 02.11.2011 № 05-11 ЗАО «СПБМТСБ» 28.03.2011 направило электронное письмо Компании «СМА Смол Системз АБ» об устранении технических сбоев СЭТ в первые секунды открытия торговой сессии, связанных с нарушением порядка заключения сделок, установленным разделом 10 Правил биржевой торговли ЗАО «СПБМТСБ». Компанией «СМА Смол Системз АБ» в адрес ЗАО «СПБМТСБ» направлено электронное письмо с указанием на способ устранения указанных технических сбоев СЭТ. ЗАО «СПБМТСБ» 29.03.2011 внесены соответствующие изменения в СЭТ, что подтверждается скрин-шотом из СЭТ.

ЗАО «СПБМТСБ» представлена копия письма ЗАО «СПБМТСБ» от 08.11.2011 №09-11, направленного филиалу Компании «СМА Смол Системз АБ» в г. Москве, с заданием о подготовке обновления программного обеспечения, позволяющего исключить колебание времени прохождения заявок от сервера доступа СЭТ до ядра системы.

Также, ЗАО «СПБМТСБ» представлена копия приказа президента ЗАО «СПБМТСБ»

от 10.11.2011 № 581, согласно которому участнику торгов предоставляется не более одного рабочего места в торговом зале ЗАО «СПБМТСБ».

Таким образом, ЗАО «СПБМТСБ» предприняло действия, направленные на недопущение в дальнейшем установленных Комиссией ФАС России нарушений пунктов 2, 3 части 1 статьи 17 Закона о защите конкуренции.

Принимая во внимание изложенное, и руководствуясь статьей 4, частью 1 статьи 17, частями 1 и 2 статьи 41, частью 2 статьи 45, пунктом 1 части 1 статьи 48, статьей 49 Закона о защите конкуренции, Комиссия ФАС России

РЕШИЛА:

1. Признать ЗАО «СПБМТСБ» нарушившим пункт 2 части 1 статьи 17 Закона о защите конкуренции в связи с созданием участникам торгов преимущественных условий участия в биржевых торгах нефтепродуктами в Секции «Нефтепродукты» ЗАО «СПБМТСБ».

2. Признать ЗАО «СПБМТСБ» нарушившим пункт 3 части 1 статьи 17 Закона о защите конкуренции в связи с нарушением порядка определения победителей торгов при проведении биржевых торгов нефтепродуктами в Секции «Нефтепродукты» ЗАО «СПБМТСБ».

3. В соответствии с пунктом 1 части 1 статьи 48 Закона о защите конкуренции прекратить рассмотрение дела № 1 17/110-11 о нарушении ЗАО «СПБМТСБ» антимонопольного законодательства в связи с добровольным устранением ЗАО «СПБМТСБ» нарушения антимонопольного законодательства.

Решение может быть обжаловано в течение трех месяцев со дня его принятия.