

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 ПАО Московская Биржа 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 - EQRП) 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 | АК «АЛРОСА» (ПАО) | ALRS | 28 000 | 1,0 % | 84 000 | 4 час. 48 мин. |
| 2 | ПАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК" | CBOM | 35 000 | 1,0 % | 105 000 | 4 час. 48 мин. |
| 3 | ПАО «Северсталь» | CHMF | 45 000 | 1,0 % | 135 000 | 4 час. 48 мин. |
| 4 | ПАО «Газпром» | GAZP | 65 000 | 1,0 % | 195 000 | 4 час. 48 мин. |
| 5 | ПАО «ГМК «Норильский Никель» | GMKN | 11 000 | 1,0 % | 33 000 | 4 час. 48 мин. |
| 6 | ПАО "Интер РАО" | IRAO | 47 000 | 1,0 % | 141 000 | 4 час. 48 мин. |
| 7 | ПАО «ЛУКОЙЛ» | LKOH | 35 000 | 1,0 % | 105 000 | 4 час. 48 мин. |
| 8 | ПАО «Магнит» | MGNT | 9 000 | 1,0 % | 27 000 | 4 час. 48 мин. |
| 9 | ПАО Московская Биржа | MOEX | 45 000 | 1,0 % | 135 000 | 4 час. 48 мин. |
| 10 | ПАО «МТС» | MTSS | 20 000 | 1,0 % | 60 000 | 4 час. 48 мин. |
| 11 | ПАО «НЛМК» | NLMK | 25 000 | 1,0 % | 75 000 | 4 час. 48 мин. |
| 12 | ОАО «НОВАТЭК» | NVTK | 50 000 | 1,0 % | 150 000 | 4 час. 48 мин. |
| 13 | ПАО "ПИК СЗ" | PIKK | 15 000 | 1,0 % | 45 000 | 4 час. 48 мин. |
| 14 | ПАО "Полус" | PLZL | 9 000 | 1,0 % | 27 000 | 4 час. 48 мин. |
| 15 | ОАО «НК «Роснефть» | ROSN | 300 000 | 1,0 % | 900 000 | 4 час. 48 мин. |
| 16 | МКПАО "ОК РУСАЛ" | RUAL | 40 000 | 1,0 % | 120 000 | 4 час. 48 мин. |
| 17 | ПАО Сбербанк | SBER | 90 000 | 1,0 % | 270 000 | 4 час. 48 мин. |
| 18 | ПАО Сбербанк ап | SBERP | 21 000 | 1,0 % | 63 000 | 4 час. 48 мин. |
| 19 | ОАО «Сургутнефтегаз» | SNGS | 20 000 | 1,0 % | 60 000 | 4 час. 48 мин. |
| 20 | ОАО «Сургутнефтегаз» ап | SNGSP | 17 000 | 1,0 % | 51 000 | 4 час. 48 мин. |
| 21 | ПАО «Татнефть» им. В.Д. Шашина | TATN | 107 000 | 1,0 % | 321 000 | 4 час. 48 мин. |
| 22 | ПАО «Татнефть» им. В.Д. Шашина ап | TATNP | 35 000 | 1,0 % | 105 000 | 4 час. 48 мин. |
| 23 | ПАО «Транснефть» ап | TRNFP | 700 | 1,0 % | 2 100 | 4 час. 48 мин. |
| 24 | Банк ВТБ (ПАО) | VTBR | 150 000 | 1,0 % | 450 000 | 4 час. 48 мин. |
| 25 | Yandex N.V. | YNDX | 35 000 | 1,0 % | 105 000 | 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. Если в Торговый день всем Маркет-мейкерам по настоящей Программе не предоставлена возможность выполнять обязательства в течение всего периода времени, определенного в столбце 7 Таблицы, содержащейся в п.2.2 настоящей Программы, то такой Торговый день не включается в количество Торговых дней Отчетного периода.

2.7. 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:

$$PB = 0,5 * KB$$

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 и НКО НКЦ (АО) по Пассивным сделкам РЕПО с Инструментами, заключенным Маркет-мейкером в этом Отчетном периоде.