УТВЕРЖДЕНЫ

Приказом ПАО Московская Биржа

№ МБ-П-2020- от.12.2020

Дополнительные условия проведения торгов НА РЫНКЕ ОБЛИГАЦИЙ ПАО Московская Биржа

В соответствии с Частью I. Общая часть (далее – Часть I Правил торгов) Правил проведения торгов на фондовом рынке и рынке депозитов Публичного акционерного общества «Московская Биржа ММВБ-РТС», утвержденных решением Наблюдательного совета 29 октября 2020 г. (Протокол № 11), Частью II. Секция фондового рынка (далее – Часть II Правил торгов) Правил проведения торгов на фондовом рынке и рынке депозитов Публичного акционерного общества «Московская Биржа ММВБ-РТС», утвержденных решением Наблюдательного совета 29 октября 2020 г. (Протокол № 11), Частью III. Секция рынка РЕПО (далее – Часть III Правил торгов) Правил проведения торгов на фондовом рынке и рынке депозитов Публичного акционерного общества «Московская Биржа ММВБ-РТС», утвержденных решением Наблюдательного совета 29 октября 2020 г. (Протокол № 11), (далее – Правила торгов) с даты вступления в силу Части I, Части II и Части III Правил торгов устанавливаются дополнительные условия проведения торгов на рынке облигаций ПАО Московская Биржа (далее – Условия).

1. В соответствии с п. 1.1.1 (1.1.1.19, 1.1.1.53), п. 1.2.7 – 1.2.9, п. 1.7.6, 1.7.9, п. 1.8.2, п. 1.8.3, п. 1.9.3 и п. 1.10.3 Части I Правил торгов, п. 1.2.6, п. 1.4.2, п. 1.4.3 (1.4.3.3), п. 1.4.4 (1.4.4.1), п. 1.5.4, п. 1.6.3, п. 1.11.1 – 1.11.4, п. 1.11.6, п.1.17.2, п. 1.17.3, п. 1.17.7, 1.19.1 Части II Правил торгов, п. 1.5.2 – 1.5.4, пп. 1.6.3.1 (1.6.3.1.6) и пп. 1.6.3.2 (1.6.3.2.5) Части III Правил торгов при проведении торгов на рынке облигаций устанавливаются следующие особенности:
   1. В случае, если эмиссионными документами предусмотрено начисление и выплата купонного (процентного) дохода и/или погашение части основного долга (амортизационные выплаты), в следующих Режимах торгов:

# «Междилерское РЕПО»,

# «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО»,

# «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка»,

# «РЕПО с Банком России: фикс.ставка»,

устанавливается следующий порядок и срок изменения суммы РЕПО по сделкам РЕПО с облигациями:

* + - По облигациям Эмитентов, с которыми у НКО АО 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 Биржей от НКО АО 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.

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 Биржа не осуществляет взаимодействие с НКО АО 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 в иностранной валюте, заключенных с облигациями в Режиме торгов «Междилерское РЕПО», уменьшается на величину начисленного купонного (процентного) дохода и/или на величину погашенной части основного долга (амортизационной выплаты) исходя из официального курса иностранной валюты по отношению к рублю, установленного Центральным банком Российской Федерации на дату начала следующего купонного периода по облигациям, определенной эмиссионными документами (на дату получения от НКО АО НРД информации о выплате такого дохода в случае, если с эмитентом облигаций у НКО АО НРД заключены договоры об оказании услуг платежного агента).

* 1. Доходность по облигациям внутренних облигационных займов Российской Федерации (далее – ОФЗ) рассчитывается в соответствии с Приложением А к настоящим Условиям.
  2. Для следующих ценных бумаг

|  |  |
| --- | --- |
| **Торговый код** | **Краткое наименование** |
| RU000A0JX132 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JV227 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JV235 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JV219 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JUCR3 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JUCS1 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JXXD3 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JXXE1 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JV763 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JV7A8 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A101D54 | ООО "ГТЛК-1520" |

при проведении торгов в Режиме торгов «РЕПО с ЦК: Адресные заявки» с расчетами в рублях РФ (для ООО «ГТЛК-1520» - с расчетами в рублях РФ, долларах США и евро) установить, что допустимым кодом расчетов является Ym/Yn (m = 0;1), означающий, что Датой исполнения первой части сделки РЕПО является дата, определяемая как Т+m, где Т - дата заключения сделки РЕПО, m – число расчетных дней, значение которого определяется первой цифрой кода расчетов, а Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО является дата, определяемая как Т+n, где Т - дата заключения сделки РЕПО, а n – число расчетных дней, значение которого определяется последней цифрой кода расчетов по сделке РЕПО и не превышает значение, равное количеству расчетных дней в течение 12 месяцев с даты заключения сделки РЕПО.

* 1. Список ценные бумаги, с которыми на торгах могут заключаться только сделки РЕПО, составляют облигаций, указанные в Таблице 3-О Приложения к настоящим Условиям.
  2. Торги в Режимах торгов «Режим основных торгов Т+» (далее – Режим основных торгов Т+), Режим торгов крупными пакетами облигаций, «РЕПО с ЦК – Адресные заявки», «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки», «РПС с ЦК», «Исполнение обязательств по Сделкам Т+: РПС», «Исполнение обязательств по Сделкам Т+: РЕПО» «Сектор ПИР - Режим основных торгов», Облигации Д – Режим основных торгов, Сектор ПИР – РПС с ЦК, Сектор ПИР – РПС, Облигации Д – РПС, Облигации Д – РПС с ЦК и Режиме переговорных сделок (РПС) проводятся с учетом следующих особенностей:
     1. Перечень облигаций, с которыми допускается заключение сделок в Режимах торгов «Режим основных торгов Т+», «Сектор ПИР - Режим основных торгов», Облигации Д – Режим основных торгов, «РЕПО с ЦК – Адресные заявки», «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки», «РПС с ЦК», Сектор ПИР – РПС с ЦК, Сектор ПИР – РПС, Облигации Д – РПС, Облигации Д – РПС с ЦК и Режиме переговорных сделок (РПС) предусмотрен в Таблице О-1 Приложения к настоящим Условиям.
     2. Для облигаций объем сделки и НКД рассчитываются на дату исполнения сделки, исходя из номинальной стоимости облигации на дату исполнения сделки, известной ПАО Московская Биржа на начало торгового дня даты заключения сделки. При этом в Режиме переговорных сделок (РПС) и в Режимах торгов «Облигации Д – РПС», «Сектор ПИР – РПС» и «Междилерское РЕПО» параметры сделки пересчитываются ежедневно до наступления даты исполнения сделки, исходя из значений, актуальных на начало торгового дня даты расчета.
     3. Допустимые коды расчетов при заключении сделок с облигациями с расчетами в рублях и иностранной валюте указаны в Таблице 1-О Приложения к настоящим Условиям. Для сделок в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Адресные заявки» с расчетами в юанях допустимым кодом расчетов является только Y0/Y1.
     4. В ходе торгового периода в Режимах торгов «Режим основных торгов Т+», «Сектор ПИР - Режим основных торгов», «Облигации Д – Режим основных торгов» определение допустимых встречных заявок для рыночной заявки осуществляется только среди встречных заявок, стоящих в очереди, начиная с минимальной цены продажи (для рыночной заявки на покупку)/максимальной цены покупки (для рыночной заявки на продажу), отклонение цен в которых не превышает:
* 0,4 % от минимальной цены продажи (для рыночной заявки на покупку)/максимальной цены покупки (для рыночной заявки на продажу) для КОБР и ОФЗ;
* 1% от минимальной цены продажи (для рыночной заявки на покупку)/максимальной цены покупки (для рыночной заявки на продажу) для остальных облигаций.
  + 1. В Режимах торгов «Режим основных торгов Т+», «Сектор ПИР - Режим основных торгов», «Облигации Д – Режим» основных торгов:
* Заявки на покупку/продажу облигаций, поданные в ходе торгового периода, не удовлетворенные при проведении торгового периода, снимаются с торгов по окончании торгового периода, в случае если по облигации по окончании торгового периода торги не проводятся в форме аукциона закрытия.
* Если заявка на покупку/продажу облигаций, поданная в ходе торгового периода удовлетворяется не полностью, то ее неисполненная часть снимается с торгов по окончании торгового периода, в случае если по облигации по окончании торгового периода торги не проводятся в форме аукциона закрытия.
  + 1. Заявка Участника торгов в Режимах торгов «РЕПО с ЦК – Адресные заявки» и «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки» регистрируется в Системе торгов в том числе и при указании в ней кода расчетов, в соответствии с которым дата исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО приходится на любой день после последнего дня текущего купонного периода ценной бумаги.
    2. При проведении торгов облигациями в Режимах торгов «РЕПО с ЦК - Адресные заявки» и «РЕПО с ЦК - Безадресные заявки» 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, кроме случаев, когда исполнение второй части РЕПО должно произойти по условиям сделки не позднее 7 календарных дней с даты начала купонного периода с неизвестной ставкой купона. Начиная с 7 календарного дня с даты начала купонного периода с неизвестной ставкой купона, также допускается заключение сделок РЕПО с кодами расчетов Y0/Y1, T0/Y1, с исполнением на следующий или второй через один расчетный день после 7 календарных дней с даты начала купонного периода с неизвестной ставкой купона.
  1. Торги облигациями, номинированными в рублях РФ, проводятся с учетом следующих особенностей:
     1. В Перечень ценных бумаг, с которыми допускается совершение сделок с расчетами в рублях РФ в Режиме торгов «Междилерское РЕПО» входят облигации, включенные в Список ценных бумаг, допущенных к торгам на Бирже, для которых допустимыми кодами расчетов установлены любые из следующих кодов расчетов: Rb, Sn, Z0 (Таблица 1-О Приложения к настоящим Условиям).
     2. В перечень ценных бумаг, с которыми допускается совершение сделок с расчетами в иностранной валюте в Режиме торгов «Междилерское РЕПО», (Таблица 2-О Приложения к настоящим Условиям) входят облигации, включенные в Список ценных бумаг, допущенных к торгам на Бирже.
     3. При проведении торгов облигациями в Режиме основных торгов Т+, Режиме переговорных сделок (РПС) и в Режимах торгов «Сектор ПИР – Режим основных торгов», «Сектор ПИР - РПС», Облигации Д – Режим основных торгов, «Облигации Д - РПС», Облигации Д – РПС с ЦК, «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», «РПС с ЦК», «Исполнение обязательств по Сделкам Т+: РПС», «Исполнение обязательств по Сделкам Т+: РЕПО» 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. В Режиме торгов «Междилерское РЕПО» 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, кроме случаев, когда исполнение второй части сделки РЕПО должно произойти по условиям сделки не позднее 7 календарных дней с даты начала купонного периода с неизвестной ставкой купона. Начиная с 7 календарного дня с даты начала купонного периода с неизвестной ставкой купона, в указанном режиме допускается только заключение сделок РЕПО овернайт с исполнением второй части сделки РЕПО не позднее второго расчетного дня, следующего за окончанием 7 календарных дней с даты начала купонного периода с неизвестной ставкой купона.
     4. При проведении торгов для следующих ценных бумаг:

|  |  |
| --- | --- |
| **Торговый код** | **Краткое наименование** |
| RU000A0JV276 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JV284 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JV292 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JV2A9 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JV763 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JV771 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JV789 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JV797 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JV7A8 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JV7B6 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JV7C4 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JV7D2 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JX132 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JV227 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JV235 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JV219 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JUCR3 | Роснефть (ПАО) |
| RU000A0JUCS1 | Роснефть (ПАО) |
| SU29006RMFS2 | Министерство Финансов РФ |
| SU29007RMFS0 | Министерство Финансов РФ |
| SU29008RMFS8 | Министерство Финансов РФ |
| SU29009RMFS6 | Министерство Финансов РФ |
| SU29010RMFS4 | Министерство Финансов РФ |
| SU29011RMFS2 | Министерство Финансов РФ |
| SU29012RMFS0 | Министерство Финансов РФ |
| SU24019RMFS0 | Министерство Финансов РФ |
| RU000A101D54 | ООО "ГТЛК-1520" |

в Режиме основных торгов Т+, Режиме переговорных сделок (РПС) и в Режимах торгов «Сектор ПИР – Режим основных торгов », «Сектор ПИР – РПС с ЦК» «Сектор ПИР - РПС», Облигации Д – Режим основных торгов, «Облигации Д – РПС» , Облигации Д – РПС с ЦК, «Междилерское РЕПО», «РЕПО с ЦК – Адресные заявки», «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки», , «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка», «РПС с ЦК», «Исполнение обязательств по Сделкам Т+: РПС», «Исполнение обязательств по Сделкам Т+: РЕПО» в реквизитах заявки может быть указан код расчетов и/или Срок сделки РЕПО, предусматривающий исполнение сделки в период, находящийся за пределами последнего купонного периода с известной ставкой купона. При этом в Режиме переговорных сделок (РПС) и в Режимах торгов «Облигации Д – РПС», «Сектор ПИР – РПС», и «Междилерское РЕПО» параметры сделки пересчитываются ежедневно до наступления даты исполнения сделки, исходя из значений, актуальных на начало торгового дня даты расчета.

* + 1. При подаче в Систему торгов Биржи заявок на заключение сделок с облигациями устанавливаются следующие допустимые коды расчетов:
* в Режиме торгов «Сектор ПИР – Режим основных торгов Т+», «Облигации Д – Режим основных торгов» – Y1;
* в Режиме переговорных сделок (РПС) и Режиме торгов «Облигации Д – РПС», «Сектор ПИР – РПС» – T0, B0-B30, Z0;
* в Режиме РПС с ЦК, Сектор ПИР – РПС с ЦК, Облигации Д – РПС с ЦК – Y0-Y7
* в Режимах торгов «Междилерское РЕПО» «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка» и «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» – Rb, Sn, Z0 (кроме внутридневных сроков сделок РЕПО).
  + 1. При подаче адресной заявки РЕПО в Режиме торгов «Междилерское РЕПО» может быть указана ставка фиксированного возмещения с точностью до 2-х знаков после запятой (для кодов расчетов Sn, Rb).
  1. При проведении торгов КСУ устанавливаются следующие особенности:
* расчетная цена КСУ принимается равной 1 руб.
* ставка РЕПО указывается с точностью до 2-х знаков после запятой в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки» для сделок с расчетами в рублях РФ, долларах США, Евро и до 3-х знаков после запятой в режиме торгов «РЕПО с ЦК – Адресные заявки» для сделок с расчетами в рублях РФ, долларах США, Евро.
* размер стандартного лота при торгах КСУ в Режимах торгов «РЕПО с ЦК – Адресные заявки» и «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки» с расчетами в рублях РФ устанавливается равным 1 000 (одной тысяче) ценных бумаг. Размер стандартного лота при торгах КСУ в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Аукцион» с расчетами в рублях РФ устанавливается равным 1 000 000 (одному миллиону) ценных бумаг. Размер стандартного лота при торгах КСУ в Режимах торгов РЕПО с ЦК с расчетами в долларах США и в Режимах торгов РЕПО с ЦК с расчетами в евро устанавливается равным 100 000 (ста тысячам) ценных бумаг.
* перечень КСУ, с которыми допускается заключение сделок в Секции рынка РЕПО, предусмотрен в Таблице 1-О Приложения к настоящим Условиям.
* Допускается подача лимитных заявок в режиме торгов «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки» с расчетами в рублях РФ, долларах США и евро с указанием дополнительного реквизита «видимая часть заявки» (айсберг-заявок).
  + 1. При подаче айсберг-заявки в Секции рынка РЕПО устанавливаются следующие дополнительные условия:
       1. Подача айсберг-заявок запрещена в ходе проведения торгов во всех Режимах торгов, за исключением Режима торгов «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки».
       2. При подаче айсберг-заявки указывается реквизит «видимая часть заявки» с точностью до 2-х знаков после запятой.
       3. При подаче айсберг-заявки осуществляется отклонение заявки, в которой нарушено хотя бы одно из следующих условий:
          1. Минимальное значение реквизита «видимая часть заявки» составляет 20 (двадцать) процентов от Суммы РЕПО.
          2. Максимальное значение реквизита «видимая часть заявки» составляет 80 (восемьдесят) процентов от Суммы РЕПО.
          3. Минимальная Сумма РЕПО для айсберг-заявки в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки»:
          - с расчетами в российских рублях составляет 500 000 000 (пятьсот миллионов) рублей;
          - с расчетами в иностранной валюте составляет 10 000 000 (десять миллионов) единиц валюты.
       4. Подача айсберг-заявок с указанием дополнительного реквизита «Заявка маркет-мейкера» не допускается.

1.9. Торги по государственным облигациям внешних облигационных займов Российской Федерации, а также по иным облигациям, номинированным в иностранной валюте, указанным в Таблице 3-О и 4-О Приложения к настоящим Условиям, проводятся с учетом следующих особенностей:

1.9.1. В Перечень ценных бумаг, с которыми допускается совершение сделок в Режиме торгов «Междилерское РЕПО», входят облигации, номинированные в иностранной валюте, включенные в Список ценных бумаг, допущенных к торгам на Бирже, для которых допустимыми кодами расчетов установлены любые из следующих кодов расчетов: Rb, Sn (Таблица 3-О Приложения к настоящим Условиям).

1.9.2. Для сделок в Режиме переговорных сделок (РПС) с кодами расчетов В0-В30, заключенных в российских рублях с государственными облигациями внешних облигационных займов Российской Федерации, до начала торгов в день исполнения сделки в Системе торгов автоматически пересчитываются объем сделки и накопленный купонный доход, исходя из официального курса иностранной валюты, в которой выражена номинальная стоимость ценной бумаги, по отношению к рублю, установленного Банком России на дату исполнения.

Для сделок в Режиме переговорных сделок (РПС) с кодом расчетов Т0, Z0 заключенных в российских рублях с государственными облигациями внешних облигационных займов Российской Федерации, цена сделки и накопленный купонный доход в Системе торгов автоматически пересчитываются, исходя из официального курса иностранной валюты, в которой выражена номинальная стоимость ценной бумаги, по отношению к рублю, установленного Банком России на дату заключения сделки.

1.9.3. При проведении торгов в Режиме торгов «Междилерское РЕПО» облигациями, включенными в Таблицу 3-О Приложения к настоящим Условиям и Приложение Б к настоящим Условиям, допускается заключение сделок с исполнением первой части до периода приостановки (прекращения) торгов облигациями в связи с выплатой купонного дохода и/или их погашением, а вторая часть – по истечении периода приостановки (прекращения) торгов облигациями в связи с выплатой купонного дохода и/или их погашением в случае, когда подобные приостановки предусмотрены эмиссионными документами, или в дни, приходящиеся на период после выплаты текущего купонного периода, включая эту дату в случае, если дата выплаты совпадает с датой выплаты текущего купона. При этом сумма РЕПО не изменяется на величину начисленного купонного (процентного) дохода и/или на величину погашенной части основного долга (амортизационной выплаты). В Режиме торгов «Междилерское РЕПО» 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, кроме случаев, когда исполнение второй части сделки РЕПО должно произойти по условиям сделки не позднее 7 календарных дней с даты начала купонного периода с неизвестной ставкой купона. Начиная с 7 календарного дня с даты начала купонного периода с неизвестной ставкой купона, в указанном режиме допускается только заключение сделок РЕПО овернайт с исполнением второй части РЕПО не позднее второго расчетного дня, следующего за окончанием 7 календарных дней с даты начала купонного периода с неизвестной ставкой купона.

1.9.4. При подаче в Систему торгов Биржи заявок на заключение сделок с облигациями, номинированными в иностранной валюте, установить следующие допустимые коды расчетов:

в Режиме основных торгов Т+, Облигации Д – Режим основных торгов, Сектор ПИР – Режим основных торгов - Y2;

в Режиме РПС с ЦК, Сектор ПИР – РПС с ЦК, Облигации Д – РПС с ЦК – Y0-Y7;

в Режиме переговорных сделок (РПС) – T0, B0-B30, Z0;

в Режиме торгов «Междилерское РЕПО» - Rb, S0, S1, S2, Z0;

в Режимах торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» - Rb, Sn, Z0 (кроме внутридневных сроков сделок РЕПО).

1.10. Торги в Режиме основных торгов Т+, Сектор ПИР – Режим основных торгов, Облигации Д – Режим основных торгов для облигаций и ОФЗ проводятся в форме аукциона открытия с учетом следующих особенностей:

1.10.1. При проведении торгов в ходе аукциона открытия устанавливаются следующие периоды времени проведения фаз аукциона открытия:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | Время/период начала | Время/период окончания |
| Фаза сбора заявок на аукцион | 09:50:00 | 09:59:30 |
| Фаза случайного завершения аукциона | 09:59:31 | 9:59:59 |
| Определение Цены аукциона открытия и заключение сделок | 09:59:31- 9:59:59 | - |

1.10.2. В заявке, поданной в ходе аукциона открытия (за исключением лимитных заявок (АЗ) и рыночных заявок (АЗ)), предельные границы колебания цены ценной бумаги составляют 10% от официальной цены закрытия предыдущего торгового дня по ценной бумаге, указанной в заявке.

1.10.3. Лимитные заявки с указанием дополнительного реквизита «видимое количество ценных бумаг, выраженное в лотах» (айсберг-заявка), не принимают участия в АО.

1.11. Торги в Режиме основных торгов Т+, Сектор ПИР – Режим основных торгов, Облигации Д – Режим основных торгов после окончания торгового периода для облигаций и ОФЗ проводятся в форме аукциона закрытия с учетом следующих особенностей:

При проведении торгов по ценным бумагам в ходе аукциона закрытия устанавливаются следующие периоды времени проведения фаз аукциона закрытия:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | Время/период начала | Время/период окончания |
| Фаза сбора заявок на аукцион | 18:40:01 | 18:45:00 -18:45:29 |
| Дополнительная фаза сбора заявок на аукцион | 18:45:00 -18:45:29 | 18:48:00 -18:48:59 |
| Определение Цены аукциона закрытия и заключение сделок | 18:45:00 -18:45:29  либо  18:48:00 -18:48:59 | - |
| Фаза заключения сделок по цене аукциона закрытия | 18:45:00 - 18:49:00 | 18:50:00 |

1.11.1. В ходе проведения аукциона закрытия в Систему торгов подаются лимитные заявки, рыночные заявки (в ходе фаз сбора заявок) и заявки по цене аукциона закрытия (в ходе фазы торгов по цене аукциона закрытия). В фазах сбора заявок также принимают участие лимитные заявки, не исполненные или частично исполненные в торговом периоде, а также лимитные заявки (АЗ), рыночные заявки (АЗ), поданные в ходе торгового периода. Заявки, полностью или частично неудовлетворенные в ходе аукциона закрытия, снимаются с торгов по окончании аукциона закрытия.

1.11.2. В заявке аукциона закрытия предельные границы колебания цены ценной бумаги составляют 2,5% от цены последней сделки, предшествующей аукциону закрытия.

1.12. Торги в Режиме торгов крупными пакетами облигациями проводятся с учетом следующих особенностей:

1.12.1. Перечень облигаций, с которыми допускается совершение сделок в Режиме торгов крупными пакетами ценных бумаг с расчетами в российских рублях представлен в Таблице 6-О Приложения к настоящим Условиям (далее – Таблица 6-О), Перечень облигаций, с которыми допускается совершение сделок в Режиме торгов крупными пакетами ценных бумаг с расчетами в долларах США, представлен в Таблице 7-О Приложения к настоящим Условиям (далее – Таблица 7-О).

1.12.2. В течение торгового дня в Режиме торгов крупными пакетами ценных бумаг проводится 2 Аукциона со следующим временем начала и окончания каждого из Аукционов:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  | Период | Время начала | Время окончания |
| Аукцион 1 | Период определения цены аукциона | 11:29:59 | 11:29:59 |
| Период сбора заявок и заключения сделок | 11:30:00 | 11:45:00 |
| Аукцион 2 | Период определения цены аукциона | 16:29:59 | 16:29:59 |
| Период сбора заявок и заключения сделок | 16:30:00 | 16:45:00 |

1.12.3. В Режиме торгов крупными пакетами по облигациям допускается подача заявок со следующими кодами расчетов:

Для ОФЗ - Y1;

Для ГОВОЗ – Y2.

1.12.4. Для заявок, подаваемых в Режиме торгов крупными пакетами ценных бумаг, установить количество бумаг в лоте, равное 1 шт.

1.12.5. Подача заявок с условием «Заявка маркет-мейкера» в Режиме торгов крупными пакетами ценных бумаг не допускается.

1.12.6. Цена аукциона округляется по правилам математического округления до ближайшей цены, кратной минимальному изменению цены и определяется следующим способом:

1.12.6.1. В установленный момент времени (период определения цены Аукциона) из Системы торгов (Режима основных торгов Т+), получаются сведения о значениях цен, начиная с лучших, по текущему спросу и текущему предложению, в пределах величин спроса и предложения, установленных в Таблицах 6 и 7. В случае недостаточности и/или отсутствия спроса и/или предложения получаются сведения о текущей цене ценной бумаги на момент определения цены.

1.12.6.2. В момент определения цены Аукциона в Системе торгов производится расчет средневзвешенных цен спроса и предложения, исходя из значений цен, полученных из Системы торгов в соответствии с п. 1.12.6.1. настоящих Условий. Цена Аукциона рассчитывается как среднее значение средневзвешенных цен спроса и предложения. В случаях, указанных в п. 1.12.6.3 и 1.12.6.4, такая цена не рассчитывается и не фиксируется. На основе значений, полученных в соответствии с п. 1.11.6.1. настоящих Условий, определяется цена Аукциона по следующей формуле:

  , где

=  , где

*Pспрос* – средневзвешенная цена спроса

*n* – количество заявок, необходимых для расчета средневзвешенной цены спроса (минимальный совокупный объем спроса в Режиме основных торгов Т+, в пределах величины спроса, установленной в Таблицах 6 и 7).

*qi* – объем отдельной заявки на покупку, шт.

*pi* – цена отдельной заявки на покупку в валюте расчетов

=  , где

*Pпредложение* – средневзвешенная цена предложения

*n* – количество заявок, необходимых для расчета средневзвешенной цены предложения (минимальный совокупный объем предложения в Режиме основных торгов Т+, в пределах величины предложения, установленной в Таблицах 6 и 7).

*qj* – объем отдельной заявки на продажу, шт.

*pj* – цена отдельной заявки на продажу в валюте расчетов

1.12.6.3.  В качестве цены Аукциона берется текущая цена ценной бумаги, если в момент времени, указанный в п. 1.11.6.1. настоящих Условий:

* совокупный объем спроса/предложения в стакане меньше минимальных значений, необходимых для расчета средневзвешенных цен и установленных в Таблицах 6-О и 7-О;
* заявки на покупку и/или продажу в стакане Режима основных торгов Т+ отсутствуют.

1.12.6.4. Цена Аукциона по ценной бумаге не определяется, Аукцион не проводится и сделки не заключаются, если в течение периода времени, указанного в п. 1.12.6.1. настоящих Условий:

* по конкретной ценной бумаге отсутствует текущая цена;        и/или
* торги данной ценной бумагой не проводились (были приостановлены).

1.12.6.5. После определения цены Аукциона начинается период сбора заявок и заключения сделок по цене аукциона.

1.12.6.6. Заключение Сделок по цене Аукциона осуществляется в следующем порядке:

* Для заявок КП цена за одну ценную бумагу признается равной цене Аукциона, определенной в соответствии с п. 1.12.6.2. настоящих Условий;
* При появлении допустимой встречной заявки КП из очереди активных заявок выбирается заявка, поданная ранее остальных.
* Происходит заключение сделок по цене, рассчитанной в соответствии с п. 1.12.6.1 настоящих Условий~~,~~

1.13. При проведении торгов в Режиме торгов «Исполнение обязательств по срочным контрактам» заключаются сделки Т+ в порядке, определенном п. 1.19.1. Части II Правил торгов:

* для ОФЗ - с кодом расчетов Y1;
* для Государственных облигаций внешнего облигационного займа Российской Федерации с окончательной датой погашения в 2030 году (торговый код XS0114288789) - с кодом расчетов Y2.

1.14. Подача айсберг-заявок запрещена в ходе проведения торгов во всех Режимах торгов.

1.15. Торги в Режиме торгов «Анонимный РПС» проводятся с учетом следующих особенностей:

* Сделки в Режиме торгов «Анонимный РПС» заключаются в рублях РФ, долларах США и евро;
* В Режиме торгов «Анонимный РПС» допускается подача заявок с кодом расчетов T0.
* Подача заявок и заключение сделок в Режиме торгов «Анонимный РПС» допускается со всеми облигациями, допущенными к Режиму переговорных сделок (РПС) и к Режиму торгов «Сектор ПИР- РПС», в соответствующей валюте.

1.16. При подаче адресной заявки РПС в Режиме торгов «Облигации Д - РПС», Режиме торгов «Сектор ПИР - РПС», Режиме переговорных сделок (РПС) может быть указана ставка фиксированного возмещения с точностью до 2-х знаков после запятой (для кода расчетов Bn).

1. В соответствии с п. 1.7.3, п. 1.7.6 Части I Правил торгов, п. 1.5.2 Части III Правил торгов при проведении торгов на рынке облигаций ПАО Московская Биржа устанавливаются следующие параметры заявок на совершение сделок с облигациями:
   1. Для целей пунктов 2 и 3 настоящих Условий применяются термины:
      1. Режимы основных торгов – следующие режимы торгов Секции фондового рынка, установленные Частью II Правил торгов:
         * + Режим торгов «Сектор ПИР - Режим основных торгов»;
           + Режим торгов крупными пакетами ценных бумаг;
           + Режим торгов «Облигации Д - Режим основных торгов »;
           + Режим торгов «Режим основных торгов Т+»;
           + Режим торгов «Урегулирование с ЦК».
      2. Режимы переговорных сделок – следующие режимы торгов Секции фондового рынка, установленные Частью II Правил торгов:
         * + Режим переговорных сделок (РПС);
           + Режим торгов «Сектор ПИР - РПС»;
           + Режим торгов «Облигации Д - РПС»;
           + Режим торгов «РПС с ЦК»;
           + Режим торгов «Сектор ПИР – РПС с ЦК»;
           + Режим торгов Облигации Д – РПС с ЦК;
           + Режим торгов «Анонимный РПС»;
           + Режим торгов «Исполнение обязательств по срочным контрактам».
      3. Режимы торгов РЕПО – следующие режимы торгов Секции рынка РЕПО, установленные Частью III Правил торгов:
         * + Режим торгов «Междилерское РЕПО»;
           + Режим торгов «Аукцион РЕПО»;
           + Режим торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО»;
           + «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка»;
           + Режим торгов «РЕПО с Банком России: фикс.ставка»;
           + Режим торгов «РЕПО с ЦК - Безадресные заявки»;
           + Режим торгов «РЕПО с ЦК - Адресные заявки»;
           + Режим торгов «РЕПО с ЦК - Аукцион»;
           + Режим торгов «РЕПО с ЦК – Урегулирование».
      4. Режимы торгов РЕПО с ЦК – следующие режимы торгов Секции рынка РЕПО, установленные Частью III Правил торгов:
         * + Режим торгов «РЕПО с ЦК - Безадресные заявки»;
           + Режим торгов «РЕПО с ЦК - Адресные заявки»;
           + Режим торгов «РЕПО с ЦК - Аукцион»;
           + Режим торгов «РЕПО с ЦК – Урегулирование».
   2. При подаче заявок и совершении сделок с облигациями, за исключением государственных облигаций внешних облигационных займов Российской Федерации (далее – ГОВОЗ РФ), а также за исключением облигаций федерального займа Министерства финансов Российской Федерации (далее – ОФЗ) и купонных облигаций Банка России (далее – КОБР), во всех режимах торгов Секции фондового рынка, величина шага цены, выраженной в процентах от номинальной стоимости облигации, равна 0.01 (ноль целых одна сотая) процента.
   3. При торгах облигациями, номинированными в иностранной валюте, во всех режимах торгов, кроме Режимов торгов РЕПО, величина шага цены, выраженной в процентах от номинальной стоимости облигации, равна 0.0001 (ноль целых одна десятитысячная) процента.
   4. При подаче заявок и совершении сделок с ОФЗ в Режиме торгов «Режим основных торгов Т+» и Режиме торгов крупными пакетами ценных бумаг величина шага цены, выраженной в процентах от номинальной стоимости облигации, равна 0.001 (ноль целых одна тысячная) процента. При подаче заявок и совершении сделок с ОФЗ во всех режимах торгов Секции фондового рынка, за исключением Режима торгов «Режим основных торгов Т+» и Режима торгов крупными пакетами ценных бумаг, и Секции рынка РЕПО величина шага цены, выраженной в процентах от номинальной стоимости облигации, равна 0.0001 (ноль целых одна десятитысячная) процента.

При подаче заявок и совершении сделок с КОБР в Режиме торгов «Режим основных торгов Т+» величина шага цены, выраженной в процентах от номинальной стоимости облигации, равна 0.001 (ноль целых одна тысячная) процента. При подаче заявок и совершении сделок с КОБР во всех режимах торгов Секции фондового рынка, за исключением Режима торгов «Режим основных торгов Т+», и Секции рынка РЕПО величина шага цены, выраженной в процентах от номинальной стоимости облигации, равна 0.0001 (ноль целых одна десятитысячная) процента.

* 1. При подаче заявок и совершении сделок с облигациями в Режимах торгов РЕПО величина шага цены, выраженной в процентах от номинальной стоимости, равна 0,0001 (ноль целых одна десятитысячная), за исключением ГОВОЗ РФ и иных облигаций, номинированных в иностранной валюте, для которых величина шага цены, выраженной в процентах от номинальной стоимости, равна 0,000001 (ноль целых одна миллионная).
  2. Расчет цен первой и второй частей сделок РЕПО, значение начального дисконта, максимального предельного значения, минимального предельного значения дисконта и ставка РЕПО (отклонение от индикативной ставки, в случае подачи заявки на заключение сделки с Плавающей ставкой РЕПО) в Режимах торгов РЕПО (кроме Режимов торгов РЕПО с ЦК) определяется с точностью до 4-х знаков после запятой, за исключением ГОВОЗ РФ и иных облигаций, номинированных в иностранной валюте. Для ГОВОЗ РФ и иных облигаций, номинированных в иностранной валюте расчет цен первой и второй частей сделок РЕПО, значение начального дисконта, максимального предельного значения, минимального предельного значения дисконта и ставка РЕПО (отклонение от индикативной ставки, в случае подачи заявки на заключение сделки с Плавающей ставкой РЕПО) в Режимах торгов РЕПО определяется с точностью до 6-и знаков после запятой.

Величина шага Ставки РЕПО в Режимах торгов РЕПО с ЦК, за исключением режима торгов «РЕПО с ЦК – Адресные заявки», с расчетами в российских рублях, долларах США, Евро и и китайских юанях устанавливается равной 0,01 (ноль целых одна сотая) процента годовых.

Величина шага Ставки РЕПО в Режимах торгов «РЕПО с ЦК – Адресные заявки» с расчетами в российских рублях, долларах США, Евро и китайских юанях, устанавливается равной 0,001 (ноль целых одна тысячная) процента годовых.

* 1. В Режиме торгов «Междилерское РЕПО» с расчетами в иностранной валюте шаг дисконта и шаг ставки РЕПО составляет 0,000001 (ноль целых одна миллионная) процента годовых, расчет цен первой и второй частей сделки РЕПО осуществляется с точностью до 6-ти знаков после запятой.
  2. При торгах облигациями, номинированными в иностранной валюте, в Режимах торгов РЕПО (кроме Режимов торгов РЕПО с ЦК), шаг дисконта составляет 0,000001 (ноль целых одна миллионная) процента.
  3. Ставка РЕПО (отклонение от индикативной ставки, в случае подачи заявки на заключение сделки с Плавающей ставкой РЕПО) в Режимах торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка» и «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» указывается с точностью до 4-х знаков после запятой.
  4. Цена закрытия, признаваемая котировка, рыночная цена, текущая цена, средневзвешенная цена, наибольшая и наименьшая цены ценной бумаги по заключенным сделкам рассчитываются с точностью до величины шага цены, выраженной в процентах от номинальной стоимости, в соответствии с пп. 2.2-2.9 настоящего пункта Условий.

1. В соответствии с п. 1.8.2 и п. 1.8.3 Части I Правил торгов устанавливаются следующие размеры стандартного лота по ценным бумагам в Системе торгов ПАО Московская Биржа:
   1. Размер стандартного лота во всех режимах торгов Секции фондового рынка и Секции рынка РЕПО устанавливается равным 1 (одной) ценной бумаге, за исключением облигаций, указанных в пп. 3.2 настоящего пункта и пп. 1.11.1 Условий.
   2. При подаче заявок и совершении сделок с облигациями, указанными в Таблице 7-О Приложения к настоящим Условиям, во всех режимах торгов Секции фондового рынка, за исключением Режима торгов «Исполнение обязательств по срочным контрактам», Режима торгов крупными пакетами ценных бумаг и Режима торгов «Урегулирование с ЦК», а также в Режимах торгов РЕПО с ЦК, за исключением Режима торгов «РЕПО с ЦК – Урегулирование», размер стандартного лота устанавливается равным величине, определенной в данной таблице.
2. В целях предотвращения манипулирования ценами, а также в целях снижения рисков на рынке ценных бумаг в соответствии с пп. 1.13.1.2 п. 1.13.1 Подраздела 1.13 «Правила предотвращения, выявления и пресечения случаев неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком, а также меры по предотвращению дестабилизации рынка» Части I Правил торгов и п. 1.2.3 Подраздела 1.2 «Общие положения» Части III Правил торгов устанавливаются следующие дополнительные ограничения на параметры заявок, при превышении которых заявки автоматически отклоняются в Системе торгов ПАО Московская Биржа:
   1. Для целей настоящего пункта Условий применяются следующие термины:
      1. Режимы переговорных сделок – следующие режимы торгов Секции фондового рынка, установленные Частью II Правил торгов:

* Режим переговорных сделок (РПС);
* Режим торгов «Сектор ПИР - РПС»;
* Режим торгов «Облигации Д - РПС»;
* Режим торгов «Анонимный РПС»;
* Режим торгов «Исполнение обязательств по срочным контрактам».
  + 1. Режимы торгов РЕПО – следующие режимы торгов Секции рынка РЕПО, установленные Частью III Правил торгов:
* Режим торгов «Междилерское РЕПО»;
* Режим торгов «Аукцион РЕПО»;
* Режим торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО»;
* «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка»;
* Режим торгов «РЕПО с Банком России: фикс.ставка».
  1. Заявка на совершение сделки с ценной бумагой автоматически отклоняется в Системе торгов ПАО Московская Биржа (далее – Система торгов) в том случае, если цена данной ценной бумаги, указанная в заявке (либо рассчитанная в Режимах торгов РЕПО), отличается в сторону увеличения или уменьшения от расчетной цены для целей определения отклонений цен (далее – Расчетная цена) на величину, установленную настоящим пунктом Условий (далее – лимит отклонения цены), выраженную в процентах.
  2. Устанавливаются следующие лимиты отклонения цены облигаций с присвоенным торговым кодом в Системе торгов.
     1. В Режимах торгов РПС и Сектор ПИР – РПС лимит отклонения цены облигаций: ±40%.

Лимит отклонения цены определяется по отношению к Расчетной цене. Расчетная цена приравнивается к Цене закрытия предыдущего торгового дня.

* + 1. В Режиме торгов «Облигации Д - РПС», лимит отклонения цены облигаций:
  + лимит отклонения цены в сторону уменьшения: -100%,
  + лимит отклонения цены в сторону увеличения: +50%.

Лимит отклонения цены определяется по отношению к номинальной стоимости облигации.

* + 1. В Режиме торгов «Исполнение обязательств по срочным контрактам» лимит отклонения цены облигаций, а также Расчетная цена не устанавливаются.
    2. В Режимах торгов РЕПО, кроме режимов торгов «Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка» и «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», лимит отклонения цены облигаций:
  + лимит отклонения цены в сторону уменьшения: -100%,
  + лимит отклонения цены в сторону увеличения: +100%.

Лимит отклонения цены определяется по отношению к Расчетной цене для сделок РЕПО.

* 1. Устанавливается следующий лимит отклонения цены облигаций с присвоенным торговым кодом в Системе торгов в Режимах переговорных сделок в первый день их обращения в Системе торгов: ±20%.

Лимит отклонения цены определяется по отношению к номинальной стоимости облигации, если решением Биржи не установлено иное.

* 1. В режимах торгов:
     + - Режим торгов «Режим основных торгов Т+»;
       - Режим торгов «Сектор ПИР - Режим основных торгов»;
       - Облигации Д – Режим основных торгов
       - Режим торгов «РПС с ЦК»;
       - Режим торгов «Сектор ПИР - РПС с ЦК»;
       - Режим торгов Облигации Д – РПС с ЦК;
       - Режим торгов «РЕПО с ЦК - Безадресные заявки»;
       - Режим торгов «РЕПО с ЦК - Адресные заявки»;
       - Режим торгов «Урегулирование с ЦК»;
       - Режим торгов «РЕПО с ЦК – Урегулирование»;
       - Режим торгов «РЕПО с ЦК - Аукцион»

лимит отклонения цены ценных бумаг устанавливается в соответствии с методикой определения Небанковской кредитной организацией-центральным контрагентом «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов ПАО Московская Биржа.

* 1. Для облигаций, впервые допускаемых к торгам, Расчетная цена устанавливается равной номинальной стоимости облигации – 100% и действует до момента формирования Цены закрытия по облигации или Расчетной цены для сделок РЕПО, если решением Биржи не установлено иное.
  2. Расчетная цена облигации может быть изменена по решению Биржи.

Расчетная цена, установленная решением Биржи, действует до момента формирования новой Цены закрытия для этой облигации.

* 1. Заявка на совершение сделки с ценной бумагой в режимах торгов РЕПО автоматически отклоняется в Системе торгов в случае, если цена второй части сделки РЕПО, рассчитанная на основе цены первой части сделки РЕПО и ставки РЕПО, указанных в заявке или рассчитанных на основании иных параметров заявки, является отрицательной величиной.

**Приложение А**

**Порядок расчета доходности по государственным ценным бумагам**

Официальная доходность по каждому выпуску государственных ценных бумаг определяется на дату расчетов по следующим формулам.

Годовая доходность к погашению по выпускам государственных краткосрочных бескупонных облигаций:

где - номинальная стоимость облигации;

- цена на аукционе или на вторичных торгах по облигации (в % от номинальной стоимости);

- число дней до погашения облигации.

Эффективная годовая доходность к погашению по выпускам облигаций федеральных займов:

где - цена облигации;

- накопленный купонный доход;

- эффективная доходность к погашению;

- число дней до выплаты i-oгo купона;

- величина i-гo купона;

- количество купонов;

- срок до j-ой выплаты номинальной стоимости;

- размер j-ой выплаты номинальной стоимости облигации;

- количество платежей по основной сумме долга.

где - величина текущего купона;

- длительность купонного периода в днях;

- число дней до выплаты ближайшего купона.

где - номинальная стоимость облигации/непогашенная часть номинальной

стоимости облигации;

- размер купонной ставки;

- длительность купонного периода в днях.

По выпускам облигаций федерального займа с переменным купонным доходом и купонных облигаций Банка России для целей расчета доходности купонные ставки по неизвестным купонам принимаются равными последней известной ставке по данному выпуску.

По выпускам облигаций федерального займа с индексируемым номиналом расчет доходности осуществляется без учета инфляции.

Простая доходность по выпускам купонных облигаций Банка России рассчитывается к дате ближайшего купона:

Y=((N+C)/(P+A)-1)×Year Basis/t×100

, ,

где Y –простая доходность к дате ближайшего купона;

P - цена облигации в валюте расчетов;

A - накопленный купонный доход в валюте расчетов:

* на дату расчетов для кода Y1 для сделок в Режиме основных торгов Т+ и РПС с ЦК,
* на дату расчетов для кода Т0 в Режиме переговорных сделок;

N – номинал облигации в валюте расчетов;

C – ближайшая купонная выплата в валюте расчетов;

t - число дней до ближайшей купонной выплаты:

* с даты расчетов для кода Y1 для сделок в Режиме основных торгов Т+ и РПС с ЦК,
* с даты расчетов для кода Т0 в Режиме переговорных сделок;

YearBasis – базис года (число дней в году).

Средневзвешенный срок выплат по облигации федерального займа и купонным облигациям Банка России (дюрация) рассчитывается по следующей формуле:

где - эффективная доходность к погашению;

- число дней до выплаты i-ого купона;

- величина i-го купона;

- количество купонов;

- срок до j-ой выплаты номинальной стоимости;

- размер j-ой выплаты номинальной стоимости облигации;

- количество платежей по основной сумме долга.

Дюрация выпуска государственных краткосрочных бескупонных облигаций соответствует сроку до погашения выпуска.

**Приложение Б**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **№** | **Наименование** | **Наименование (ENG)** | **Торговый код / ISIN** | **Валюта номинала** |
| 1 | ВЭБ Файнэнс пиэлси | VEB FINANCE PLC | XS0993162683 | USD |
| 2 | ВТБ Кэпитал Эс.Эй. | VTB Capital S.A. | XS0772509484 | USD |
| 3 | Альфа Бонд Ишьюанс пиэлси | Alfa Bond Issuance plc. | XS0544362972 | USD |
| 4 | Роснефть Интернэйшинал Файнэнс Лимитэд | Rosneft International Finance Limited | XS0861981180 | USD |
| 5 | ЕвроХим Глобал Инвестментс Лимитэд | EuroChem Global Investments Limited | XS0863583281 | USD |
| 6 | Новатэк Файнэнс Лимитэд | Novatek Finance Limited | XS0864383723 | USD |
| 7 | Евраз Груп Эс.Эй. | EVRAZ GROUP S.A. | XS0359381331 | USD |
| 8 | Газ Кэпитал Эс.Эй. | Gaz Capital S.A. | XS0191754729 | USD |
| 9 | Газ Кэпитал Эс.Эй. | Gaz Capital S.A. | XS0424860947 | USD |
| 10 | Газ Кэпитал Эс.Эй. | Gaz Capital S.A. | XS0357281558 | USD |
| 11 | Газ Кэпитал Эс.Эй. | Gaz Capital S.A. | XS0316524130 | USD |
| 12 | ПСБ Финанс Эс.Эй. | PSB Finance S.A. | XS0851672435 | USD |
| 13 | Альянс Оил Кампани Элтиди | Alliance Oil Company Ltd. | XS0925043100 | USD |
| 14 | РСХБ Кэпитал Эс.Эй. | RSHB Capital S.A. | XS0796426228 | USD |
| 15 | ГПБ Евробонд Файнэнс ПиЭлСи | GPB Eurobond Finance PLC | XS0848137708 | USD |
| 16 | ОЭфСиБи Кэпитал ПиЭлСи | Nomos Capital Plc | XS0776121062 | USD |
| 17 | Альфа Бонд Ишьюанс пиэлси | Alfa Bond Issuance plc. | XS0620695204 | USD |
| 18 | ТКС Файнэнс Лимитэд | TCS Finance Limited | XS0830191234 | USD |
| 19 | Рашн Стэндарт Файнэнс Эс.Эй. | Russian Standard Finance S.A. | XS0841677387 | USD |
| 20 | ДжиПиЭн Кэпитал Эс.Эй. | GPN Capital S.A. | XS0997544860 | USD |
| 21 | СиБиОуЭм Файнэнс Пи.Эл.Си | CBOM Finance P.L.C. | XS0924078453 | USD |
| 22 | СиБиОуЭм Файнэнс Пи.Эл.Си | CBOM Finance P.L.C. | XS0879105558 | USD |
| 23 | ВТБ Евразия Лимитэд | VTB BANK (VTB EURASIA) | XS0810596832 | USD |
| 24 | Полюс Голд Интернешенл Лимитед | Polyus Gold International Limited | XS0922301717 | USD |
| 25 | СиБиОуЭм Файнэнс Пи.Эл.Си | CBOM Finance P.L.C. | XS1143363940 | RUB |
| 26 | ПиЭсБи Файнэнс Эс.Эй. | PSB Finance S.A. | XS1086084123 | USD |
| 27 | ВПБ Фандинг Лимитед | VPB Funding Limited. | XS0993279958 | USD |
| 28 | Минфин России | Ministry of Finance of the Russian Federation | XS0088543193 | USD |
| 29 | Минфин России | Ministry of Finance of the Russian Federation | XS0089375249 | USD |
| 30 | Минфин России | Ministry of Finance of the Russian Federation | XS0114288789 | USD |
| 31 | Минфин России | Ministry of Finance of the Russian Federation | XS0504954347 | USD |
| 32 | Минфин России | Ministry of Finance of the Russian Federation | XS0564087541 | RUB |
| 33 | Минфин России | Ministry of Finance of the Russian Federation | XS0767469827 | USD |
| 34 | Минфин России | Ministry of Finance of the Russian Federation | XS0767472458 | USD |
| 35 | Минфин России | Ministry of Finance of the Russian Federation | XS0767473852 | USD |
| 36 | Минфин России | Ministry of Finance of the Russian Federation | XS0971721377 | USD |
| 37 | Минфин России | Ministry of Finance of the Russian Federation | XS0971721450 | USD |
| 38 | Минфин России | Ministry of Finance of the Russian Federation | XS0971721963 | USD |
| 39 | Минфин России | Ministry of Finance of the Russian Federation | XS0971722342 | EUR |
| 40 | Внешэкономбанк | VNESHECONOMBANK | RU000A0JULN3 | USD |
| 41 | ОАО "ВЭБ-лизинг" | OPEN JOINT-STOCK COMPANY "VEB-LEASING" | RU000A0JTYG2 | USD |
| 42 | ОАО "ВЭБ-лизинг" | OPEN JOINT-STOCK COMPANY "VEB-LEASING" | RU000A0JUFE4 | USD |
| 43 | ОАО "ВЭБ-лизинг" | OPEN JOINT-STOCK COMPANY "VEB-LEASING" | RU000A0JUFF1 | USD |
| 44 | ОАО "ВЭБ-лизинг" | OPEN JOINT-STOCK COMPANY "VEB-LEASING" | RU000A0JUFG9 | USD |
| 45 | ОАО "ВЭБ-лизинг" | OPEN JOINT-STOCK COMPANY "VEB-LEASING" | RU000A0JUFH7 | USD |
| 46 | ОАО "ВЭБ-лизинг" | OPEN JOINT-STOCK COMPANY "VEB-LEASING" | RU000A0JSAV3 | USD |
| 47 | ОАО "ВЭБ-лизинг" | OPEN JOINT-STOCK COMPANY "VEB-LEASING" | RU000A0JSAZ4 | USD |
| 48 | ОАО "ВЭБ-лизинг" | OPEN JOINT-STOCK COMPANY "VEB-LEASING" | RU000A0JSB06 | USD |
| 49 | ОАО "ВЭБ-лизинг" | OPEN JOINT-STOCK COMPANY "VEB-LEASING" | RU000A0JSB14 | USD |
| 50 | ОАО "ВЭБ-лизинг" | OPEN JOINT-STOCK COMPANY "VEB-LEASING" | RU000A0JT7N5 | USD |
| 51 | ОАО "ВЭБ-лизинг" | OPEN JOINT-STOCK COMPANY "VEB-LEASING" | RU000A0JT7P0 | USD |
| 52 | ОАО "ВЭБ-лизинг" | OPEN JOINT-STOCK COMPANY "VEB-LEASING" | RU000A0JTYD9 | USD |
| 53 | ОАО "ВЭБ-лизинг" | OPEN JOINT-STOCK COMPANY "VEB-LEASING" | RU000A0JTYE7 | USD |
| 54 | ОАО "ВЭБ-лизинг" | OPEN JOINT-STOCK COMPANY "VEB-LEASING" | RU000A0JTYF4 | USD |
| 55 | ОАО "ВЭБ-лизинг" | OPEN JOINT-STOCK COMPANY "VEB-LEASING" | RU000A0JVNL1 | USD |