

УТВЕРЖДЕНЫ

решением Наблюдательного совета
ПАО Московская Биржа
29 декабря 2022 г., Протокол № 13

ПРАВИЛА
проведения торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов
Публичного акционерного общества
«Московская Биржа ММВБ–РТС»

Часть IV. Секция рынка депозитов

ОГЛАВЛЕНИЕ

Подраздел 1.1. Общие положения	3
Подраздел 1.2. Заявки.....	3
Подраздел 1.3. Условия принятия заявок к регистрации	7
Подраздел 1.4. Порядок заключения депозитных договоров.....	7
Подраздел 1.5. Алгоритмические пакеты заявок	12

Подраздел 1.1. Общие положения

1.1.1. Настоящая часть IV Секция рынка депозитов (далее – настоящая часть Правил торгов) является неотъемлемой частью Правил проведения торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Публичного акционерного общества «Московская Биржа ММВБ-РТС» и принята в соответствии с Уставом Биржи, законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

1.1.2. Настоящая часть Правил торгов в дополнение к Общей части Правил торгов устанавливает особенности проведения торгов в Секции рынка депозитов.

1.1.3. Торги в ходе Основной торговой сессии и Дополнительной торговой сессии на условиях централизованного клиринга могут проводиться в следующих Режимах торгов:

- Режим торгов «Депозиты с ЦК – Безадресные заявки»;
- Режим торгов «Депозиты с ЦК – Адресные заявки»;
- Режим торгов «Депозиты с ЦК – Аукцион».

1.1.4. Процентной ставкой по депозитному договору может быть положительная величина, выраженная в процентах годовых, указываемая Участником торгов в заявке Депозиты (ЦК), используемая в Секции рынка депозитов для расчета суммы возврата депозита. Если иное не установлено решением Биржи, допускается указание в качестве процентной ставки индикативной ставки, выступающей в качестве базы для расчета процентной ставки в совокупности с величиной отклонения от такой индикативной ставки в процентах годовых (Плавающая ставка). В Режимах торгов «Депозиты с ЦК – Безадресные заявки» и «Депозиты с ЦК – Адресные заявки» возможные значения индикативной ставки устанавливаются решением Биржи, при этом процентной ставкой в заключенной сделке является сумма индикативной ставки и величины отклонения от неё, указываемой Участником торгов при подаче заявки.

Подраздел 1.2. Заявки

1.2.1. В торгах в Секции рынка депозитов могут принимать участие только Участники торгов рынка депозитов и Центральный контрагент. Участник торгов рынка депозитов имеет право подавать следующие виды заявок на заключение сделок в Систему торгов (если иное не установлено решением Биржи):

- лимитные заявки Депозиты (ЦК);
- рыночные заявки Депозиты (ЦК);
- адресные заявки Депозиты (ЦК);

1.2.2. На основании заявок, подаваемых в ходе торгов в Секции рынка депозитов, могут быть заключены сделки только с Центральным контрагентом.

1.2.3. Лимитные заявки Депозиты (ЦК) с признаком «Поставить в очередь» являются заявками с сохранением в котировках. Лимитные заявки Депозиты (ЦК) с признаками «Снять остаток» или «Полностью или отклонить» являются заявками без сохранения в котировках.

1.2.4. В зависимости от вида заявки при ее подаче в Систему торгов указываются следующие реквизиты:

1.2.4.1. Условия заключения сделок в Режиме торгов «Депозиты с ЦК – Безадресные заявки» предусмотрены подразделом 1.4 «Порядок заключения депозитных договоров» настоящей части Правил торгов.

В лимитной заявке Депозиты (ЦК) должны быть указаны следующие реквизиты:

- вид заявки (лимитная заявка Депозиты (ЦК));
- идентификатор Участника торгов рынка депозитов;
- код Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на заключение

депозитного договора за счет средств, находящихся в доверительном управлении);

- направленность заявки (только заявка на размещение денежных средств);
- сумма депозита (объем денежных средств, указанных в заявке) в валюте депозита;
- процентная ставка (минимальная ставка размещения денежных средств) в процентах годовых. Или отклонение от индикативной ставки (минимальное значение отклонения для размещения денежных средств), в процентах годовых, в случае заявки на заключение депозитного договора с Плавающей ставкой;
- наименование, код ценной бумаги, заявка на заключение сделки РЕПО с которой может быть признана допустимой встречной, либо код Корзины ценных бумаг (совокупность ценных бумаг, указание которой допускается в заявке, подаваемой в Режиме торгов «Депозиты с ЦК – Аукцион», состав Корзины устанавливается Биржей);
- код расчетов (Y_m/Y_n , где m может принимать значение от 0 до 2, а n может принимать значения 1D, 1W, 2W, 5W, 1M, 2M, 3M, 6M, 9M, 12M, 18M, 24M, 30M, 36M, если иное не установлено решением Биржи), определяющий дату возврата депозита;
- торгово-клиринговый счет;
- ПЭП Участника торгов рынка депозитов.

Допускается подача в Систему торгов лимитной заявки Депозиты (ЦК) с указанием дополнительных признаков, уточняющих особенности заключения сделок по типу исполнения заявки по остатку, в соответствии с Общей частью Правил торгов.

В лимитных заявках, подаваемых в Режиме торгов «Депозиты с ЦК – Аукцион», дополнительно указывается время в течение текущего торгового дня в формате «ЧЧ:ММ:СС», с которого возможно заключение сделок на основании данной заявки (далее – время активации заявки).

В случае регистрации в Системе торгов лимитной заявки Депозиты (ЦК) с признаком «Полностью или отклонить» допустимыми встречными заявками являются лимитные и рыночные заявки РЕПО (ЦК), подаваемые Участниками торгов в Секции рынка РЕПО на заключение сделок с ценной бумагой, указанной в заявке на заключение депозитного договора, валютой Суммы РЕПО, совпадающей с валютой депозита, противоположной направленности, начиная с лучших Ставок РЕПО (отклонений от индикативной ставки), со Ставками РЕПО (отклонениями от индикативной ставки) не меньшими, чем процентная ставка в заявке на заключение депозитного договора, указанная в данной заявке, и совокупная Сумма РЕПО которых не меньше указанной в подаваемой заявке суммы депозита. В случае регистрации в Системе торгов лимитной заявки Депозиты (ЦК) в режиме торгов «Депозиты с ЦК – Аукцион» допустимыми встречными заявками к ней являются лимитные заявки РЕПО (ЦК), подаваемые Участниками торгов в Секции рынка РЕПО в Режиме торгов «Аукцион РЕПО с ЦК» на заключение сделок с ценной бумагой, входящей в состав Корзины ценных бумаг, указанной в заявке на заключение депозитного договора, валютой Суммы РЕПО, совпадающей с валютой депозита, противоположной направленности, начиная с лучших Ставок РЕПО, со Ставками РЕПО не меньшими, чем процентная ставка в заявке на заключение депозитного договора, указанная в данной заявке. Допустимыми встречными заявками по отношению к лимитной заявке Депозиты (ЦК) с указанием иных признаков являются лимитные и рыночные заявки РЕПО (ЦК), подаваемые Участниками торгов в Секции рынка РЕПО на заключение сделок с ценной бумагой, указанной в заявке на заключение депозитного договора, противоположной направленности, начиная с лучших Ставок РЕПО (отклонений от индикативной ставки), со Ставками РЕПО (отклонениями от индикативной ставки) не меньшими, чем процентная ставка в заявке на заключение депозитного договора, указанная

в данной заявке.

Во всех вышеперечисленных случаях заявки РЕПО (ЦК), подаваемые Участником торгов категории «В», в целях исполнения обязательства по возврату Участнику клиринга части суммы депозита при исполнении Заявления на изменение суммы депозита в порядке, установленном Правилами клиринга, не являются допустимыми встречными заявками к заявке на заключение депозитного договора.

В дополнение к реквизитам, предусмотренным в настоящем пункте, при подаче лимитной заявки Депозиты (ЦК) допускается указание дополнительного реквизита: «видимая часть заявки». Решением Биржи для отдельных периодов торгов и/или Режимов торгов указание такого дополнительного реквизита может быть запрещено. Такой подвид лимитной заявки Депозиты (ЦК) в целях настоящей части Правил торгов именуется «айсберг-заявка». Дополнительный реквизит «видимая часть заявки» указывается в процентах от суммы депозита.

Участникам торгов в очереди заявок раскрывается информация об установленной при подаче заявки «видимой части заявки» в виде рассчитанного при подаче такой заявки значения «видимой суммы депозита», оставшаяся сумма депозита не раскрывается Участникам торгов в очереди заявок, т.е. является скрытой (далее – «скрытая часть заявки»). «Видимая сумма депозита», указанная в заявке, не может быть меньше минимального значения суммы депозита, установленного Биржей.

Решением Биржи может устанавливаться, что айсберг-заявка отклоняется при подаче, если нарушены минимальное допустимое значение «видимой части заявки», максимальное допустимое значение «видимой части заявки», установленные Биржей, а также нарушено установленное Биржей значение минимальной суммы депозита для айсберг-заявки.

Для айсберг-заявки возможна подача в Систему торгов заявки с указанием следующих дополнительных признаков, уточняющих особенности заключения сделок по типу исполнения заявки:

по остатку:

- «Поставить в очередь»;

по цене:

- «По одной цене»;
- «По разным ценам».

В рыночной заявке Депозиты (ЦК) должны быть указаны следующие реквизиты:

- вид заявки (рыночная заявка Депозиты (ЦК));
- идентификатор Участника торгов рынка депозитов;
- код Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на заключение депозитного договора за счет средств, находящихся в доверительном управлении);
- направленность заявки (только заявка на размещение денежных средств);
- сумма депозита (объем денежных средств, указанных в заявке) в валюте депозита;
- наименование, код ценной бумаги, заявка на заключение сделки РЕПО с которой может быть признана допустимой встречной;
- код расчетов (Y_m/Y_n , где m может принимать значение от 0 до 2, а n может принимать значения 1D, 1W, 2W, 5W, 1M, 2M, 9M, 3M, 6M, 12M, 18M, 24M, 30M, 36M, если иное не установлено решением Биржи);
- торгово-клиринговый счет;
- ПЭП Участника торгов рынка депозитов.

При подаче рыночной заявки Депозиты (ЦК) указание каких-либо

дополнительных признаков не допускается. В случае регистрации в Системе торговых рыночной заявки Депозиты (ЦК) допустимыми встречными заявками по отношению к ней являются лимитные заявки РЕПО (ЦК), подаваемые Участниками торгов в Секции рынка РЕПО на заключение сделок с ценной бумагой, указанной в заявке на заключение депозитного договора, валютой Суммы РЕПО, совпадающей с валютой депозита, противоположной направленности, стоящие в очереди, начиная с максимальной Ставки РЕПО (отклонения от индикативной ставки).

1.2.4.2. Условия заключения сделок в Режиме торгов «Депозиты с ЦК – Адресные заявки», предусмотрены подразделом 1.4 «Порядок заключения депозитных договоров» настоящей части Правил торгов.

В адресной заявке Депозиты (ЦК) в Режиме торгов «Депозиты с ЦК – Адресные заявки» должны быть указаны следующие реквизиты:

- вид заявки (адресная заявка Депозиты (ЦК));
- идентификатор Участника торгов рынка депозитов, подавшего заявку;
- код Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на заключение депозитного договора за счет средств, находящихся в доверительном управлении);
- краткое наименование Участника торгов рынка депозитов, подавшего заявку;
- краткое наименование или идентификатор Участника торгов, заявка которого может быть признана допустимой встречной, если иное не определено решением Биржи;
- направленность заявки (только заявка на размещение денежных средств);
- процентная ставка в процентах годовых. Или отклонение от индикативной ставки в процентах годовых, в случае заявки на заключение депозитного договора с Плавающей ставкой;
- торгово-клиринговый счет;
- код расчетов (Ym/Yn , где m может принимать значение от 0 до 2, а n может принимать значения от 1 до 365/366, если иное не установлено решением Биржи);
- сумма депозита (объем денежных средств, указанных в заявке) в валюте депозита;
- наименование, код ценной бумаги, заявка на заключение сделки РЕПО с которой может быть признана допустимой встречной;
- ПЭП Участника торгов рынка депозитов.

Допустимой встречной заявкой к заявке на заключение депозитного договора в Режиме торгов «Депозиты с ЦК – Адресные заявки» является адресная заявка РЕПО (ЦК), поданная Участником торгов в Секции рынка РЕПО и адресованная центральному контрагенту, на заключение сделки РЕПО противоположной направленности со следующими совпадающими условиями:

- процентная ставка (отклонение от индикативной ставки) совпадает со Ставкой РЕПО (отклонением от индикативной ставки);
- сумма депозита совпадает с Суммой РЕПО;
- валюта депозита совпадает с валютой Суммы РЕПО;
- краткое наименование или идентификатор Участника торгов рынка депозитов, заявка которого может быть признана допустимой встречной;
- наименование, код ценной бумаги, заявка на заключение сделки РЕПО с которой может быть признана допустимой встречной;
- код расчетов.

1.2.5. Допускается заключение соответствующей сделки РЕПО и принятие Центральным контрагентом обязательства по обеспечению условий для заключения депозитного договора в отношении части суммы депозита, определенной в соответствии с

условиями заявки (частичное исполнение заявки), в лимитных заявках Депозиты (ЦК) с указанием признака «Поставить в очередь». В случае частичного исполнения такой заявки сумма депозита, указанная в частично исполненной заявке, уменьшается на сумму депозита, в отношении которой была заключена соответствующая сделка РЕПО и Центральным контрагентом было принято обязательство по обеспечению условий для заключения депозитного договора.

1.2.6. Подача в Систему торгов лимитной заявки Депозиты (ЦК), рыночной заявки Депозиты (ЦК), адресной заявки Депозиты (ЦК) означает безоговорочное согласие Участника торгов рынка депозитов заключить депозитный договор с Центральным контрагентом на условиях, не хуже указанных в такой заявке.

1.2.7. Если лимитная заявка Депозиты (ЦК) с сохранением в котировках удовлетворяется не полностью, то она (в размере неисполненной части) ставится в очередь.

1.2.8. Если лимитная заявка Депозиты (ЦК) без сохранения в котировках удовлетворяется не полностью, то ее неисполненная часть снимается с торгов (если решением Биржи и/или настоящей частью Правил торгов не определено иное).

Подраздел 1.3. Условия принятия заявок к регистрации

1.3.1. Следующие виды заявок, подаваемые Участником торгов рынка депозитов, регистрируются в Системе торгов только после получения Биржей от Клиринговой организации отчета о возможности регистрации заявки:

- лимитная заявка Депозиты (ЦК);
- рыночная заявка Депозиты (ЦК);
- адресная заявка Депозиты (ЦК).

1.3.2. Заявки на заключение депозитного договора, процентная ставка (отклонение от индикативной ставки) в которых превышает предельные границы процентных ставок (отклонений от индикативной ставки), установленные Биржей, в Системе торгов не регистрируются.

1.3.3. Заявки, поданные с указанием типа торгово-клирингового счета, на использование которого решением Биржи на основании информации Клиринговой организации установлены ограничения в Секции рынка депозитов и/или определенных Режимах торгов (периодах), в Системе торгов не регистрируются.

1.3.4. При подаче Участником торгов рынка депозитов заявки на заключение депозитного договора данная заявка не регистрируется в Системе торгов в случае, если код Участника торгов рынка депозитов, указанный в заявке, не соответствует ни одному из кодов Участника торгов рынка депозитов, присвоенных на Бирже Участнику торгов рынка депозитов.

1.3.5. Биржа вправе в порядке и сроки, предусмотренные договором между Участником торгов рынка депозитов и Техническим центром, в ходе торгов снимать заявки, поданные Участником торгов рынка депозитов, информация по которым не была занесена в реестр предложений на момент снятия заявок.

Подраздел 1.4. Порядок заключения депозитных договоров

1.4.1. Заключение депозитных договоров с Центральным контрагентом осуществляется в Режимах торгов «Депозиты с ЦК – Безадресные заявки», «Депозиты с ЦК – Адресные заявки» и «Депозиты с ЦК – Аукцион» в торговые дни, устанавливаемые в соответствии с Общей частью Правил торгов. Заключение депозитных договоров приостанавливается/прекращается в случаях, предусмотренных Правилами торгов и Правилами клиринга.

1.4.2. Срок депозитного договора определяется в реестре сделок в соответствии с Кодом расчётов и датой возврата депозита. В случаях, определенных в Правилах клиринга, допускается изменение суммы депозита по заключенному депозитному договору. Порядок и условия таких изменений определяются Правилами клиринга.

1.4.3. Проценты на сумму депозита рассчитываются в соответствии с процентной ставкой депозитного договора, зафиксированной в реестре сделок, и выплачиваются в дату возврата депозита вместе с суммой депозита. В случае изменения суммы депозита по заключенному депозитному договору, размер процентов на сумму депозита определяется в соответствии с Правилами клиринга, исходя из фактического срока депозитного договора и фактической суммы депозита.

1.4.4. Для заявок на заключение депозитных договоров, в том числе для отдельных Режимов торгов, Биржей могут устанавливаться возможные предельные значения, включая точность указания, следующих реквизитов:

- процентная ставка (отклонение от индикативной ставки);
- сумма депозита (объем денежных средств, указанных в заявке);
- предельные значения суммы депозита (объема денежных средств, указанных в заявке) в заявке для отдельного кода расчетов.

1.4.5. В Режиме торгов «Депозиты с ЦК – Безадресные заявки» в Систему торгов подаются лимитные заявки Депозиты (ЦК) и рыночные заявки Депозиты (ЦК). В Режиме торгов «Депозиты с ЦК – Адресные заявки» в Систему торгов подаются адресные заявки Депозиты (ЦК).

1.4.6. В Режиме торгов «Депозиты с ЦК – Безадресные заявки» и «Депозиты с ЦК – Адресные заявки» принимают участие заявки, поданные Участниками торгов рынка депозитов в ходе торгового периода текущего торгового дня в данном Режиме торгов (если решением Биржи не установлено иное). Участник торгов рынка депозитов имеет право подавать в Систему торгов неограниченное количество таких заявок.

1.4.7. В Режиме торгов «Депозиты с ЦК – Аукцион» принимают участие заявки, поданные Участниками торгов рынка депозитов категории «К» и категории «Р» в ходе аукциона по размещению денежных средств в депозиты.

1.4.8. Подача заявки на заключение депозитного договора Участником торгов рынка депозитов и принятие Центральным контрагентом обязательства по обеспечению условий для заключения депозитного договора по данной заявке означают, что Участник торгов рынка депозитов и Центральный контрагент соглашаются с тем, что Центральный контрагент сообщает Бирже размер доступных для размещения в депозит денежных средств по такой заявке и, в случае если денежных средств недостаточно для заключения депозитного договора в размере суммы депозита, указанной в заявке (за исключением депозитного договора со сроком 1 день), Центральный контрагент оказывает Участнику торгов рынка депозитов услугу по обеспечению условий для заключения депозитного договора в недостающей части в расчетный день, следующий за днем, определенным кодом расчетов для заключения депозитного договора. Одновременно Участник торгов рынка депозитов соглашается выплатить Центральному контрагенту вознаграждение за оказание такой услуги в размере и порядке, определенных в Правилах клиринга. В расчетный день, следующий за днем, определенным кодом расчетов для заключения депозитного договора, Центральный контрагент сообщает Бирже о размере денежных средств, доступных для размещения денежных средств в депозит по такой заявке в части, в которой депозитный договор не был заключен в день, определенный кодом расчетов для заключения депозитного договора.

1.4.9. При подаче заявки на заключение депозитного договора со сроком 1 день Участник торгов рынка депозитов одновременно принимает на себя следующие дополнительные обязательства перед Центральным контрагентом:

- а) не позднее расчетного дня, определенного кодом расчетов для заключения депозитного договора, предоставить в порядке, определенном Правилами клиринга, обеспечение в размере суммы депозита (объеме денежных средств, указанном в заявке);
- б) не позднее расчетного дня, следующего за днем, определенным кодом расчетов для заключения депозитного договора, обеспечить наличие денежных средств в

количестве, достаточном для уплаты отступного в случае отказа от исполнения обязательства, указанного в пп. «а» настоящего пункта.

Участник торгов рынка депозитов, за исключением Участника торгов категории «К», и Центральный контрагент соглашаются, что в случае отказа Участника торгов рынка депозитов от принятых на себя обязательств по пп. «а» настоящего пункта Участник торгов рынка депозитов взамен исполнения указанного обязательства предоставляет Центральному контрагенту отступное в сумме денежных средств, порядок определения которого определяется Правилами клиринга. С момента предоставления отступного обязательства Участника торгов рынка депозитов в соответствии с пп. «а» настоящего пункта прекращаются полностью. Моментом предоставления отступного является момент уменьшения суммы денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения по соответствующему Расчетному коду Участника торгов рынка депозитов в Клиринговой системе Клиринговой организации, на сумму отступного. Порядок уплаты отступного устанавливается Правилами клиринга.

1.4.10. При подаче заявки на заключение депозитного договора, за исключением заявки на заключение депозитного договора со сроком 1 день, Участник торгов рынка депозитов одновременно принимает на себя следующие дополнительные обязательства перед Центральным контрагентом:

- а) не позднее расчетного дня, следующего за днем, определенным кодом расчетов для заключения депозитного договора, предоставить в порядке, определенном Правилами клиринга, обеспечение в размере суммы депозита (объеме денежных средств, указанном в заявке);
- б) не позднее второго расчетного дня, следующего за днем, определенным кодом расчетов для заключения депозитного договора, обеспечить наличие денежных средств в количестве, достаточном для уплаты отступного в случае отказа от исполнения обязательства, указанного в пп. «а» настоящего пункта.

Участник торгов рынка депозитов, за исключением Участника торгов категории «К», и Центральный контрагент соглашаются, что в случае отказа Участника торгов рынка депозитов от принятых на себя обязательств по пп. «а» настоящего пункта Участник торгов рынка депозитов взамен исполнения указанного обязательства предоставляет Центральному контрагенту отступное в сумме денежных средств, порядок определения которого определяется Правилами клиринга. С момента предоставления отступного обязательства Участника торгов рынка депозитов в соответствии с пп. «а» настоящего пункта прекращаются полностью. Моментом предоставления отступного является момент уменьшения суммы денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения по соответствующему Расчетному коду Участника торгов рынка депозитов в Клиринговой системе Клиринговой организации, на сумму отступного. Порядок уплаты отступного устанавливается Правилами клиринга.

1.4.11. В ходе торгов в Режимх торгов «Депозиты с ЦК – Безадресные заявки», «Депозиты с ЦК – Аукцион» и «Депозиты с ЦК – Адресные заявки»:

1.4.11.1. При регистрации заявки/заключении депозитного договора рассчитывается сумма возврата депозита исходя из условий, указанных в заявке на заключение депозитного договора, по следующей формуле:

$$S_2 = S_1 * \left(1 + \frac{R}{100} * \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right) \right), \text{ где}$$

S_2 – Сумма возврата депозита;

S_1 – Сумма депозита;

R – процентная ставка;

T_{365} – число дней между плановой/фактической датой заключения депозитного договора (не включая эту дату) и датой возврата депозита (включая эту дату), приходящихся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T_{366} – число дней между плановой/фактической датой заключения депозитного договора (не включая эту дату) и датой возврата депозита (включая эту дату), приходящихся на календарный год, состоящий из 366 дней.

Если иное не определено решением Биржи, при регистрации заявки/заключении депозитного договора с Плавающей ставкой сумма возврата депозита не рассчитывается.

В случае изменений условий договора в соответствии с Правилами клиринга, в том числе в случае заключения договора на основании Заявления об объединении заявок на заключение депозитных договоров, изменения суммы депозита по заключенному депозитному договору, условия договора определяются в соответствии с Правилами клиринга. Депозитный договор, заключаемый на условиях, определенных Правилами клиринга, также считается заключенным в соответствии с пп. 1.2.10.2 Общей части Правил торгов.

1.4.12. Торги в Режиме торгов «Депозиты с ЦК – Безадресные заявки» проводятся с учетом следующих особенностей:

1.4.12.1. Принятие Центральным контрагентом обязательства по обеспечению условий для заключения депозитного договора и заключение соответствующей сделки РЕПО по лимитным заявкам Депозиты (ЦК) и рыночным заявкам Депозиты (ЦК) осуществляются с учетом особенностей, определенных Общей частью Правил торгов, а также подразделом 1.2 «Заявки» настоящей части Правил торгов.

1.4.12.2. Принятие Центральным контрагентом обязательства по обеспечению условий для заключения депозитного договора и заключение соответствующей сделки РЕПО по лимитной заявке Депозиты (ЦК) или рыночной заявке Депозиты (ЦК) осуществляются при пересечении значения процентной ставки (отклонения от индикативной ставки) депозитного договора, указанной в такой заявке, со значением Ставки РЕПО (отклонения от индикативной ставки), указанным(и) в допустимой(ых) встречной(ых) заявке(ах) противоположной направленности на заключение сделки РЕПО, зарегистрированной(ых) в Системе торгов. Пересечение значений ставок (отклонений от индикативной ставки) имеет место для поданной заявки на заключение депозитного договора при наличии заявок на заключение сделок РЕПО на привлечение денежных средств со Ставками РЕПО (отклонениями от индикативной ставки) не меньшими, чем процентная ставка (отклонение от индикативной ставки), которая указана в поданной заявке на заключение депозитного договора.

1.4.12.3. Удовлетворение айсберг-заявок осуществляется в порядке, установленном для удовлетворения иных лимитных заявок Депозиты (ЦК), с учетом следующих особенностей расчета «текущей видимой суммы депозита»:

1.4.12.3.1. При подаче заявки значение «текущей видимой суммы депозита» совпадает с рассчитанной при подаче заявки «видимой суммой депозита».

1.4.12.3.2. Если Сумма РЕПО, указанная в допустимой встречной заявке, меньше «текущей видимой суммы депозита», то:

- Принятие Центральным контрагентом обязательства по обеспечению условий для заключения депозитного договора и заключение соответствующей сделки РЕПО осуществляются исходя из Суммы РЕПО, указанной в допустимой встречной заявке.

- Новое значение «текущей видимой суммы депозита» рассчитывается как разность действовавшей в момент расчета «текущей видимой суммы депозита» и Суммы РЕПО, указанной в допустимой встречной заявке.

1.4.12.3.3. Если Сумма РЕПО, указанная в допустимой встречной

заявке, равна «текущей видимой сумме депозита», то:

- Принятие Центральным контрагентом обязательства по обеспечению условий для заключения депозитного договора и заключение соответствующей сделки РЕПО осуществляются исходя из Суммы РЕПО, указанной в допустимой встречной заявке.

- Новое значение «текущей видимой суммы депозита» устанавливается равным рассчитанной при подаче заявки «видимой сумме депозита».

1.4.12.3.4. Если Сумма РЕПО, указанная в допустимой встречной заявке, больше «текущей видимой суммы депозита», то:

- Принятие Центральным контрагентом обязательства по обеспечению условий для заключения депозитного договора и заключение соответствующих сделок РЕПО осуществляются в несколько этапов исходя из Суммы РЕПО, указанной в допустимой встречной заявке, и «текущей видимой суммы депозита» в айсберг-заявке. После удовлетворения «текущей видимой суммы депозита» в айсберг-заявке встречная заявка (при ее достаточном объеме) последовательно удовлетворяет все иные находящиеся в очереди активные заявки по данной Ставке РЕПО/процентной ставке (отклонению от индикативной ставки) (в случае их наличия), до тех пор пока не доходит снова до данной айсберг-заявки. Дальше цикл удовлетворения повторяется до тех пор, пока либо не заканчивается объем встречной заявки, или айсберг-заявка полностью не удовлетворится. Сумма депозита, по которой на основании айсберг-заявки и допустимой встречной заявки Центральным контрагентом приняты обязательства по обеспечению условий для заключения депозитного договора и заключены соответствующие сделки РЕПО, для каждой айсберг-заявки составляет сумму депозита, определенную суммарно с учетом всех этапов удовлетворения соответствующей айсберг-заявки (прохождений цикла удовлетворения заявки).

1.4.12.3.5. Новое значение «текущей видимой суммы депозита» в айсберг-заявке, при полном удовлетворении «текущей видимой суммы депозита», на каждом новом этапе устанавливается равным «видимой сумме депозита», рассчитанной при подаче айсберг-заявки (в случае если остаток по айсберг-заявке меньше «видимой суммы депозита», рассчитанной при подаче данной заявки, «текущая видимая сумма депозита» устанавливается в размере остатка по айсберг-заявке).

1.4.12.4. Во время торгов в Режиме торгов «Депозиты с ЦК – Безадресные заявки» Участник торгов рынка депозитов имеет доступ к информации о собственных заявках, а также о заявках с двадцатью лучшими процентными ставками (Ставками РЕПО) (отклонениями от индикативной ставки), находящихся в очереди в Системе торгов, в части указанной в них процентной ставки (Ставки РЕПО) (отклонении от индикативной ставки), и совокупной сумме депозитов (Сумме РЕПО) по заявкам на заключение депозитного договора (по заявкам на заключение сделок РЕПО с Центральным контрагентом) в разрезе процентных ставок (отклонений от индикативной ставки).

1.4.12.5. Заявки, не удовлетворенные в ходе торгового периода, снимаются с торгов Биржей.

1.4.13. Заключение депозитных договоров в режиме торгов «Депозиты с ЦК – Аукцион» осуществляется в следующем порядке:

1.4.13.1. Принятие Центральным контрагентом обязательства по обеспечению условий для заключения депозитного договора и заключение соответствующей сделки РЕПО по лимитным заявкам Депозиты (ЦК) осуществляются с учетом особенностей, определенных Общей частью Правил торгов, а также подразделом 1.2 «Заявки» настоящей части Правил торгов.

1.4.13.2. Принятие Центральным контрагентом обязательства по обеспечению условий для заключения депозитного договора и заключение соответствующих сделок РЕПО по лимитной заявке Депозиты (ЦК) осуществляются в момент активации заявки на заключение депозитного договора при пересечении значения процентной ставки депозитного договора, указанного в такой заявке, со значением(ями)

Ставки РЕПО, указанным(и) в допустимой(ых) встречной(ых) заявке(ах) противоположной направленности на заключение сделки РЕПО, зарегистрированной(ых) в Системе торгов. Пересечение значений ставок имеет место для поданной заявки на заключение депозитного договора при наличии заявок на заключение сделок РЕПО на привлечение денежных средств со Ставками РЕПО не меньшими, чем процентная ставка, которая указана в поданной заявке на заключение депозитного договора.

1.4.13.3. В режиме торгов «Депозиты с ЦК – Аукцион» подаются лимитные заявки Депозиты (ЦК) без сохранения в котировках, с указанием времени активации заявки. В режиме торгов «Депозиты с ЦК – Аукцион» не допускается подача айсберг-заявок (если иное не определено решением Биржи).

1.4.13.4. Если иное не определено решением Биржи, во время торгов в Режиме торгов «Депозиты с ЦК – Аукцион» Участник торгов рынка депозитов имеет доступ к информации о собственных заявках, а также об активных заявках с двадцатью лучшими процентными ставками (Ставками РЕПО), которые могут быть признаны допустимыми встречными к заявкам Участника торгов рынка депозитов, в части указанной в них процентной ставки (Ставки РЕПО), и совокупной сумме депозитов (Сумме РЕПО) по заявкам на заключение депозитного договора (по заявкам на заключение сделок РЕПО с Центральным контрагентом) в разрезе процентных ставок.

1.4.14. Заключение депозитных договоров в Режиме торгов «Депозиты с ЦК – Адресные заявки» осуществляется в следующем порядке:

1.4.14.1. Принятие Центральным контрагентом обязательства по обеспечению условий для заключения депозитного договора и заключение соответствующих сделок РЕПО по адресным заявкам Депозиты (ЦК) осуществляются с учетом особенностей, определенных Общей частью Правил торгов, а также подразделом 1.2 «Заявки» настоящей части Правил торгов.

1.4.14.2. При получении адресной заявки Депозиты (ЦК) в Режиме торгов «Депозиты с ЦК – Адресные заявки» Центральный контрагент вправе до окончания торгов в данном Режиме торгов (если решением Биржи не установлено иное) либо отклонить полученную заявку, либо заключить соответствующую сделку РЕПО и принять обязательства по обеспечению условий для заключения депозитного договора по данной заявке.

1.4.14.3. Участник торгов рынка депозитов во время торгов в Режиме торгов «Депозиты с ЦК – Адресные заявки» имеет доступ к информации только о собственных адресных заявках Депозиты (ЦК), а также о заявках, которые могут быть признаны допустимыми встречными к ним.

Подраздел 1.5. Алгоритмические пакеты заявок

1.5.1. Алгоритмический пакет заявок (пакет заявок) – подаваемое Участником торгов в Подсистеме обработки алгоритмических пакетов заявок Московской Биржи сообщение, содержащее количество заявок на размещение денежных средств на установленный Участником торгов совокупный объем с условием подачи заявок в Систему торгов Московской Биржи в течение заданного им периода времени.

Подсистема обработки алгоритмических пакетов заявок – совокупность программно-технических средств, представляющая собой подсистему программно-технического комплекса(ов) технического(их) центра(ов), предназначенную для подачи Участниками торгов алгоритмических пакетов заявок.

1.5.2. При создании алгоритмического пакета заявок Участник торгов указывает следующие реквизиты пакета заявок:

- интервал времени, в течение которого могут быть выставлены заявки, входящие в пакет заявок;
- идентификатор Участника торгов рынка депозитов;
- направленность заявки (только заявка на размещение денежных средств);

- валюта депозита;
- совокупная сумма депозита (объем денежных средств) в валюте депозита;
- минимальный остаток - минимальная сумма в валюте депозита, не меньше которой должно остаться на торгово-клиринговом счете по итогам подачи заявок, входящих в пакет заявок. Участник торгов может установить в качестве минимального остатка значение, которое может быть положительным или равняться 0;
- процентная ставка (минимальная ставка размещения денежных средств) в процентах годовых. Или отклонение от индикативной ставки (минимальное значение отклонения для размещения денежных средств), в процентах годовых, в случае заявки на заключение депозитного договора с Плавающей ставкой;
- код расчетов, соответствующий допустимым кодам расчета для подачи заявок на заключение депозитного договора, определяющий дату возврата депозита;
- торгово-клиринговый счет;
- ПЭП Участника торгов рынка депозитов.

Количество заявок, входящих в алгоритмический пакет заявок, рассчитывается Подсистемой обработки алгоритмических пакетов заявок следующим образом, если иное не определено решением Биржи:

$$N = \min\{10000; \frac{S}{m}\}, \text{ где}$$

N – количество заявок, входящих в пакет заявок,

$\min\{A; B\}$ – минимальное из 2 чисел A и B ,

S – сумма депозита в валюте депозита, указанного в алгоритмическом пакете заявок,

m - минимальная сумма, установленная для заявок на Рынке депозитов.

Алгоритмический пакет и каждая содержащаяся в нем заявка подписываются ПЭП.

Подавая в Подсистему обработки алгоритмических пакетов заявок подписанный ПЭП алгоритмический пакет заявок Участник торгов выражает не требующее дополнительного подтверждения согласие на подачу в Систему торгов заявок, содержащихся в алгоритмическом пакете заявок, начиная с момента начала и до окончания интервала, установленного в алгоритмическом пакете заявок, на установленных в нем условиях в соответствии с настоящими Правилами торгов.

1.5.3. При наступлении интервала времени, в течение которого могут быть выставлены заявки, входящие в алгоритмический пакет заявок, Подсистема обработки алгоритмических пакетов заявок проверяет выполнение следующих условий:

- Сумма депозита в валюте депозита, указанная в алгоритмическом пакете заявок, больше, чем сумма депозитных договоров, заключенных по итогам уже исполненных заявок, входящих в пакет заявок;
- Сумма средств на торгово-клиринговом счете, указываемом при подаче заявок, не меньше минимальной суммы депозита, установленной для заявок на Рынке Депозитов;
- Сумма средств на торгово-клиринговом счете, указываемом при подаче заявок, не меньше минимального остатка, указанного в алгоритмическом пакете заявок;
- Существует заявка на заключение сделки РЕПО, которая может быть признана допустимой встречной и процентная ставка (отклонение от индикативной ставки) в которой не меньше процентной ставки (отклонения от индикативной ставки) в процентах годовых, указанной в алгоритмическом пакете заявок

Сумма депозита, процентная ставка (отклонение от индикативной ставки), наименование, код ценной бумаги, заявка на заключение сделки РЕПО с которой может

быть признана допустимой встречной, в каждой заявке определяется Подсистемой обработки алгоритмических пакетов заявок при подаче соответствующей заявки в Систему торгов.

Если все условия выполнены, заявка на заключение депозитного договора подается в Систему торгов посредством Подсистемы обработки алгоритмических пакетов заявок в режиме «Депозиты с ЦК – Безадресные заявки» со следующими реквизитами:

- вид заявки (лимитная заявка Депозиты (ЦК));
- идентификатор Участника торгов рынка депозитов;
- направленность заявки (только заявка на размещение денежных средств);
- Признак «Снять остаток»;
- сумма депозита (объем денежных средств, указанных в заявке) в валюте депозита определяется как минимальное значение из:
 - суммы депозита, указанной в алгоритмическом пакете заявок, за вычетом суммы депозитных договоров, заключенных по итогам уже исполненных заявок, входящих в указанный пакет заявок и за вычетом возможной комиссии;
 - суммы средств на торгово-клиринговом счете за вычетом минимального остатка, указанном в алгоритмическому пакете заявок и за вычетом возможной комиссии;
 - максимальной суммы, установленной на Рынке депозитов;
- процентная ставка (отклонение от индикативной ставки) в процентах годовых, равная лучшей котировке для соответствующего срока и валюты, указанных в алгоритмическом пакете заявок, по ценной бумаги, заявка на заключение сделки РЕПО с которой может быть признана допустимой встречной;
- наименование, код ценной бумаги, заявка на заключение сделки РЕПО с которой может быть признана допустимой встречной, и по которой есть котировка, равная лучшей котировке для соответствующего срока и валюты, указанных в алгоритмическом пакете;
- код расчетов, соответствующий допустимым кодам расчета для подачи заявок на заключение депозитного договора, определяющий дату возврата депозита;
- торгово-клиринговый счет;
- ПЭП Участника торгов рынка депозитов;
- а также другие реквизиты заявки, необходимые для заключения депозитного договора.

При регистрации в Системе торгов заявка, поданная посредством Подсистемы обработки алгоритмических пакетов заявок, проходит все проверки, необходимые для регистрации заявок на заключение депозитных договоров в Системе торгов.

1.5.4. По истечению интервала времени, указанного в алгоритмическом пакете заявок, все заявки, созданные в Подсистеме обработки алгоритмических пакетов заявок и не поданные в Систему торгов, снимаются.

1.5.5. Срок действия алгоритмического пакета заявок, зарегистрированного в Системе торгов, ограничивается периодом времени, в течение которого заявки из алгоритмического пакета заявок должны подаваться в Системе торгов, в рамках времени торгов в Режиме торгов «Депозиты с ЦК – Безадресные заявки».

1.5.6. Срок действия алгоритмического пакета заявок может быть сокращен при условии, если все заявки, входящие в алгоритмический пакет заявок, были поданы в Систему торгов.

1.5.7. Участник торгов может снять алгоритмический пакет заявок. Процедура снятия пакета заявок происходит в следующем порядке:

- если все заявки из алгоритмического пакета заявок были поданы в Систему

торгов, Участник торгов информируется о невозможности снятия алгоритмического пакета заявок;

- если истек интервал, в течение которого могут быть поданы заявки, входящие в пакет заявок, Участник торгов информируется о невозможности снятия алгоритмического пакета заявок;
- во всех остальных случаях снимаются все неисполненные заявки, входящие в пакет заявок.

Заявки/алгоритмические пакеты заявок, поданные в Систему торгов/Подсистему обработки алгоритмических пакетов заявок с нарушением настоящих Правил торгов, в том числе в результате технических сбоев и/или ошибок в работе средств проведения торгов (включая сбои в работе программного обеспечения), программно-технических средств, информационно-коммуникационных средств связи, с помощью которых обеспечивается проведение организованных торгов, не регистрируются в Системе торгов/Подсистеме обработки алгоритмических пакетов заявок.

Депозитные договора, заключенные с нарушением настоящих Правил торгов, в т.ч. в результате технических сбоев и/или ошибок в работе средств проведения торгов (включая сбои в работе программного обеспечения), программно-технических средств, информационно-коммуникационных средств связи, с помощью которых обеспечивается проведение организованных торгов, могут быть признаны незаключенными.