



ЗАКРЫТОЕ АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО
«Фондовая биржа ММВБ»
(ЗАО «ФБ ММВБ»)

Большой Кисловский пер., 13,
Москва, Россия, 125009
Тел. (495) 363-32-32, факс (495) 234-48-40
E-mail: fbinfo@micex.ru; www.micex.ru
ОКПО 71341319, ОГРН 1037789012414
ИНН/КПП 7703507076/775001001

Руководителю фондового подразделения
Участника торгов ЗАО «ФБ ММВБ»

05.07.2013 № 31-14/1032

На № _____ от _____

Информируем Вас о том, что в соответствии с Правилами проведения торгов по ценным бумагам в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ», утвержденными Советом директоров ЗАО «ФБ ММВБ» 29 марта 2013 года (Протокол № 19) (далее – Правила торгов), Распоряжением ЗАО «ФБ ММВБ» с 08 июля 2013 года установлены следующие дополнительные условия проведения торгов в Режимах торгов «РЕПО с акциями (в ин. валюте)», «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)», «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)» в ЗАО «ФБ ММВБ»:

1. Перечень ценных бумаг, с которыми допускается заключение сделок РЕПО в Режимах торгов «РЕПО с акциями (в ин. валюте)», «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)», «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)», предусмотрен в Приложении к настоящему Уведомлению (Перечень ценных бумаг, с которыми допускается заключение сделок РЕПО в иностранной валюте).

2. По ценным бумагам, допущенным к торгам в Режимах торгов «РЕПО с акциями (в ин. валюте)», «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)», «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)», устанавливается порядок расчета параметров сделки РЕПО в соответствии с пп. 2.9.7.10 Правил торгов.

3. В случае, если эмиссионными документами предусмотрено начисление и выплата купонного (процентного) дохода и/или погашение части основного долга (амортизационные выплаты), устанавливается следующий порядок и срок изменения суммы РЕПО по сделкам РЕПО с облигациями в Режимах торгов «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)», «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)»:

- По облигациям Эмитентов, с которыми у НКО ЗАО НРД заключены договоры об оказании услуг платежного агента, сумма РЕПО в сделках РЕПО с облигациями уменьшается на величину начисленного купонного (процентного) дохода и/или на величину погашенной части основного долга (амортизационной выплаты) соответственно в дату получения ЗАО «ФБ ММВБ» от НКО ЗАО НРД в соответствии с соглашением с Платежным агентом электронного документа «Информация о выплатах», содержащего сведения о выплатах текущего дня начисленного купонного (процентного) дохода и/или о погашении части основного долга (амортизационная выплата) по облигациям, исходя из официального курса доллара США по отношению к рублю, установленного Центральным банком Российской Федерации на дату получения от НКО ЗАО НРД информации о выплате такого дохода.

В случае, если в течение 7 дней с даты, в которую должна производиться выплата купонного (процентного) дохода и/или амортизационная выплата в соответствии с эмиссионными

документами, информация о выплате доходов по облигациям не поступила, пересчет суммы РЕПО, связанный с выплатой такого дохода, не осуществляется.

- По облигациям, по которым ЗАО «ФБ ММВБ» не осуществляет взаимодействие с НКО ЗАО НРД и другими платежными агентами, сумма РЕПО уменьшается на величину начисленного купонного (процентного) дохода и/или на величину погашенной части основного долга (амортизационной выплаты) с даты начала следующего купонного периода по облигациям, определенной эмиссионными документами, но до начала торгов в указанную дату. Если дата выплаты купонного (процентного) дохода по облигациям и/или погашения части основного долга (проведения амортизационной выплаты) по облигациям, определенная эмиссионными документами, приходится на нерабочий день, то сумма РЕПО уменьшается на величину начисленного купонного (процентного) дохода и/или на величину погашенной части основного долга (амортизационной выплаты) со следующего рабочего дня. Сумма РЕПО в сделках РЕПО с облигациями уменьшается на величину начисленного купонного (процентного) дохода и/или на величину погашенной части основного долга (амортизационной выплаты) исходя из официального курса доллара США по отношению к рублю, установленного Центральным банком Российской Федерации на дату начала следующего купонного периода по облигациям, определенной эмиссионными документами.

4. В Режимы торгов «РЕПО с акциями (в ин. валюте)», «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)», «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)» расчетной ценой ценной бумаги является рыночная цена, рассчитанная в предшествующий торговый день в соответствии с Порядком определения рыночной цены ценных бумаг, расчетной цены ценных бумаг, а также предельной границы колебаний рыночной цены ценных бумаг в целях 23 главы Налогового кодекса Российской Федерации, утвержденным Приказом Федеральной службы по финансовым рынкам от 9 ноября 2010 г. N 10-65/пз-н (далее – Порядок). В случае отсутствия рыночной цены, рассчитанной в соответствии с указанным Порядком в предшествующий торговый день, расчетная цена ценной бумаги (за исключением ОФЗ) не определяется. В случае отсутствия рыночной цены ОФЗ, рассчитанной в соответствии с Порядком в предшествующий торговый день, расчетной ценой ОФЗ является последняя использовавшаяся расчетная цена.

5. Допустимыми кодами расчетов при заключении сделок в Режимы торгов «РЕПО с акциями (в ин. валюте)», «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)», «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)» являются Rb, S0, S1, S2, Z0.

5. При подаче адресных заявок с указанием кодов расчетов Rb, S0, S1, S2, Z0 для заключения сделок с ценными бумагами в Системе торгов ЗАО «ФБ ММВБ» в Режимы торгов «РЕПО с акциями (в ин. валюте)», «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)», «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)» установлено возможное предельное значение следующего реквизита заявок:

- минимальное значение суммы РЕПО: 1 доллар США.

6. При подаче адресных заявок для заключения сделок с ценными бумагами в Системе торгов ЗАО «ФБ ММВБ» в Режимы торгов «РЕПО с акциями (в ин. валюте)», «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)», «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)» установлено следующее максимальное значение объема заявки:

- 350 000 000 долларов США.

7. При проведении торгов облигациями, предусмотренными в Таблице Приложения к настоящему Распоряжению, в Режимы торгов «РЕПО с акциями (в ин. валюте)», «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)», «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)» в реквизитах заявки может быть указан только код расчетов и/или Срок сделки РЕПО, не предусматривающий исполнение сделки в период приостановки (прекращения) торгов облигациями в связи с выплатой купонного дохода и/или ее погашением или в период, находящийся за пределами последнего купонного периода с известной ставкой купона.

8. При подаче адресной заявки РЕПО в Режимы торгов «РЕПО с акциями (в ин. валюте)», «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)», «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)» может быть указана

ставка фиксированного возмещения. Переменное возмещение в данных Режимах торгов не определяется и не уплачивается.

9. Расчет цен первой и второй частей сделки РЕПО в Режимах торгов «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)», «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)» осуществляется с точностью до 6-ти знаков после запятой. Точность расчета цен первой и второй частей сделки РЕПО в Режиме торгов «РЕПО с акциями (в ин. валюте)» устанавливается для каждой отдельной бумаги в соответствии с п.п. 1.6 – 1.9 Распоряжения ЗАО «ФБ ММВБ» №641-р от 21.05.2013 года.

10. Расчет цен первой и второй частей сделки РЕПО в Режимах торгов «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)», «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)» осуществляется с точностью до 6-ти знаков после запятой. Шаг дисконта, шаг ставки РЕПО в Режиме торгов «РЕПО с акциями (в ин. валюте)» устанавливается для каждой отдельной бумаги в соответствии с п.п. 1.6 – 1.9 Распоряжения ЗАО «ФБ ММВБ» №641-р от 21.05.2013 года.

11. При проведении торгов по ценным бумагам установлено следующее время начала и окончания торгов в Режимах торгов «РЕПО с акциями (в ин. валюте)», «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)», «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)»:

Режим торгов	Время начала и окончания торгов
Режим торгов «РЕПО с акциями (в ин. валюте)» (с кодами расчетов – Rb, S0, S1, S2)	09:30 ÷ 19:00
Режим торгов «РЕПО с акциями (в ин. валюте)» (с кодами расчетов – Z0)	09:30 ÷ 18:30
Режим торгов «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)» (с кодами расчетов – Rb, S0, S1, S2)	09:30 ÷ 19:00
Режим торгов «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)» (с кодами расчетов – Z0)	09:30 ÷ 18:30
Режим торгов «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)» (с кодами расчетов – Rb, S0, S1, S2)	09:30 ÷ 19:00
Режим торгов «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)» (с кодами расчетов – Z0)	09:30 ÷ 18:30

С уважением,

Генеральный директор
ЗАО «ФБ ММВБ»

А.В.Кузнецова