

ПРОГРАММА

РЕПО с Центральным контрагентом с Акциями

Раздел I. Термины и определения

Достаточный объем сделок – суммарный объем сделок РЕПО Маркет-мейкера, совершенных с Инструментом в течение одного торгового дня в рамках исполнения обязательств, предусмотренных настоящей Программой, по достижении которого Маркет-мейкер освобождается от указанных обязательств.

Инструмент – выпуск ценных бумаг, указанный в Таблице, приведенной в пункте 2.2. настоящей Программы.

Объем двусторонней котировки РЕПО – минимальный объем подаваемых лимитных заявок с сохранением в котировках на заключение сделок РЕПО (должно выполняться для каждой направленности заявок).

Пассивная сделка РЕПО - сделка Маркет-мейкера, в реквизитах которой номер заявки Маркет-мейкера меньше номера встречной заявки.

Период поддержания котировок - период времени, в течение которого Маркет-мейкер обязан поддерживать двусторонние котировки РЕПО в соответствии с условиями Программы.

Программа – Программа РЕПО с Центральным контрагентом с Акциями.

Спрэд двусторонней котировки РЕПО – максимальная разница между ставкой РЕПО, содержащейся в лимитной заявке Маркет-мейкера с сохранением в котировках на заключение сделки РЕПО, по которой Маркет-мейкер является покупателем по первой части сделки РЕПО, и ставкой РЕПО, содержащейся в лимитной заявке Маркет-мейкера с сохранением в котировках на заключение сделки РЕПО, по которой Маркет-мейкер является продавцом по первой части сделки РЕПО.

Торговый период - период проведения торгов Инструментом в Секции рынка РЕПО Биржи.

Термины, не определенные в настоящей Программе, используются в значениях, установленных Правилами выполнения функций Маркет-мейкера в Секции рынка РЕПО ЗАО «ФБ ММВБ» и иными внутренними документами Биржи, а при отсутствии таковых – в соответствии с действующим законодательством Российской Федерации.

Раздел II. Параметры и условия выполнения обязательств Маркет-мейкера

2.1. Маркет-мейкер, выбравший настоящую Программу, обязан в соответствии с заключенным Договором исполнять обязательства по Программе в Торговом периоде в Режиме торгов “РЕПО с ЦК – Безадресные заявки” для срока РЕПО 1 день с расчетами в рублях (BoardId - EQRP) в Секции рынка РЕПО Биржи.

2.2. По каждому из Инструментов устанавливаются следующие значения параметров исполнения обязательств Маркет-мейкера:

Таблица

№	Краткое наименование эмитента и признак привилегированных акций (ап)	Код Инструмента	Объем двусторонней котировки РЕПО (в лотах)	Спрэд двусторонней котировки РЕПО	Достаточный объем сделок (в лотах)	Период поддержания котировок
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)
1	Банк ВТБ (ПАО)	VTBR	150 000	1,25%	450 000	4 час. 48 мин.
2	ПАО Сбербанк	SBER	90 000	1,25%	270 000	4 час. 48 мин.
3	ПАО «Газпром»	GAZP	65 000	1,25%	195 000	4 час. 48 мин.
4	Polymetal International plc (Полиметалл Интернэшнл плс)	POLY	150 000	1,25%	450 000	4 час. 48 мин.
5	ПАО «Аэрофлот»	AFLT	1 300	1,25%	3 900	4 час. 48 мин.
6	ПАО «ЛУКОЙЛ»	LKOH	35 000	1,25%	105 000	4 час. 48 мин.
7	ПАО «ГМК «Норильский Никель»	GMKN	11 000	1,25%	33 000	4 час. 48 мин.
8	ПАО Московская Биржа	MOEX	45 000	1,25%	135 000	4 час. 48 мин.
9	ПАО Сбербанк ап	SBERP	12 000	1,25%	36 000	4 час. 48 мин.
10	ОАО «НК «Роснефть»	ROSN	30 000	1,25%	90 000	4 час. 48 мин.
11	ОАО «Сургутнефтегаз»	SNGS	20 000	1,25%	60 000	4 час. 48 мин.
12	ОАО «Сургутнефтегаз» ап	SNGSP	17 000	1,25%	51 000	4 час. 48 мин.
13	ПАО «Магнит»	MGNT	5 000	1,25%	15 000	4 час. 48 мин.
14	ОАО «НОВАТЭК»	NVTK	5 000	1,25%	15 000	4 час. 48 мин.
15	ОАО «АК «Транснефть» ап	TRNFP	160	1,25%	480	4 час. 48 мин.
16	ПАО «МТС»	MTSS	20 000	1,25%	40 000	4 час. 48 мин.
17	ОАО «Акрон»	AKRN	6 000	1,25%	18 000	4 час. 48 мин.
18	ПАО «Северсталь»	CHMF	4 500	1,25%	13 500	4 час. 48 мин.
19	АК «АЛРОСА» (ПАО)	ALRS	7 000	1,25%	21 000	4 час. 48 мин.
20	ПАО «ФСК ЕЭС»	FEES	30 500	1,25%	91 500	4 час. 48 мин.
21	ПАО «Ростелеком»	RTKM	20 000	1,25%	60 000	4 час. 48 мин.
22	ПАО «НЛМК»	NLMK	25 000	1,25%	75 000	4 час. 48 мин.
23	ПАО «Татнефть» им. В.Д. Шашина	TATN	6 000	1,25%	18 000	4 час. 48 мин.
24	ПАО «РусГидро»	HYDR	75 000	1,25%	225 000	4 час. 48 мин.
25	ПАО «Газпром нефть»	SIBN	13 000	1,25%	26 000	4 час. 48 мин.

2.3. Маркет-мейкер считается исполнившим по Инструменту в течение Торгового дня обязательства, указанные в пункте 2.2. настоящей Программы, только в случае выполнения им в отношении Инструмента хотя бы одного из следующих условий:

- соблюдение в течение периода, указанного в столбце 7 Таблицы, параметров обязательств, указанных в столбцах 4 и 5 Таблицы;
- выполнение обязательств, указанных в столбце 6 Таблицы.

2.4. Обязательства Маркет-мейкера за Торговый день считаются исполненными в случае, если Маркет-мейкер выполнил свои обязательства по 13 Инструментам согласно пункту 2.3. настоящей Программы.

2.5. Минимально допустимое количество Торговых дней Отчетного периода, в течение которых Маркет-мейкер должен исполнять обязательства согласно пункту 2.4. настоящей Программы, определяется как 80% от Торговых дней Отчетного периода. В случае нарушения данного условия, услуги Маркет-мейкера по настоящей Программе считаются не оказанными.

В случае действия настоящей Программы неполный Отчетный период, вместо количества Торговых дней в Отчетном периоде рассматривается фактическое количество Торговых дней, когда Маркет-мейкер мог выполнять свои функции.

2.6. Биржей определено, что максимальное количество Маркет-мейкеров по настоящей Программе не может быть более 2 (двух).

Раздел III. Порядок расчета вознаграждения Маркет-мейкера за выполнение обязательств по Программе

3.1. Размер вознаграждения Маркет-мейкера за выполнение им в течение Отчетного периода условий, предусмотренных настоящей Программой, рассчитывается по следующей формуле:

$$PB = KB$$

где

PB - размер вознаграждения Маркет-мейкера за Отчетный период;

KB - оборотная часть комиссионного вознаграждения, уплаченного Маркет-мейкером в соответствии с действующими тарифами ПАО Московская Биржа, Банка НКЦ (АО) и ЗАО «ФБ ММВБ» по Пассивным сделкам РЕПО с Инструментами, заключенным Маркет-мейкером в этом Отчетном периоде.