

УТВЕРЖДЕНО

приказом ПАО Московская Биржа

от 09.12.2020 № МБ-П-2020-3249

с изменениями, утвержденными приказом

от 27.01.2021 № МБ-П-2021-131

ПРОГРАММА МАРКЕТ-МЕЙКИНГА «Добрый вечер»

Раздел I. Термины и определения

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

Инструмент(-ы) – выпуск(-и) ценных бумаг, указанный(-ые) в Таблице, приведенной в Приложении 1 к настоящей Программе.

Пассивная сделка - сделка Маркет-мейкера, в реквизитах которой номер заявки Маркет-мейкера меньше номера Встречной заявки и объем заявки Маркет-мейкера не ниже Объема двусторонней котировки для соответствующего Инструмента. При расчете совокупного объема пассивных сделок для целей расчета вознаграждения Маркет-мейкера не учитываются сделки, совершенные на основании заявок Маркет-мейкера и Встречных заявок, поданных за счет одного и того же Маркет-мейкера или Клиента;

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

Программа – Программа маркет-мейкинга «Добрый вечер».

Торговый день – день, в котором осуществляются торги Инструментами Программы в Секции фондового рынка Биржи в установленных Программой режимах.

Термины, не определенные в настоящей Программе, используются в значениях, установленных Правилами выполнения функций Маркет-мейкера в Секции фондового рынка.

Раздел II. Параметры и условия выполнения обязательств Маркет-мейкера

2.1. Маркет-мейкер, выбравший настоящую Программу, обязан в соответствии с заключенным Договором исполнять обязательства по Программе в Режиме торгов «Режим основных торгов Т+» Секции фондового рынка Биржи с расчетами в российских рублях в течение Дополнительной (вечерней) торговой сессии.

2.2. По каждому из Инструментов устанавливаются значения параметров исполнения обязательств Маркет-мейкера, приведенные в Таблице из Приложения 1 к Программе.

2.3. Маркет-мейкер считается исполнившим в течение Торгового дня обязательства, указанные в пункте 2.2. настоящей Программы, только в случае если Маркет-мейкер выполнил обязательства

в данном Торговом дне по не менее 50% Инструментам от общего количества Инструментов, включенных в Программу, при условии выполнения им в отношении каждого из этих Инструмента(-ов) одновременно во всех временных интервалах, указанных в столбце 3 Таблицы и для которых установлены все значения параметров исполнения обязательств Маркет-мейкера, хотя бы одного из следующих условий:

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

- выполнение обязательств, указанных в столбце 6 Таблицы.

Выполнение/невыполнение обязательств Маркет-мейкером определяется Биржей по каждому используемому Маркет-мейкером Идентификатору.

2.4. Минимально допустимое количество Торговых дней Отчетного периода, в течение которых Маркет-мейкер должен исполнять обязательства согласно пункту 2.3. настоящей Программы, определяется как 60% от количества Торговых дней Отчетного периода. В случае нарушения данного условия в определенном Отчетном периоде, услуги Маркет-мейкера по настоящей Программе в таком Отчетном периоде считаются не оказанными.

В случае действия настоящей Программы и/или использования в Программе Идентификатора(-ов) Маркет-мейкера неполный Отчетный период, вместо количества Торговых дней в Отчетном периоде рассматривается фактическое количество Торговых дней, когда Маркет-мейкер был обязан выполнять свои функции.

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

3.1. Размер вознаграждения Маркет-мейкера за выполнение им в течение Отчетного периода условий, предусмотренных настоящей Программой, определяется суммой вознаграждений, рассчитанных для каждого заявленного Идентификатора(-ов), и рассчитывается по следующей формуле:

$$F = \sum_n \sum_k \sum_i (FIX_i^k + COMM_i^k * R_i),$$

где

F – размер вознаграждения Маркет-мейкера за Отчетный период;

n – порядковый номер Идентификатора, заявленного Маркет-мейкером в Программу;

i – номер Инструмента, определяемый номером соответствующей строки Таблицы из Приложения 1;

k – номер Торгового дня, в котором по i -ому Инструменту для n -ого Идентификатора зафиксировано исполнение обязательств;

$$FIX_i^k = \left\{ \min \left[\frac{fix}{N}; 2000 \right] \right\} \text{ руб., где}$$

fix – величина в рублях, определяемая для каждого инструмента в таблице из Приложения 2;

N – количество всех Идентификаторов всех маркет-мейкеров, участвующих в Программе, по котором зафиксировано исполнение обязательств по i -ому Инструменту за k -й Торговый день;

$COMM_i^k$ - обратная часть комиссионного вознаграждения, уплаченного Маркет-мейкером в соответствии с действующими тарифами ПАО Московская Биржа, Банка НКЦ (АО) по Пассивным сделкам, заключенным Маркет-мейкером по i -ому Инструменту в k -й Торговый день

с использование *n*-ого Идентификатора на основание заявок с объемом не менее установленного Объем двусторонней котировки, установленного для соответствующего временного интервала Торгового дня.

R_i – коэффициент ликвидности *i*-го Инструмента (на первом этапе запуска Программы он равен 1 для всех Инструментов).

Раздел IV. Условия подключения Идентификаторов к Программе

4.1. К Программе допускаются Идентификаторы, по которым в течение 3 календарных месяцев, предшествующих дате подачи Уведомления о присоединении к Программе, Биржей зафиксирован средневзвешенный объем торгов (ADTV) всеми акциями и депозитарными расписками в размере 300 млн рублей. Биржей могут быть допущены к Программе 3 Идентификатора без выше указанного требования по размеру ADTV. В случае выбытия из Программы Идентификатора, допущенного без учета требования к ADTV, на его место Биржей может быть допущен другой Идентификатор без учета требования к ADTV.

4.2. В рамках настоящей Программы допускается указывать не более 1 (одного) Торгово-клирингового счёта (ТКС) и не более 1 (одного) Краткого кода клиента (ККК) для одного Идентификатора.

Приложение 1

Таблица параметров исполнения обязательств Маркет-мейкера

№	Торговый код Инструмента	Временной интервал Торгового дня	Объем двусторонней котировки, шт.	Спрэд двусторонней котировки, %	Достаточный объем, шт.	Период поддержания котировок, мин.
1	2	3	4	5	6	7
1.	AFKS	19:05:00-22:00:00	17 000	0,7	4 250 000	125
		22:00:01-23:49:59	17 000	0,7	4 250 000	85
2.	AFLT	19:05:00-22:00:00	4 000	0,6	1 000 000	125
		22:00:01-23:49:59	4 000	0,6	1 000 000	85
3.	ALRS	19:05:00-22:00:00	6 000	0,45	2 250 000	125
		22:00:01-23:49:59	6 000	0,45	2 250 000	85
4.	CBOM	19:05:00-22:00:00	36 000	0,80	9 000 000	125
		22:00:01-23:49:59	36 000	0,80	9 000 000	85
5.	CHMF	19:05:00-22:00:00	300	0,50	75 000	125
		22:00:01-23:49:59	300	0,50	75 000	85
6.	DSKY	19:05:00-22:00:00	2 000	0,8	500 000	125
		22:00:01-23:49:59	2 000	0,8	500 000	85
7.	FEES	19:05:00-22:00:00	1 600 000	0,70	400 000 000	125
		22:00:01-23:49:59	1 600 000	0,70	400 000 000	85
8.	FIVE	19:05:00-22:00:00	100	0,60	25 000	125
		22:00:01-23:49:59	100	0,60	25 000	85

9.	GAZP	19:05:00-22:00:00	2 600	0,12	1 040 000	125
		22:00:01-23:49:59	2 600	0,12	1 040 000	85
10.	GLTR	19:05:00-22:00:00	700	0,8	175 000	125
		22:00:01-23:49:59	700	0,8	175 000	85
11.	GMKN	19:05:00-22:00:00	20	0,35	7 500	125
		22:00:01-23:49:59	20	0,35	7 500	85
12.	HHRU	19:05:00-22:00:00	100	0,90	25 000	125
		22:00:01-23:49:59	100	0,90	25 000	85
13.	HYDR	19:05:00-22:00:00	500 000	0,70	125 000 000	125
		22:00:01-23:49:59	500 000	0,70	125 000 000	85
14.	IRAO	19:05:00-22:00:00	62 000	0,60	15 500 000	125
		22:00:01-23:49:59	62 000	0,60	15 500 000	85
15.	LKOH	19:05:00-22:00:00	100	0,35	37 500	125
		22:00:01-23:49:59	100	0,35	37 500	85
16.	LSRG	19:05:00-22:00:00	300	0,90	75 000	125
		22:00:01-23:49:59	300	0,90	75 000	85
17.	MAGN	19:05:00-22:00:00	8 000	0,70	2 000 000	125
		22:00:01-23:49:59	8 000	0,70	2 000 000	85
18.	MAIL	19:05:00-22:00:00	200	0,5	50 000	125
		22:00:01-23:49:59	200	0,5	50 000	85
19.	MGNT	19:05:00-22:00:00	100	0,45	37 500	125
		22:00:01-23:49:59	100	0,45	37 500	85
20.	MOEX	19:05:00-22:00:00	3 000	0,50	750 000	125
		22:00:01-23:49:59	3 000	0,50	750 000	85
21.	MTSS	19:05:00-22:00:00	900	0,50	225 000	125
		22:00:01-23:49:59	900	0,50	225 000	85
22.	NLMK	19:05:00-22:00:00	2 000	0,50	500 000	125
		22:00:01-23:49:59	2 000	0,50	500 000	85
23.	NVTK	19:05:00-22:00:00	300	0,50	75 000	125
		22:00:01-23:49:59	300	0,50	75 000	85
24.	OZON	19:05:00-22:00:00	150	0,50	37 500	125
		22:00:01-23:49:59	150	0,50	37 500	85
25.	PHOR	19:05:00-22:00:00	100	0,80	25 000	125
		22:00:01-23:49:59	100	0,80	25 000	85
26.	PIKK	19:05:00-22:00:00	500	0,90	125 000	125
		22:00:01-23:49:59	500	0,90	125 000	85
27.	PLZL	19:05:00-22:00:00	30	0,60	7 500	125
		22:00:01-23:49:59	30	0,60	7 500	85
28.	POGR	19:05:00-22:00:00	11 000	0,5	2 750 000	125
		22:00:01-23:49:59	11 000	0,5	2 750 000	85
29.	POLY	19:05:00-22:00:00	200	0,70	50 000	125
		22:00:01-23:49:59	200	0,70	50 000	85
30.	QIWI	19:05:00-22:00:00	200	0,8	50 000	125
		22:00:01-23:49:59	200	0,8	50 000	85
31.	ROSN	19:05:00-22:00:00	1 100	0,45	412 500	125
		22:00:01-23:49:59	1 100	0,45	412 500	85

32.	RSTI	19:05:00-22:00:00	210 000	0,7	52 500 000	125
		22:00:01-23:49:59	210 000	0,7	52500000	85
33.	RTKM	19:05:00-22:00:00	3 000	0,80	750 000	125
		22:00:01-23:49:59	3 000	0,80	750 000	85
34.	RUAL	19:05:00-22:00:00	8 000	0,80	2 000 000	125
		22:00:01-23:49:59	8 000	0,80	2 000 000	85
35.	SBER	19:05:00-22:00:00	2 600	0,12	1 040 000	125
		22:00:01-23:49:59	2 600	0,12	1 040 000	85
36.	SBERP	19:05:00-22:00:00	1 700	0,50	425 000	125
		22:00:01-23:49:59	1 700	0,50	425 000	85
37.	SNGS	19:05:00-22:00:00	10 000	0,35	3 750 000	125
		22:00:01-23:49:59	10 000	0,35	3 750 000	85
38.	SNGSP	19:05:00-22:00:00	11 000	0,45	4 125 000	125
		22:00:01-23:49:59	11 000	0,45	4 125 000	85
39.	TATN	19:05:00-22:00:00	700	0,45	262 500	125
		22:00:01-23:49:59	700	0,45	262 500	85
40.	TATNP	19:05:00-22:00:00	600	0,70	150 000	125
		22:00:01-23:49:59	600	0,70	150 000	85
41.	TCSG	19:05:00-22:00:00	200	0,80	50 000	125
		22:00:01-23:49:59	200	0,80	50 000	85
42.	TRNFP	19:05:00-22:00:00	2	0,60	500	125
		22:00:01-23:49:59	2	0,60	500	85
43.	UPRO	19:05:00-22:00:00	110 000	0,80	27 500 000	125
		22:00:01-23:49:59	110 000	0,80	27 500 000	85
44.	VTBR	19:05:00-22:00:00	11 000 000	0,35	4 125 000 000	125
		22:00:01-23:49:59	11 000 000	0,35	4 125 000 000	85
45.	YNDX	19:05:00-22:00:00	100	0,50	25 000	125
		22:00:01-23:49:59	100	0,50	25 000	85

Приложение 2

Таблица параметров формулы расчета

Торговый код Инструмента	Значение параметра fix (для каждого Инструмента)
AFKS, ALRS, CHMF, GAZP, GMKN, LKOH, MAGN, MGNT, MOEX, MTSS, NLMK, NVTK, PLZL, ROSN, SBER, SNGS, TATN, VTBR, YNDX	3000 руб.
FEES, HYDR, TATNP	4000 руб.
AFLT, CBOM, DSKY, FIVE, GLTR, HHRU, IRAO, LSRG, MAIL, OZON, PHOR, PIKK, POGR, POLY, QIWI, RSTI, RTKM, RUAL, SBERP, SNGSP, TCSG, TRNFP, UPRO	6000 руб.