

ФЕДЕРАЛЬНАЯ СЛУЖБА ПО
ФИНАНСОВЫМ РЫНКАМ
ЗАРЕГИСТРИРОВАНО

Дата: "10" июня 2009.

в реестре за № 011-10489-000001

Заместитель
руководителя *С.И. Потемкин*



УТВЕРЖДЕНЫ

Советом директоров

ЗАО «ФБ ММВБ»

«8» мая 2009 г. Протокол № 14

Председатель Совета директоров

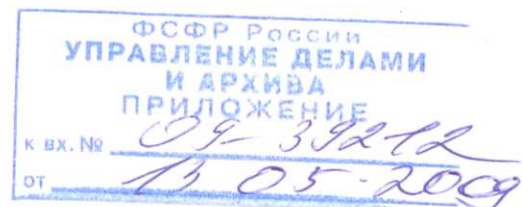
А.И. Потемкин
А.И. Потемкин



ПРАВИЛА

проведения торгов по ценным бумагам

в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»



СОДЕРЖАНИЕ:

- Раздел 1. Термины и определения
- Раздел 2. Общие положения
- Раздел 3. Расписание предоставления услуг
- Раздел 4. Уполномоченные трейдеры
- Раздел 5. Маклер
- Раздел 6. Заявки
- Раздел 7. Условия принятия заявки к регистрации
- Раздел 8. Шаг цены
- Раздел 9. Стандартный лот
- Раздел 10. Особенности проведения торгов по ценным бумагам, за исключением облигаций
- Раздел 11. Особенности проведения торгов по облигациям
- Раздел 12. Порядок взаимодействия с клиринговой организацией. Порядок исполнения сделок
- Раздел 13. Маркет-мейкеры и Специалисты
- Раздел 14. Заключение сделок в Режиме основных торгов
- Раздел 15. Заключение сделок в Режиме торгов «Неполные лоты»
- Раздел 16. Режим переговорных сделок
- Раздел 17. Порядок заключения сделок РЕПО
- Раздел 18. Торги по акциям и облигациям, допущенным к размещению
- Раздел 19. Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» и «Размещение: Адресные заявки»
- Раздел 20. Проведение торгов по приобретению акций и выкупу облигаций
- Раздел 21. Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Облигации Д - Режим основных торгов» и «Облигации Д - РПС»
- Раздел 22. Подведение итогов торгов. Биржевая информация.
- Раздел 23. Чрезвычайные ситуации
- Раздел 24. Порядок мониторинга и контроля за сделками, совершаемыми на Бирже
- Раздел 25. Правила, ограничивающие манипулирование ценами
- Раздел 26. Фондовые индексы

Раздел 27. Уплата комиссионного вознаграждения

Раздел 28. Контроль за исполнением Участниками торгов обязательств по сделкам с ценными бумагами

Раздел 29. Ответственность за нарушение правил совершения операций на Бирже

Раздел 30. Порядок разрешения споров

Приложение 1. Порядок приостановки и возобновления торгов при наступлении чрезвычайных ситуаций (обстоятельств, которые могут быть признаны чрезвычайными ситуациями), а также иных ситуаций, определенных настоящими Правилами, нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

Приложение 2. Форма выписки из реестра сделок

Приложение 3. Форма выписки из реестра заявок

Приложение 3А. Форма выписки из реестра полученных адресных заявок

Приложение 4. Форма выписки по обязательствам Участника торгов по комиссионному вознаграждению

Приложение 5. Форма выписки по обязательствам Участника торгов по уплате возмещения

Приложение 6. Форма уведомления об отказе от возмещения по сделке с ценными бумагами

Приложение 7. Форма уведомления о необходимости внесения компенсационного взноса

Приложение 7А. Форма уведомления об изменении расчетных параметров сделки РЕПО в связи с выплатой купонного дохода по облигациям и/или погашением части основного долга (проведением амортизационной выплаты) по облигациям

Приложение 8. Форма сводного реестра заявок

Приложение 8А. Форма сводного реестра заявок (Аукцион РЕПО)

Приложение 9. Форматы электронных документов

Приложение 10. Форма уведомления об ошибке

Приложение 11. Формы заявок, подаваемые Участниками торгов в Систему торгов

Приложение 12. Список уполномоченных лиц

Приложение 13. Таблица критериев нестандартных сделок

Приложение 14. Процедура урегулирования взаимных требований по сделкам РЕПО

Приложение 15. Методика расчета текущих цен

1. Термины и определения

1.1. В целях настоящих Правил проведения торгов по ценным бумагам в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ» (далее – Правила) применяются следующие термины и определения:

1.1.1. Биржа, ФБ ММВБ — Закрытое акционерное общество “Фондовая биржа ММВБ”.

1.1.2. Аукцион – форма проведения торгов, которая может использоваться как при размещении, так и при обращении ценных бумаг для целей определения оптимальной цены (далее – Аукцион). Торги, проводимые на ФБ ММВБ в форме Аукциона, состоят из периода сбора заявок и периода удовлетворения заявок, подлежащих удовлетворению, в порядке, предусмотренном эмиссионными документами и иными документами, регламентирующими порядок проведения размещения и обращения соответствующего выпуска ценных бумаг.

1.1.3. Внутрдневная сделка РЕПО - сделка РЕПО, надлежащие даты исполнения первой и второй части которой приходятся на один расчетный день (срок сделки РЕПО считается равным нулю).

1.1.4. Дата активации заявки – дата, при наступлении которой возможно заключение сделки(ок) на основании данной заявки.

1.1.5. Дата внесения компенсационного взноса (далее – надлежащая дата внесения компенсационного взноса) – дата, в которую участник торгов ФБ ММВБ обязан исполнить обязательства по внесению компенсационного взноса в соответствии с условиями заключенной сделки РЕПО и настоящими Правилами.

1.1.6. Дата заключения сделки – день, в который в соответствии с настоящими Правилами в Системе торгов ФБ ММВБ зарегистрирована сделка с ценными бумагами.

1.1.7. Дата исполнения сделки (далее – дата исполнения, надлежащая дата исполнения) - дата, в которую в соответствии с условиями заключенной сделки с ценными бумагами и настоящими Правилами участники торгов ФБ ММВБ обязаны исполнить свои обязательства по сделке (по первой или по второй части сделки РЕПО).

1.1.8. Дата прекращения исполнения обязательств по сделке с ценными бумагами (далее - дата неисполнения):

- первый расчетный день после надлежащей даты исполнения сделки с ценными бумагами с кодом расчетов T0 или Z0;
- второй расчетный день после надлежащей даты исполнения сделки с ценными бумагами с кодом расчетов B0-B05 или B06-B30;
- второй расчетный день после надлежащей даты исполнения первой части сделки РЕПО, заключенной с кодом расчетов S0-S2 и не являющейся внутрдневной, в

случае неисполнения обязательств по первой части сделки РЕПО;

- первый расчетный день после надлежащей даты исполнения первой части внутридневной сделки РЕПО, заключенной с кодом расчетов S0-S2, в случае неисполнения обязательств по первой части сделки РЕПО;

- первый расчетный день после надлежащей даты исполнения второй части внутридневной сделки РЕПО, заключенной с кодом расчетов Rb или S0-S2;

- второй расчетный день после надлежащей даты исполнения второй части сделки РЕПО, не являющейся внутридневной и заключенной с кодом расчетов Z0, Rb или S0-S2.

1.1.9. Двусторонняя котировка – заявки маркет-мейкера на покупку и заявки маркет-мейкера на продажу ценных бумаг, поданные от своего имени и за свой счет, либо от своего имени по поручению и за счет клиента с ценовыми условиями, при которых величина фактического спреда, предусмотренного в Разделе 13 «Маркет-мейкеры и Специалисты» настоящих Правил, меньше или равна величине предельного спреда, объем которых не меньше минимально допустимого объема (далее - МДО).

1.1.10. Дискретный аукцион – период Режима основных торгов, проведение которого устанавливается по решению Генерального директора Биржи, в ходе которого осуществляется в порядке, предусмотренном в Разделе 14 «Заключение сделок в Режиме основных торгов», определение цены дискретного аукциона по ценной бумаге, используемой для установления предельных границ колебания цены ценной бумаги, предусмотренных в Разделе 25 «Правила, ограничивающие манипулирование ценами».

1.1.11. Заявитель - эмитент ценных бумаг (Управляющая компания, Управляющий ипотечным покрытием) или его(ее) официальный представитель, подавший заявление о допуске ценных бумаг к размещению на Бирже в соответствии с Правилами листинга, допуска к размещению и обращению ценных бумаг в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ» (далее – Правила листинга).

1.1.12. Клиент – юридическое или физическое лицо, зарегистрированное в Системе торгов ФБ ММВБ на основании данных, полученных от участника торгов ФБ ММВБ.

1.1.13. Клиринговая организация - ЗАО «Московская межбанковская валютная биржа» и/или иная организация, имеющая лицензию на осуществление клиринговой деятельности на рынке ценных бумаг и заключившая с ФБ ММВБ соответствующий договор.

1.1.14. Код расчетов - код, определяющий условия принятия заявки к исполнению и условия исполнения сделки. Перечень допустимых кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается Генеральным директором Биржи. По решению Генерального директора Биржи могут быть изменены коды расчетов, предусмотренные для отдельных видов заявок в соответствии с Разделом 6 «Заявки» настоящих Правил. Для заключения сделок

на ФБ ММВБ могут использоваться следующие коды расчетов:

- Код расчетов T0 – код расчетов, используемый при заключении сделки с ценными бумагами, подлежащей включению в клиринговый пул Клиринговой организации на условиях многостороннего клиринга, и определяющий, что при совершении сделки проводится процедура контроля обеспечения, а надлежащей датой исполнения сделки с ценными бумагами является Дата заключения сделки.

- Код расчетов Z0 – код расчетов, используемый при заключении сделки с ценными бумагами (в том числе сделки РЕПО), подлежащей включению в клиринговый пул Клиринговой организации на условиях простого клиринга (для сделок РЕПО простой клиринг проводится по их первым частям), и определяющий, что при совершении сделки проводится процедура контроля обеспечения, надлежащей датой исполнения сделки с ценными бумагами или первой части сделки РЕПО является Дата заключения сделки, а надлежащей датой исполнения второй части сделки РЕПО является дата, определяемая как $T + k$, где T – надлежащая дата исполнения первой части сделки РЕПО, а k – Срок сделки РЕПО.

- Коды расчетов от B0 до B05 (далее - B0-B05) – коды расчетов, используемые при заключении сделок с ценными бумагами, подлежащих включению в клиринговый пул Клиринговой организации, и определяющие, что при совершении сделок не проводится процедура контроля обеспечения, надлежащей датой исполнения сделки с ценными бумагами является дата, определяемая как $T+n$, где T - дата заключения сделки, а n – число календарных дней, значение которого определяется последней цифрой соответствующего кода расчетов по сделке (может принимать одно из целых значений от 0 до 5).

- Коды расчетов от B06 до B30 (далее - B06-B30) – коды расчетов, используемые при заключении сделок с ценными бумагами, подлежащих включению в клиринговый пул Клиринговой организации, и определяющие, что при совершении сделок не проводится процедура контроля обеспечения, надлежащей датой исполнения сделки с ценными бумагами является дата, определяемая как $T+n$, где T - дата заключения сделки, а n – число календарных дней, значение которого определяется последними двумя цифрами соответствующего кода расчетов по сделке (может принимать одно из целых значений от 6 до 30).

- Коды расчетов S0, S1, S2 (далее - S0-S2) – коды расчетов, используемые при заключении сделок РЕПО, подлежащих включению в клиринговый пул Клиринговой организации, и определяющие, что при совершении сделок не проводится процедура контроля обеспечения, надлежащей датой исполнения первой части сделки РЕПО является дата, определяемая как $T+x$, где T - дата заключения сделки РЕПО, а x – число расчетных дней, значение которого определяется первой цифрой соответствующего кода расчетов по сделке (может принимать одно из целых значений от 0 до 2), а надлежащей

датой исполнения второй части сделки РЕПО является дата, определяемая как $T+x+k$, где $T+x$ – надлежащая дата исполнения первой части сделки РЕПО, а k – Срок сделки РЕПО.

- Код расчетов R_b – код расчетов, используемый при заключении сделки РЕПО, подлежащей включению в клиринговый пул Клиринговой организации, и определяющий, что при совершении сделки проводится процедура контроля обеспечения, надлежащей датой исполнения первой части сделки РЕПО является Дата заключения сделки, а надлежащей датой исполнения второй части сделки РЕПО является дата, определяемая как $T+k$, где T - дата заключения сделки РЕПО, а k – Срок сделки РЕПО.

1.1.15. Код Участника торгов, Идентификатор Участника торгов – буквенно-цифровые коды, присваиваемые участнику торгов ФБ ММВБ в соответствии с Правилами допуска к участию в торгах Закрытого акционерного общества «Фондовая биржа ММВБ».

1.1.16. Код клиента, Краткий код клиента – буквенно-цифровые коды, присваиваемые клиентам участника торгов ФБ ММВБ в соответствии с Правилами допуска к участию в торгах Закрытого акционерного общества «Фондовая биржа ММВБ».

1.1.17. Компенсационный взнос – сумма денежных средств или количество ценных бумаг, подлежащие уплате (поставке) одним Участником торгов другому Участнику торгов, являющемуся его контрагентом по сделке РЕПО, и условиями которой предусмотрены максимальные и минимальные предельные значения дисконта) в качестве частичного предварительного исполнения им своих обязательств по второй части этой сделки РЕПО, в размере, определяемом в соответствии с настоящими Правилами.

1.1.18. Котировальный перерыв - период времени, в течение которого Маркет-мейкер или Специалист вправе не исполнять обязательства, предусмотренные в Разделе 13 «Маркет-мейкеры и Специалисты».

1.1.19. Конкурс по определению ставки купона - форма проведения торгов, которая может использоваться как при размещении, так и при обращении облигаций для целей определения ставки купона. Торги, проводимые в форме Конкурса по определению ставки купона (далее – Конкурс), состоят из периода сбора заявок и периода удовлетворения заявок, подлежащих удовлетворению, в порядке, предусмотренном эмиссионными документами и иными документами, регламентирующими порядок проведения размещения и обращения соответствующего выпуска облигаций.

1.1.20. Маклер - работник Биржи, уполномоченный осуществлять ведение торгов на ФБ ММВБ и контролировать исполнение настоящих Правил в части объявления (подачи) заявок и совершения сделок на Бирже (за исключением контроля, осуществляемого в соответствии с Разделами 24 «Порядок мониторинга и контроля за сделками, совершаемыми на Бирже» и 25 «Правила, ограничивающие манипулирование ценами»).

1.1.21. Маркет-мейкер - участник торгов ФБ ММВБ, принимающий на себя

дополнительные обязательства подавать заявки и совершать сделки с ценными бумагами в соответствии с требованиями Раздела 13 «Маркет-мейкеры и Специалисты» настоящих Правил, на основании Соглашений, заключаемых с ФБ ММВБ.

1.1.22. Максимальное предельное значение дисконта – условие сделки РЕПО, которое может устанавливаться контрагентами при ее заключении.

1.1.23. Минимальное предельное значение дисконта – условие сделки РЕПО, которое может устанавливаться контрагентами при ее заключении.

1.1.24. Начальное значение дисконта (далее – начальный дисконт) – обязательное условие сделки РЕПО, значение которого определяется в Системе торгов ФБ ММВБ при ее заключении. Начальное значение дисконта либо указывается контрагентами в заявке на заключение сделки РЕПО, либо рассчитывается в Системе торгов ФБ ММВБ на основе значений других реквизитов, указываемых в заявке на заключение сделки РЕПО.

1.1.25. Нетиповая сделка – сделка, заключенная в предторговый период, или в ходе дискретного аукциона, или в ходе торговой сессии Режимы основных торгов, цена, объем или иные условия которой соответствуют установленным решением Генерального директора Биржи параметрам.

1.1.26. Объем сделки (заявки) – произведение цены (в валюте сделки (заявки)) на количество ценных бумаг в заключенной сделке (поданной заявке). Для сделки (заявки) РЕПО - Сумма РЕПО на дату надлежащего исполнения первой части.

1.1.27. Переменное возмещение – способ обеспечения исполнения обязательств по сделкам, заключенным Участниками торгов в соответствии с настоящими Правилами и учитываемым в соответствии с Правилами клиринга. Переменное возмещение является денежным обязательством Участника торгов по уплате в случае неисполнения обязательств по сделкам Участнику торгов – контрагенту по сделке с ценными бумагами денежных средств. Размер денежного обязательства определяется в соответствии с Разделом 16 «Режим переговоров сделок», Разделом 17 «Порядок заключения сделок РЕПО» или Разделом 21 «Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Облигации Д - Режим основных торгов» и «Облигации Д - РПС»» настоящих Правил, а денежная сумма, составляющая такое обязательство по сделке, удерживается в порядке, предусмотренном Правилами клиринга. Перечень ценных бумаг, по сделкам с которыми определяется переменное возмещение, а также перечень режимов торгов, при заключении сделок в которых переменное возмещение устанавливается, утверждается решением Генерального директора Биржи.

1.1.28. Правила электронного документооборота (Правила ЭДО) - Правила электронного документооборота ЗАО «Московская межбанковская валютная биржа», в соответствии с которыми Биржа является организатором подсистемы системы электронного документооборота, используемой для взаимодействия с участниками торгов ФБ ММВБ.

1.1.29. Правила допуска к участию в торгах Закрытого акционерного общества «Фондовая биржа ММВБ» (далее – Правила допуска) – внутренний документ ФБ ММВБ, регламентирующий условия и порядок включения в состав участников торгов ФБ ММВБ, а также условия допуска к участию в торгах на ФБ ММВБ.

1.1.30. Правила клиринга - внутренний документ Клиринговой организации, в котором установлен порядок определения, учета и исполнения обязательств по сделкам, заключенным на ФБ ММВБ в соответствии с настоящими Правилами.

1.1.31. Предельные границы колебания цены ценной бумаги – выраженное в процентах максимальное отклонение цены, указываемой в заявке, при превышении которого заявки, поданные участником торгов ФБ ММВБ, не будут регистрироваться в Системе торгов.

1.1.32. Расчетная цена для целей определения отклонений цен – цена ценной бумаги, определяемая в ходе дискретного аукциона (далее - цена дискретного аукциона), либо устанавливаемая решением Генерального директора, и используемая для установления предельных границ колебания цены ценной бумаги, при превышении которых заявки не регистрируются в Системе торгов в соответствии с ограничениями, предусмотренными в Разделе 7 «Условия принятия заявки к регистрации» и в Разделе 25 «Правила, ограничивающие манипулирования ценами».

1.1.33. Расчетный день - день, в который по сделкам, заключенным с соответствующей ценной бумагой, Клиринговой организацией проводится клиринг.

1.1.34. Режим торгов – торги, проводимые в период времени, устанавливаемый в порядке, предусмотренном Разделом 2 «Общие положения» настоящих Правил, которые характеризуются определенной совокупностью правил подачи заявок и условий регистрации сделок на основании поданных заявок. Режим торгов может состоять из одного или нескольких периодов.

1.1.35. Сделка с ценными бумагами (далее также – сделка, сделка купли-продажи ценных бумаг, сделка РЕПО, сделка за российские рубли, сделка за иностранную валюту) – сделка, заключенная между участниками торгов ФБ ММВБ на Бирже в соответствии с настоящими Правилами.

1.1.36. Сделка РЕПО – заключенная между Участниками торгов на Бирже в соответствии с настоящими Правилами сделка по продаже (покупке) ценных бумаг (первая часть сделки РЕПО), с обязательством обратной покупки (продажи) этих же ценных бумаг (вторая часть сделки РЕПО) через определенный условиями такой сделки срок (срок сделки РЕПО) и по определенной условиями такой сделки цене (цена второй части сделки РЕПО).

1.1.37. Система торгов ФБ ММВБ (далее – Система торгов) - совокупность программно-технических средств, представляющая собой подсистему программно-

технического комплекса ЗАО «Московская межбанковская валютная биржа», предназначенную для заключения сделок с ценными бумагами на ФБ ММВБ, эксплуатация которой обеспечивается в соответствии с договором, заключаемым между ФБ ММВБ и ЗАО «Московская межбанковская валютная биржа» как Техническим центром.

1.1.38. Специалист - участник торгов ФБ ММВБ, принимающий на себя дополнительные обязательства подавать заявки в соответствии с требованиями Раздела 13 «Маркет-мейкеры и Специалисты» настоящих Правил, на основании Соглашения, заключаемого с ФБ ММВБ, при условии получения уведомления эмитента ценной бумаги в соответствии с Правилами допуска.

1.1.39. Средневзвешенная цена – цена одной ценной бумаги определенного эмитента, вида, категории (типа), определяемая как результат от деления общего объема всех сделок с указанной ценной бумагой, заключенных в Режиме основных торгов в течение данного торгового дня, на общее количество ценных бумаг, являющихся предметом этих сделок. В случае, если по ценной бумаге определенного эмитента, вида, категории (типа) предусмотрено заключение сделок одновременно за российские рубли и за иностранную валюту, под средневзвешенной ценой данной ценной бумаги в целях настоящих Правил понимается средневзвешенная цена, определяемая как результат от деления общего объема всех сделок с указанной ценной бумагой за российские рубли и иностранную валюту, заключенных в Режиме основных торгов в течение данного торгового дня, на общее количество ценных бумаг, являющихся предметом этих сделок. При этом цены сделок за иностранную валюту пересчитываются в российские рубли по курсу Банка России на дату их заключения.

1.1.40. Средневзвешенная цена покупки (средневзвешенная цена продажи) – величина, рассчитываемая как отношение общего объема всех заявок на покупку (заявок на продажу) указанной ценной бумаги, поданных в Режиме основных торгов в течение данного торгового дня, по состоянию на определенный момент времени, к общему количеству ценных бумаг, указанных в этих заявках.

1.1.41. Срок сделки РЕПО - число календарных дней, определяемое при заключении сделки РЕПО. Срок сделки РЕПО исчисляется с надлежащей даты исполнения первой части сделки РЕПО.

1.1.42. Ставка РЕПО – положительная, отрицательная или равная нулю величина, выраженная в процентах годовых, указываемая Участником торгов ФБ ММВБ в заявке РЕПО, используемая для расчета цены второй части сделки РЕПО.

1.1.43. Стандартный лот - минимально допустимое количество ценных бумаг в одной заявке.

1.1.44. Сумма РЕПО – условие сделки РЕПО, значение которого определяется в Системе торгов ФБ ММВБ при ее заключении. Значение суммы РЕПО либо указывается

контрагентами в заявке на заключение сделки РЕПО, либо рассчитывается в Системе торгов ФБ ММВБ на основе значений других реквизитов заявки на заключение сделки РЕПО.

1.1.45. Технический центр – ЗАО «Московская межбанковская валютная биржа», обеспечивающая технический доступ в Систему торгов Участникам торгов ФБ ММВБ.

1.1.46. Текущая средневзвешенная цена – средневзвешенная цена, рассчитанная на определенный момент времени в ходе Режима основных торгов.

1.1.47. Текущее значение дисконта (далее – текущий дисконт) – переменная величина, выраженная в процентах и отражающая соотношение между суммой текущего обязательства (в денежном выражении) участника торгов ФБ ММВБ – продавца по первой части сделки РЕПО и рыночной стоимостью ценных бумаг, составляющих текущее обязательство участника торгов ФБ ММВБ – покупателя по первой части сделки РЕПО, которая каждый торговый день рассчитывается в Системе торгов ФБ ММВБ в соответствии с настоящими Правилами по заключенной сделке РЕПО в течение Срока сделки РЕПО (если условиями этой сделки РЕПО предусмотрены максимальные и минимальные предельные значения дисконта).

1.1.48. Торги - объявление (подача в Систему торгов) заявок с целью заключения сделок и/или заключение сделок на основании поданных заявок на ФБ ММВБ.

1.1.49. Торгово-клиринговый счет - буквенно-цифровой код, указываемый в качестве одного из реквизитов заявки и идентифицирующий учетный регистр Клиринговой организации, который устанавливает однозначное соответствие между позицией по денежным средствам и позицией по ценным бумагам Участника торгов ФБ ММВБ.

1.1.50. Торговые дни - дни, в которые на ФБ ММВБ проводятся торги ценными бумагами в соответствии с настоящими Правилами.

1.1.51. Уполномоченный трейдер (далее - трейдер) - физическое лицо, являющееся работником участника торгов ФБ ММВБ, уполномоченное им объявлять (подавать) заявки и заключать сделки, а также проводить иные операции с ценными бумагами в Системе торгов от имени Участника торгов на основании доверенности.

1.1.52. Участник торгов ФБ ММВБ (далее - Участник торгов) - юридическое лицо, включенное в состав участников торгов ФБ ММВБ в соответствии с требованиями Правил допуска и имеющее право объявлять (подавать) заявки и совершать (заключать) сделки с ценными бумагами на Бирже.

1.1.53. Участник торгов ФБ ММВБ - кредитная организация или Участник торгов КО - Участник торгов ФБ ММВБ, имеющий лицензию на осуществление банковских операций.

1.1.54. Фиксированное возмещение - способ обеспечения исполнения обязательств

по сделке, заключенной Участниками торгов в соответствии с настоящими Правилами и учитываемым в соответствии с Правилами клиринга. Фиксированное возмещение является денежным обязательством Участника торгов по уплате Участнику торгов – контрагенту по сделке с ценными бумагами денежных средств. Размер данного денежного обязательства (ставка фиксированного возмещения) устанавливается при подаче заявки Участником торгов в соответствии с Разделом 16 «Режим переговорных сделок», Разделом 17 «Порядок заключения сделок РЕПО» или Разделом 21 «Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Облигации Д - Режим основных торгов» и «Облигации Д - РПС»» настоящих Правил, а денежная сумма, составляющая такое обязательство по сделке, заключенной на основании данной заявки, удерживается в порядке, предусмотренном Правилами клиринга. Предельные значения и точность указания ставки фиксированного возмещения в заявках устанавливается решением Генерального директора Биржи.

1.1.55. Цена первой части сделки РЕПО - условие сделки РЕПО, значение (размер) которого рассчитывается в Системе торгов ФБ ММВБ на основе значений других реквизитов заявки, на основании которой заключена эта сделка РЕПО в порядке, установленном в Разделе 17 «Порядок заключения сделок РЕПО» настоящих Правил.

1.1.56. Цена второй части сделки РЕПО - цена, рассчитываемая в Системе торгов в порядке, установленном в Разделе 17 «Порядок заключения сделок РЕПО» настоящих Правил.

1.1.57. Цена возмещения – цена ценной бумаги, определяемая в Системе торгов для ценных бумаг, по сделкам с которыми определяется переменное возмещение. Цена возмещения рассчитывается каждый торговый день для определения размера переменного возмещения по сделкам путем деления общего объема всех сделок с ценной бумагой, заключенных в предторговый период, в ходе дискретного аукциона и в ходе торговой сессии Режиме основных торгов (за исключением нетиповых сделок и сделок за иностранную валюту) на общее количество ценных бумаг, являющихся предметом этих сделок за данный торговый день. В случае невозможности определить цену возмещения по ценной бумаге в данный торговый день ценой возмещения текущего торгового дня считается последняя рассчитанная в Системе торгов ФБ ММВБ цена возмещения.

1.1.58. Цена предторгового периода - единая цена, по которой заключаются сделки в предторговом периоде Режиме основных торгов, определяемая в порядке, предусмотренном в Разделе 14 «Заключение сделок в Режиме основных торгов» настоящих Правил.

1.1.59. Цена послеторгового периода - единая цена, по которой заключаются сделки в послеторговом периоде Режиме основных торгов, определяемая в порядке, предусмотренном в Разделе 14 «Заключение сделок в Режиме основных торгов» настоящих Правил.

1.1.60. Ценные бумаги - эмиссионные ценные бумаги, а также иные ценные бумаги, в том числе инвестиционные паи и ипотечные сертификаты участия, в том смысле, в каком они определяются законодательством Российской Федерации, допущенные к торгам на ФБ ММВБ в соответствии с Правилами листинга.

1.1.61. Ценовая нестабильность ценной бумаги - заключение с ценной бумагой десяти и более сделок в ходе торговой сессии Режимы основных торгов в совокупном объеме не менее 300 тысяч рублей по цене, отличной от средневзвешенной цены предыдущего торгового дня, более чем на 20%, при условии, что в предыдущий торговый день в ходе торговой сессии Режимы основных торгов с ценной бумагой заключено не менее 10 сделок и их совокупный объем составил не менее 300 тысяч рублей.

1.1.62. Шаг цены - минимально возможная разница между ценами, указанными в заявках на покупку/продажу ценных бумаг.

1.1.63. Шаг дисконта - минимально возможная разница между значениями дисконта, указанными в заявках на заключение сделок РЕПО.

1.2. Термины, специально не определенные в настоящих Правилах, используются в значениях, установленных иными внутренними документами ФБ ММВБ, регулирующими деятельность ФБ ММВБ, Правилами клиринга, а также законами, нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

2. Общие положения

2.1. Настоящие Правила приняты в соответствии с Уставом Биржи, другими внутренними документами Биржи, законами, нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

2.2. Настоящие Правила устанавливают правила заключения (совершения) и сверки сделок, правила регистрации сделок, порядок исполнения сделок, правила, ограничивающие манипулирование ценами, расписание предоставления услуг Биржей, а также порядок мониторинга и контроля за сделками (в том числе порядок приостановления и возобновления торгов, порядок проведения проверок нестандартных сделок, методику расчета текущих цен ценных бумаг).

2.3. Биржа организует проведение торгов по ценным бумагам, регистрирует сделки с ценными бумагами и контролирует их исполнение.

2.4. Торги на Бирже проводятся в торговые дни в соответствии с расписанием, предусмотренным в Разделе 3 «Расписание предоставления услуг» настоящих Правил.

Торговым днем считается каждый рабочий день, если иное не определено решением Дирекции Биржи.

2.5. Торги по ценным бумагам могут проводиться в следующих режимах торгов:

- Режим основных торгов;
- Режим торгов «Облигации Д - Режим основных торгов»;
- Режим торгов «Неполные лоты»;
- Режим переговорных сделок (РПС);
- Режим торгов «Облигации Д - РПС»;
- Режим торгов «Аукцион РЕПО»;
- Режим торгов «РЕПО с акциями»;
- Режим торгов «РЕПО с облигациями»;
- Режим торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО»;
- Режим торгов «РЕПО с Банком России: фикс.ставка»;
- Режим торгов «Размещение: Аукцион»;
- Режим торгов «Размещение: Адресные заявки»;
- Режим торгов «Выкуп: Аукцион»;
- Режим торгов «Выкуп: Адресные заявки».

Режимы торгов могут состоять из отдельных периодов режима торгов (далее – период). Порядок подачи заявок и заключения сделок в каждом из Режимов торгов (периоде) определен в соответствующем разделе настоящих Правил.

Решением Генерального директора Биржи по ценной бумаге может быть ограничен перечень допустимых Режимов торгов.

2.6. Время начала и окончания торгов по ценным бумагам в отдельных Режимов торгов, включая время начала каждого периода и время окончания каждого из периодов, из которых состоят отдельные Режимы торгов устанавливается решением Дирекции Биржи, за исключением определения времени проведения Конкурса и/или Аукциона, время проведения которых устанавливаются решением Генерального директора Биржи и/или иного уполномоченного лица в случаях, установленных Генеральным директором Биржи. Допускается установление по решению Дирекции Биржи, а в случае проведения Конкурса и/или Аукциона по решению Генерального директора Биржи, периода(ов), в ходе которого(ых) допускается для отдельной ценной бумаги объявление (подача) заявок только на покупку или заявок на продажу и/или заключение сделок.

2.7. Решением Генерального директора Биржи может быть установлен перечень допустимых кодов расчетов по ценной бумаге в отдельном Режиме торгов (периоде), для

определенного типа заявки.

2.8. Заключение сделок в Системе торгов осуществляется в следующем порядке:

2.8.1. Сделки с ценными бумагами заключаются в Системе торгов на основании объявленных (поданных) Участниками торгов заявок противоположной направленности. Соответствие заявок противоположной направленности устанавливается в Системе торгов в порядке, предусмотренном в Разделах 6 и 7 настоящих Правил. Заключение сделок в Системе торгов в порядке, предусмотренном настоящими Правилами, является заключением сделок путем обмена документами посредством электронной связи.

2.8.2. Моментом заключения Участником торгов сделки считается момент ее регистрации в Системе торгов. При этом в Системе торгов автоматически фиксируется время регистрации каждой сделки и ей присваивается уникальный идентификационный номер.

2.8.3. Порядок (способы) совершения сделок при размещении и обращении ценных бумаг предусмотрен в Разделах 6, 7, 10, 11, 14, 15, 16, 17, 18, 19, 20 и 21 настоящих Правил. При обращении ценных бумаг решением Генерального директора Биржи могут дополнительно устанавливаться условия обращения ценной бумаги с использованием порядка (способов) объявления (подачи заявок) и заключения сделок, определенного(ых) в Разделах 18, 19, 20 и 21 настоящих Правил, а также порядок прекращения обращения ценной бумаги на указанных условиях.

2.8.4. Биржа обеспечивает Участникам торгов равные условия по заключению сделок с ценными бумагами в Системе торгов.

2.8.5. Условия, на которых заключаются сделки купли-продажи ценных бумаг, предусмотренные настоящими Правилами, не могут быть изменены Участниками торгов после их регистрации в Системе торгов.

2.9. Участники торгов имеют право заключать сделки:

- от своего имени и за свой счет;
- от своего имени, по поручению и за счет своих клиентов;
- от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении.

При размещении и приобретении акций и облигаций Участник торгов, выполняющий по поручению Эмитента функции продавца/покупателя, заключает сделки от своего имени и за счет Эмитента ценных бумаг.

2.10. Участники торгов обязаны исполнять свои обязательства по сделкам с ценными бумагами, в соответствии с требованиями, определенными в настоящих Правилах, в порядке, установленном в Правилах клиринга.

2.11. В торгах по ценным бумагам могут принимать участие только Участники торгов.

2.12. Участники торгов обязаны соответствовать требованиям, установленным внутренними документами Биржи, федеральными законами, нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

2.13. Участники торгов могут участвовать в торгах с рабочих мест, находящихся в торговых залах Технического центра, а также с удаленных рабочих мест, находящихся вне торговых залов Технического центра.

2.14. Устанавливается следующий порядок применения кодов Участников торгов на Бирже и их клиентов, присвоенных в соответствии с Правилами допуска.

2.14.1. Биржа присваивает Участнику торгов в соответствии с Правилами допуска следующие специальные коды:

- буквенно-цифровой код Участника торгов (далее - код Участника торгов). В случаях, предусмотренных в нормативных правовых актах федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иных нормативных правовых актах Российской Федерации, Участнику торгов может быть присвоено более одного кода Участника торгов;

- буквенно-цифровой код Участника торгов в Системе торгов (далее - идентификатор Участника торгов). Допускается присвоение Участнику торгов более одного идентификатора при выполнении Участником торгов требований, определенных внутренними документами ФБ ММВБ.

2.14.2. Код Участника торгов отражается в реестре заявок и реестре сделок, формируемых ФБ ММВБ по окончании каждого торгового дня. Идентификатор Участника торгов используется при подаче Участником торгов заявок на заключение сделок в Системе торгов.

2.14.3. Подача заявки с указанием любого из присвоенных Участнику торгов в соответствии с Правилами допуска идентификаторов Участника торгов означает безусловное согласие такого Участника торгов на то, что сделка, которая может быть им заключена в Системе торгов на основании данной заявки, заключается в соответствии с Правилами проведения торгов по ценным бумагам в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ», которые являются неотъемлемой частью такой сделки. Участник торгов согласен с тем, что все споры и разногласия, возникающие из заключенной в Системе торгов сделки (сделок) или в связи с ними, в том числе, касающиеся ее (их) исполнения, нарушения, прекращения, признания ее (их) недействительной(ыми) (ничтожной(ыми) или незаключенной(ыми)), подлежат разрешению в Арбитражной комиссии при ЗАО «Московская межбанковская валютная биржа» в соответствии с документами, определяющими ее правовой статус и порядок разрешения споров, действующими на момент подачи искового заявления. Решения Арбитражной комиссии при ЗАО «Московская межбанковская валютная биржа» являются

окончательными и обязательными для исполнения. Неисполненное добровольно решение Арбитражной комиссии при ЗАО «Московская межбанковская валютная биржа» подлежит принудительному исполнению в соответствии с законодательством Российской Федерации или законодательством страны места принудительного исполнения и международными соглашениями.

2.14.4. ФБ ММВБ присваивает клиентам Участника торгов следующие специальные коды:

- буквенно-цифровой код клиента Участника торгов (далее – код клиента). В случаях, предусмотренных в нормативных правовых актах федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иных нормативных правовых актах Российской Федерации, клиенту Участника торгов может быть присвоено более одного кода клиента;
- краткий буквенно-цифровой код клиента Участника торгов в Системе торгов (далее - краткий код клиента).

2.14.5. Допускается присвоение клиенту Участника торгов более одного краткого кода клиента.

2.14.6. Код клиента отражается в реестре заявок и реестре сделок, формируемых ФБ ММВБ по окончании каждого торгового дня. Краткий код клиента используется при подаче Участником торгов заявок на заключение сделок в Системе торгов.

2.15. Объявление (подача в Систему торгов) заявок и/или заключение сделок на основании поданных заявок на ФБ ММВБ проводится по ценным бумагам, допущенным к торгам на ФБ ММВБ в соответствии с Правилами листинга. Внесение сведений(изменение сведений) о допущенных к торгам на Бирже ценных бумагах в Системе торгов может осуществляться на основании:

- решения Дирекции Биржи, в котором определены реквизиты(параметры) допущенной к размещению или обращению ценной бумаги;
- решения Генерального директора Биржи, в котором определены особенности проведения торгов по допущенной к размещению или обращению ценной бумаге;
- документов, представленных заявителем и определяющих порядок размещения и/или обращения ценных бумаг;
- документов об объединении выпусков ценных бумаг, а также о конвертации ценных бумаг, и/или иных документов, полученных от Клиринговой организации;
- иных документов, являющихся основанием для принятия решения в соответствии с Правилами листинга и настоящими Правилами.

2.16. Настоящие Правила, а также изменения и дополнения к ним утверждаются Советом директоров ФБ ММВБ и вступают в силу после регистрации их Федеральной

службой по финансовым рынкам в дату, определяемую Советом директоров ФБ ММВБ или Дирекцией ФБ ММВБ по поручению Совета директоров ФБ ММВБ.

2.17. Текст утвержденных Советом директоров ФБ ММВБ и зарегистрированных Федеральной службой по финансовым рынкам Правил (изменений и дополнений в них) раскрывается через представительство ФБ ММВБ в сети Интернет в срок не позднее 12 дней с момента их регистрации Федеральной службой по финансовым рынкам. По требованию (запросу) Участника торгов текст соответствующего документа представляется Биржей на бумажном носителе.

О вступлении в силу настоящих Правил (изменений и дополнений в них) Участники торгов и иные заинтересованные лица извещаются путем раскрытия через представительство ФБ ММВБ в сети Интернет информационного сообщения о дате вступления их в силу и текста документа, утвержденного Советом директоров ФБ ММВБ, не позднее, чем за три рабочих дня до даты вступления их в силу Правил (изменений и дополнений в них). Участникам торгов дополнительно направляются уведомления о дате вступления в силу Правил (изменений и дополнений в них) в виде электронных документов категории «В» в формате «PDF» по форме оригинала уведомления на бумажном носителе не позднее, чем за три рабочих дня до даты вступления их в силу.

3. Расписание предоставления услуг

3.1. Устанавливается следующее расписание предоставления Биржей услуг:

- Проведение торгов (время торгового дня) - начало торгового дня 10-00 (по моск. вр.); окончание торгового дня 18-00 (по моск. вр.).

Биржа приостанавливает торги по ценной бумаге (ценным бумагам) и возобновляет их в случаях, предусмотренных требованиями нормативных правовых актов федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг.

- Подведение итогов торгов, подготовка отчетных документов по итогам торгов и направление их Участникам торгов - начало 18-00 (по моск. вр.) текущего торгового дня; окончание 10-00 (по моск. вр.) следующего торгового дня, если иной срок не предусмотрен нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг.

3.2. В случаях, предусмотренных в Приложении № 1 к настоящим Правилам, в расписание предоставления услуг Биржи могут быть внесены изменения и дополнения. Сообщения об изменениях в расписании предоставления услуг, в том числе о времени начала и окончания торгов, передаются в течение торгового дня средствами Системы торгов.

3.3. Участники торгов не менее чем за 3 рабочих дня извещаются об изменениях в расписании предоставления услуг, в том числе о времени начала и окончания торгов (кроме случаев, предусмотренных в Приложении № 1 к настоящим Правилам), если иной порядок уведомления не определен решением Дирекции Биржи или в случаях проведения конкурса и/или аукциона - решением Генерального директора Биржи и/или иного уполномоченного лица в случаях, установленных Генеральным директором Биржи.

4. Уполномоченные трейдеры

4.1. К заключению сделок на Бирже от имени Участника торгов допускаются только трейдеры - физические лица, допущенные к участию в торгах по ценным бумагам в соответствии с Правилами допуска с учетом требований нормативных правовых актов федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иных нормативных правовых актов Российской Федерации, а также иных внутренних документов Биржи.

4.2. Участник торгов несет ответственность за все действия, совершаемые его трейдерами на Бирже. Биржа не несет ответственности за последствия ошибочных или несанкционированных действий трейдеров.

5. Маклер

5.1. Со стороны Биржи полномочия по ведению торгов и контролю за надлежащим исполнением настоящих Правил Участниками торгов и их представителями при совершении операций на Бирже возлагаются на Маклера.

5.2. Маклер назначается из числа работников Биржи приказом Генерального директора Биржи.

5.3. Маклер осуществляет подготовку, запуск, приостановку, возобновление и прекращение торгов.

5.4. Маклер управляет ходом торгов в соответствии с требованиями настоящих Правил, осуществляет оперативное взаимодействие с трейдерами и представителями эмитентов, а также координирует в ходе торгов деятельность представителей подразделений Биржи, задействованных в проведении торгов, и представителей Технического центра.

5.5. Маклер имеет право:

- требовать неукоснительного исполнения Участниками торгов настоящих Правил;

- на основании письменной просьбы Участника торгов разрешать присутствовать в торговом зале лицам, не являющимся трейдерами, при условии, что это не мешает проведению торгов;
- делать официальные объявления и сообщения по вопросам, связанным с порядком проведения торгов;
- прекращать/приостанавливать допуск трейдера к торгам на Бирже в случаях неисполнения требований, предусмотренных в Правилах допуска и иных внутренних документах ФБ ММВБ;
- исполнять решения о прекращении/приостановлении допуска Участника торгов к участию в торгах в случаях, предусмотренных Правилами допуска и иными внутренними документами ФБ ММВБ.

5.6. Маклер уполномочен готовить и подписывать от имени Биржи отчетные документы, подтверждающие факт регистрации заявок и сделок в Системе торгов, а также иные документы по итогам торгов в соответствии с настоящими Правилами.

5.7. В случае наступления в ходе торгов обстоятельств, которые могут являться основанием для признания ситуации чрезвычайной, Маклер имеет право:

- приостановить торги на срок до 60 минут;
- задержать начало торгов на срок до 60 минут;
- приостановить доступ Участника торгов к Системе торгов на срок до 60 минут;
- возобновить торги в случаях и порядке, предусмотренных в п. 2 Приложения № 1 к настоящим Правилам.

5.8. Маклер имеет право по требованию Участника торгов снимать неудовлетворенные заявки в Системе торгов в случае, если в ходе торгов у Участника торгов по техническим причинам прекратился доступ в Систему торгов или отсутствует технологическая возможность осуществить данную операцию.

Сообщение в адрес Маклера о снятии неудовлетворенных заявок должно передаваться только трейдером Участника торгов телефонограммой, в которой обязательно указываются следующие данные:

- ФИО трейдера, передавшего телефонограмму;
- номера заявок, которые необходимо снять, с указанием реквизитов заявок в соответствии с Разделом 6 “Заявки” настоящих Правил, либо указание о снятии всех неудовлетворенных заявок данного Участника торгов, находящихся в Системе торгов;
- дата и время передачи телефонограммы, а также номер телефона, с которого она передается.

В случае если реквизиты заявки, указанные в телефонограмме, не совпадают с

условиями заявки, находящейся в Системе торгов, Маклером заявка не снимается, о чем телефонограммой сообщается трейдеру.

Биржа не несет ответственности за убытки, которые могут возникнуть у Участника торгов в связи со снятием его неудовлетворенных заявок на основании поступившей от него в адрес Маклера телефонограммы.

5.9. Маклер обязан:

- исполнять решения Генерального директора и Дирекции Биржи;
- информировать Генерального директора Биржи и/или иное уполномоченное лицо в случаях, установленных Генеральным директором Биржи, о наступлении обстоятельств, которые могут являться основанием для признания чрезвычайной ситуации;
- осуществлять своевременную подготовку, запуск, приостановку, возобновление и прекращение торгов;
- управлять процессом проведения торгов в соответствии с требованиями настоящих Правил;
- своевременно принимать меры в рамках своих полномочий, предотвращающие наступление обстоятельств, препятствующих нормальному ходу торгов;
- обеспечивать учет и хранение отчетных документов по итогам торгов;
- своевременно доводить до сведения Участников торгов решения Генерального директора и Дирекции Биржи, связанные с порядком проведения торгов.

5.10. Не являющаяся общедоступной информация, которая становится известной Маклеру в ходе ведения торгов, относится к сведениям, составляющим служебную информацию и/или коммерческую тайну.

6. Заявки

6.1. Заявки на заключение сделок подаются в электронном виде. Безадресной заявкой признается заявка, адресованная всем Участникам торгов. Все иные заявки признаются адресными.

6.2. Заявка признается документом, являющимся предложением Участника торгов Биржи заключить сделку на условиях, содержащихся в заявке. Виды заявок, а также требования к их содержанию определяются настоящими Правилами.

Если иное не установлено решением Дирекции Биржи, подача заявок в Систему торгов осуществляется посредством электронных сообщений, содержащих аналог собственноручной подписи трейдера Участника торгов, которым признается идентификатор трейдера, позволяющий однозначно идентифицировать трейдера

Участника торгов, подавшего (объявившего) заявку, и достоверно установить, что заявка исходит от Участника торгов, уполномоченному трейдеру которого присвоен данный идентификатор (далее – АСП трейдера, идентификатор трейдера). Заявки, подаваемые от имени Участников торгов, признаются электронными документами, равнозначными документам, подписанным собственноручными подписями трейдеров Участника торгов.

Присвоение и использование идентификатора трейдера осуществляется в порядке, предусмотренном Правилами допуска.

В ходе торгов Биржа обеспечивает защищенность и целостность заявок Участников торгов в результате применения комплекса организационных и технических мер, включающих в себя, в том числе:

- использование Техническим центром специализированных аппаратно-программных средств, обеспечивающих однозначную идентификацию рабочего места Участника торгов (совокупности программно-технических средств, предназначенных для использования Участником торгов для участия в торгах) по IP-адресу, а также защиту информации от несанкционированного доступа;
- использование Участником торгов идентификатора трейдера и пароля для проверки полномочий физического лица, получающего технический доступ к Системе торгов;
- использование специальной технологии регистрации в Системе торгов заявок, исключающей возможность изменения условий заявок после их регистрации (использование АСП трейдера);
- наличие специальной процедуры передачи Участнику торгов сведений о присвоенном идентификаторе трейдера, обеспечивающих защиту данной информации от несанкционированного доступа.

6.3. Типовые формы для каждого вида заявок, предусмотренного настоящим Разделом Правил, предусмотрены в Приложении №11 к настоящим Правилам.

6.4. Цены в заявках на заключение сделок с облигациями указываются в процентах от непогашенной на момент заключения сделки номинальной стоимости (если иное не установлено решением Генерального директора Биржи). Цены в заявках на заключение сделок с иными ценными бумагами указываются в российских рублях. По решению Генерального директора Биржи для отдельных ценных бумаг цены могут указываться в иностранной валюте. В случае погашения части основного долга (проведение амортизационной выплаты) по облигациям в дату ее проведения размер номинальной стоимости уменьшается на сумму погашаемой части основного долга (амортизационной выплаты). Перечень ценных бумаг, сделки с которыми исполняются в иностранной валюте (сделки за иностранную валюту), устанавливается решением Генерального директора Биржи.

6.5. При торгах по ценным бумагам Участник торгов вправе подавать в Систему торгов все виды заявок, указанных в настоящем Разделе Правил (если решением Генерального директора Биржи не определено иное), с учетом особенностей, определенных в Разделе 11 и 12 настоящих Правил.

6.6. Участник торгов имеет право подавать следующие виды заявок на заключение сделок в Систему торгов (если иное не установлено решением Генерального директора Биржи):

- лимитные заявки с сохранением в котировках и/или лимитные заявки без сохранения в котировках (далее – лимитные заявки);
- заявки маркет-мейкера с сохранением в котировках (далее – заявки маркет-мейкера);
- рыночные заявки с указанием количества ценных бумаг и/или рыночные заявки с указанием объема денежных средств, предназначенных для покупки ценных бумаг (далее - рыночные заявки);
- заявки послеторгового периода;
- безадресные заявки РПС и адресные заявки РПС;
- безадресные заявки РЕПО (акции) и адресные заявки РЕПО (акции);
- безадресные заявки РЕПО (облигации) и адресные заявки РЕПО (облигации);
- безадресные и адресные заявки на заключение сделок в режиме торгов «Размещение: Адресные заявки»;
- безадресные и адресные заявки на заключение сделок в режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки».

6.7. Подача в Систему торгов:

- лимитной заявки;
- заявки маркет-мейкера;
- рыночной заявки;
- заявки послеторгового периода;
- адресной заявки РПС;
- адресной заявки на заключение сделок в режиме торгов «Размещение: Адресные заявки»;
- адресной заявки на заключение сделок в режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки»;
- адресной заявки РЕПО (акции);

- адресной заявки РЕПО (облигации)

означает безоговорочное согласие Участника торгов заключить сделку на условиях, указанных в соответствующей заявке.

6.8. Лимитная заявка, заявка маркет-мейкера, рыночная заявка и заявка послеторгового периода могут быть адресованы только всем Участникам торгов.

6.9. Адресная заявка РПС, адресная заявка на заключение сделок в режиме торгов «Размещение: Адресные заявки», адресная заявка на заключение сделок в режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки», адресная заявка РЕПО (акции), адресная заявка РЕПО (облигации) могут быть адресованы только конкретным Участникам торгов.

Безадресная заявка РПС, безадресная заявка на заключение сделок в режиме торгов «Размещение: Адресные заявки», безадресная заявка на заключение сделок в режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки», безадресные заявки РЕПО (акции) и безадресные заявки РЕПО (облигации) могут быть адресованы только всем Участникам торгов.

6.10. Заявки на заключение сделок содержат АСП трейдера (если иное не установлено решением Дирекции Биржи). В зависимости от вида заявки при ее подаче в Систему торгов указываются следующие реквизиты:

6.10.1. В лимитной заявке:

- вид заявки (лимитная заявка с сохранением или лимитная заявка без сохранения в котировках);
- идентификатор Участника торгов;
- код Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении);
- направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу);
- наименование ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- минимальная цена продажи/максимальная цена покупки за одну ценную бумагу;
- торгово-клиринговый счет;
- код расчетов (Т0, если иной код расчетов не установлен в соответствии с п.п. 1.1.14. Раздела 1 «Термины и определения» настоящих Правил);
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе, эмитентов ценных бумаг));
- идентификатор трейдера (АСП трейдера).

6.10.2. В заявке послеторгового периода:

- вид заявки (заявка послеторгового периода);
- идентификатор Участника торгов;
- код Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении);
- направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу);
- наименование ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- цена послеторгового периода;
- торгово-клиринговый счет;
- код расчетов (Т0, если иной код расчетов не установлен в соответствии с п.п. 1.1.14. Раздела 1 «Термины и определения» настоящих Правил);
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе, эмитентов ценных бумаг));
- идентификатор трейдера (АСП трейдера).

6.10.3. В заявке маркет-мейкера:

- вид заявки (заявка маркет-мейкера);
- идентификатор Участника торгов – маркет-мейкера;
- код Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении);
- направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу);
- наименование ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- минимальная цена продажи/максимальная цена покупки за одну ценную бумагу;
- торгово-клиринговый счет;
- код расчетов (Т0, если иной код расчетов не установлен в соответствии с п.п. 1.1.14. Раздела 1 «Термины и определения» настоящих Правил);
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе, эмитентов ценных бумаг));

- идентификатор трейдера (АСП трейдера).

6.10.4. В рыночной заявке:

- вид заявки (рыночная заявка с указанием количества ценных бумаг или рыночная заявка с указанием объема денежных средств, предназначенных для покупки ценных бумаг);
- идентификатор Участника торгов;
- код Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении);
- направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу);
- наименование ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах, или объем денежных средств, предназначенных для покупки ценных бумаг;
- торгово-клиринговый счет;
- код расчетов (Т0, если иной код расчетов не установлен в соответствии с п.п. 1.1.14. Раздела 1 «Термины и определения» настоящих Правил);
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе, эмитентов ценных бумаг));
- идентификатор трейдера (АСП трейдера).

6.10.5. Реквизиты, которые должны содержаться в безадресных заявках РПС и адресных заявках РПС, предусмотрены в Разделе 16 «Режим переговорных сделок» настоящих Правил.

6.10.6. Реквизиты, которые должны содержаться в безадресных заявках РЕПО (акции), адресных заявках РЕПО (акции), безадресных заявках РЕПО (облигации) и адресных заявках РЕПО (облигации), предусмотрены в Разделе 17 «Порядок заключения сделок РЕПО» настоящих Правил.

6.10.7. Реквизиты, которые должны содержаться в безадресных и адресных заявках на заключение сделок в режиме торгов «Размещение: Адресные заявки», предусмотрены в Разделе 19 «Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» и «Размещение: Адресные заявки» настоящих Правил. Реквизиты, которые должны содержаться в лимитных и рыночных заявках на заключение сделок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион», предусмотрены в Разделе 19 «Порядок заключения сделок в режимах торгов «Размещение: Аукцион» и «Размещение: Адресные заявки» настоящих Правил.

6.10.8. Подача рыночных заявок с указанием объема денежных средств,

предназначенных для покупки ценных бумаг, возможна только в Режиме торгов «Размещение: Аукцион». Дополнительные особенности подачи и удовлетворения таких заявок при размещении ценных бумаг определяются решением Генерального директора Биржи в соответствии с Решением о выпуске и/или иными документами, регламентирующими порядок проведения размещения ценных бумаг.

6.10.9. Реквизиты, которые должны содержаться в безадресных и адресных заявках на заключение сделок в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки», предусмотрены в Разделе 20 «Проведение торгов по приобретению акций и выкупу облигаций» настоящих Правил. Реквизиты, которые должны содержаться в лимитных и рыночных заявках на заключение сделок в Режиме торгов «Выкуп: Аукцион», предусмотрены в Разделе 20 «Проведение торгов по приобретению акций и выкупу облигаций» настоящих Правил.

6.11. Допускается заключение сделки в отношении части количества ценных бумаг, определенного в соответствии с условиями заявки (частичное исполнение заявки). В случае частичного исполнения заявки количество ценных бумаг, указанное в частично исполненной заявке, уменьшается на то количество ценных бумаг, в отношении которого заключена сделка.

6.12. Все заявки на заключение сделок в Системе торгов являются заявками, значения реквизитов которых не могут быть изменены. Изменение Участником торгов значений реквизитов заявки в Системе торгов означает снятие первоначальной заявки (частично исполненной заявки) и подачу новой заявки с измененными значениями реквизитов, которой в Системе торгов присваивается новый идентификационный номер и фиксируется время ее подачи. Участник торгов может отменить находящуюся в Системе торгов заявку путем ее снятия. Снятие первоначальной заявки (частично исполненной заявки) осуществляется путем ввода в Систему торгов соответствующего распоряжения на снятие заявки, с момента поступления которого такая заявка перестает быть активной, т.е. доступной для изменения значений ее реквизитов и возможности заключения сделки/сделок. Распоряжение на снятие заявки содержит значения реквизитов снимаемой активной заявки/заявок и АСП трейдера, направившего такое распоряжение на снятие заявки. При указании в распоряжении на снятие заявки значений реквизитов нескольких заявок перевод данных заявок в неактивные осуществляется в Системе торгов в очередности, указанной в распоряжении на снятие заявки.

6.13. При регистрации каждой заявки в Системе торгов автоматически фиксируется время ее ввода и код Участника торгов, подавшего заявку, после чего ей присваивается уникальный идентификационный номер (в порядке возрастания).

6.14. Подача в Систему торгов лимитной заявки, заявки маркет-мейкера, рыночной заявки, заявки послеторгового периода означает безоговорочное согласие Участника торгов заключить сделку при наличии встречных заявок на условиях полного или частичного удовлетворения (если иное не установлено решением Генерального

директора Биржи) по цене не хуже, чем указанная в заявке.

6.15. Все неудовлетворенные заявки, находящиеся в Системе торгов, могут быть отменены или изменены подавшим их Участником торгов, за исключением случаев, предусмотренных в Разделе 17 «Порядок заключения сделок РЕПО», Разделе 19 «Порядок заключения сделок в Режимах торгов «Размещение: Аукцион» и «Размещение: Адресные заявки»» и Разделе 20 «Проведение торгов по приобретению акций и выкупу облигаций» (если решением Генерального директора Биржи не определено иное). Участник торгов может отменить заявку, находящуюся в Системе торгов, только путем ее снятия. Внесение изменений в заявку, находящуюся в Системе торгов, осуществляется исключительно путем снятия прежней заявки и подачи в Систему торгов новой заявки. Снятие заявки осуществляется Участником торгов в порядке, предусмотренном в п. 6.12. настоящего Раздела Правил.

6.16. Участник торгов может приостановить или досрочно завершить свое участие в торгах. При этом Участник торгов вправе как снять ранее поданные заявки, так и оставить их до конца текущего торгового дня (если решением Генерального директора Биржи не определено иное).

7. Условия принятия заявки к регистрации

7.1. Следующие виды заявок, подаваемые Участником торгов, регистрируются в Системе торгов только после получения Биржей от Клиринговой организации отчета о возможности регистрации заявки в соответствии с Разделом 12 «Порядок взаимодействия с клиринговой организацией. Порядок исполнения сделок» настоящих Правил и Правилами клиринга:

- лимитная заявка;
- заявка маркет-мейкера;
- рыночная заявка;
- заявка послеторгового периода;
- адресная заявка РПС;
- адресная заявка РЕПО (акции);
- адресная заявка РЕПО (облигации);
- адресная заявка на заключение сделок в режиме торгов «Размещение: Адресные заявки»;
- адресная заявка на заключение сделок в режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки».

7.2. При отсутствии цены послеторгового периода заявка послеторгового периода не

регистрируется в Системе торгов.

7.3. Заявки маркет-мейкера принимаются Системой торгов только от Участников торгов, которым присвоен статус маркет-мейкера в соответствии с п. 13.1. Раздела 13 «Маркет-мейкеры и Специалисты» настоящих Правил и с которыми Биржей заключены соглашения о выполнении функций маркет-мейкера, в течение периода действия данного соглашения.

7.4. Регистрация заявки Участника торгов, не являющегося Специалистом, подаваемой с целью совершения сделки в ходе торговой сессии Режимы основных торгов или в режиме торгов «Неполные лоты» с ценной бумагой, на рынке которой осуществляет функции Специалист, осуществляется только при наличии в очереди заявок встречной направленности заявки с пересекающимися ценовыми условиями (если решением Генерального директора Биржи не определено иное).

7.5. Заявки на совершение сделки, цена в которых превышает предельные границы колебания цены ценной бумаги, установленные исходя из расчетной цены для целей определения отклонений цен этой ценной бумаги на текущий торговый день, в Системе торгов не регистрируются.

7.6. Заявки, поданные с указанием типа торгово-клирингового счета, на использование которого решением Генерального директора Биржи на основании информации Клиринговой организации установлены ограничения в определенных Режимы торгов (периодах) и/или по определенным ценным бумагам, в Системе торгов не регистрируются.

7.7. В Системе торгов следующие виды заявок, подаваемые Участником торгов, регистрируются без получения Биржей от Клиринговой организации подтверждения о проведении проверки обеспечения таких заявок в соответствии с Разделом 12 «Порядок взаимодействия с клиринговой организацией. Порядок исполнения сделок» настоящих Правил и Правилами клиринга:

- безадресная заявка РПС;
- безадресные заявки РЕПО (акции);
- безадресные заявки РЕПО (облигации);
- безадресная заявка на заключение сделок в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки»;
- безадресная заявка на заключение сделок в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки».

7.8. При подаче Участником торгов заявки на заключение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе, эмитентов ценных бумаг), а также от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении, заявка на покупку

и/или продажу не регистрируется в Системе торгов в случае, если краткий код клиента или код Участника торгов, указанный в заявке, не соответствует ни одному из кратких кодов клиентов или кодов Участника торгов, присвоенных на Бирже клиентам данного Участника торгов или самому Участнику торгов, с учетом особенностей, предусмотренных требованиями нормативных правовых актов федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иных нормативных правовых актов Российской Федерации.

7.9. Для исключения возможности заключения Участником торгов сделок с ценными бумагами от своего имени и за свой счет, от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг), от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении, в результате которых не меняется владелец этих ценных бумаг; а также в результате которых нарушаются ограничения, установленные для доверительного управляющего, предусмотренные требованиями нормативных правовых актов федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иных нормативных правовых актов Российской Федерации:

7.9.1. В ходе торговой сессии Режима основных торгов, в Режиме торгов «Неполные лоты» и в Режиме торгов «Облигации Д - Режим основных торгов» заявка, поданная Участником торгов (в размере неисполненной части), не регистрируется в Системе торгов в случае, если это влечет за собой заключение сделки:

7.9.1.1. в которой продавцом и покупателем выступает один и тот же клиент Участника (участников) торгов;

7.9.1.2. в которой данный Участник торгов является одновременно продавцом и покупателем ценных бумаг;

7.9.1.3. на основании заявок данного Участника торгов, поданных от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении, в которых указан один и тот же код Участника торгов (доверительного управляющего);

7.9.1.4. на основании заявки данного Участника торгов, поданной от своего имени и за свой счет либо по поручению и за счет его клиентов, с одной стороны, и заявки данного Участника торгов, поданной от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении, с другой стороны;

7.9.1.5. на основании заявок, поданных Участником торгов от своего имени и за свой счет или за счет средств, находящихся в доверительном управлении с одной стороны, и поданных иным Участником торгов от своего имени, по поручению и за счет данного Участника торгов, выступающего в качестве клиента, с другой стороны.

7.9.2. В послеторговый период Режима основных торгов и в Режиме торгов «Размещение: Аукцион», «Выкуп: Аукцион», заявка, поданная Участником торгов от своего имени, не регистрируется в Системе торгов в случае, если в очереди заявок

противоположной направленности находится хотя бы одна заявка:

7.9.2.1. поданная любым Участником торгов от своего имени, по поручению и за счет одного и того же клиента;

7.9.2.2. поданная тем же самым Участником торгов так же от своего имени и за свой счет;

7.9.2.3. поданная Участником торгов от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении, в которой указан один и тот же код Участника торгов (доверительного управляющего);

7.9.2.4. поданная данным Участником торгов либо за свой счет, либо по поручению и за счет его клиентов (при подаче им заявки за счет средств, находящихся в доверительном управлении);

7.9.2.5. поданная иным Участником торгов от своего имени, по поручению и за счет данного Участника торгов (подавшего встречную заявку от своего имени и за свой счет или за счет средств, находящихся в доверительном управлении), выступающего в качестве клиента.

7.9.3. В предторговый период или в ходе дискретного аукциона Режим основных торгов заявка, поданная Участником торгов от своего имени не регистрируется в Системе торгов в случае, если в очереди заявок противоположной направленности находится хотя бы одна заявка, с пересекающимися ценовыми условиями:

7.9.3.1. поданная любым Участником торгов от своего имени, по поручению и за счет одного и того же клиента;

7.9.3.2. поданная данным Участником торгов от своего имени и за свой счет;

7.9.3.3. поданная Участником торгов от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении, в которой указан один и тот же код Участника торгов (доверительного управляющего);

7.9.3.4. поданная данным Участником торгов за свой счет либо по поручению и за счет его клиентов (при подаче им заявки за счет средств, находящихся в доверительном управлении);

7.9.3.5. поданная иным Участником торгов от своего имени, по поручению и за счет данного Участника торгов (подавшего встречную заявку от своего имени и за свой счет или за счет средств, находящихся в доверительном управлении), выступающего в качестве клиента.

7.9.4. В Режиме торгов РПС, «Облигации Д - РПС», «Аукцион РЕПО», «РЕПО с акциями», «РЕПО с облигациями», «Размещение: Адресные заявки», «Выкуп: Адресные заявки», «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» или в режиме торгов «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», заявка, поданная Участником торгов от своего имени, не

регистрируется в Системе торгов в случае, если это влечет за собой заключение Участником (участниками) торгов сделки:

7.9.4.1. на основании встречных заявок Участника (участников) торгов, поданных от своего имени, по поручению и за счет одного и того же клиента;

7.9.4.2. на основании встречных заявок Участника торгов, поданных от своего имени и за свой счет;

7.9.4.3. на основании встречных заявок Участника торгов, поданных от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении, в которых указан один и тот же код Участника торгов (доверительного управляющего);

7.9.4.4. на основании заявки, поданной данным Участником торгов от своего имени и за свой счет либо по поручению и за счет его клиентов, с одной стороны, и заявки Участника торгов, поданной от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении, с другой стороны;

7.9.4.5. на основании заявок, поданных данным Участником торгов от своего имени и за свой счет или за счет средств, находящихся в доверительном управлении с одной стороны, и поданных иным Участником торгов от своего имени, по поручению и за счет данного Участника торгов с другой стороны, выступающего в качестве клиента.

7.10. При подаче Участником торгов заявки на заключение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов, а также от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении, при указании в качестве кода расчетов – Z0 заявка не регистрируется в Системе торгов в случае, если это влечет за собой заключение Участником торгов сделки, в которой данный Участник торгов является одновременно продавцом и покупателем ценных бумаг и использует один и тот же торговый-клиринговый счет.

8. Шаг цены

8.1. Для всех заявок устанавливается шаг цены, под которым понимается минимально возможная разница между ценами, указанными в заявках одной направленности (покупка или продажа).

8.2. Величина шага цены по ценным бумагам устанавливается решением Генерального директора Биржи.

9. Стандартный лот

9.1. Под стандартным лотом в настоящих Правилах понимается допустимое количество ценных бумаг в одной заявке. Количество стандартных лотов в заявке задается целым числом.

В качестве стандартного лота (за исключением торгов в Режиме «Неполные лоты», и при заключении сделок РЕПО) принимается 100 (сто) ценных бумаг при торгах по акциям и 1 (одна) ценная бумага при торгах по иным ценным бумагам (если решением Генерального директора Биржи не определено иное).

9.2. Размер стандартного лота при заключении сделок РЕПО и в режиме торгов «Неполные лоты» устанавливается равным 1 (одной) ценной бумаге (если решением Генерального директора Биржи не определено иное).

10. Особенности проведения торгов по ценным бумагам, за исключением облигаций

10.1. При торгах по акциям, за исключением акций, определенных в соответствии с п. 25.2. Раздела 25 «Правила, ограничивающие манипулирование ценами», Участник торгов вправе подавать в Систему торгов все виды заявок, указанных в Разделе 6 «Заявки» настоящих Правил, за исключением адресных заявок РЕПО (облигации) и безадресных заявок РЕПО (облигации).

10.2. При торгах по акциям, определенным в соответствии с п. 25.2. Раздела 25 «Правила, ограничивающие манипулирование ценами», Участник торгов вправе подавать в Систему торгов только следующие виды заявок: безадресные и адресные заявки на заключение сделок в РПС, а также безадресные заявки РЕПО (акции), адресные заявки РЕПО и адресные заявки РЕПО (акции) (если решением Генерального директора Биржи не определено иное).

10.3. При торгах инвестиционными паями, российскими депозитарными расписками и ипотечными сертификатами участия Участник торгов вправе подавать в Систему торгов все виды заявок, указанных в Разделе 6 «Заявки» настоящих Правил, за исключением заявок, на основании которых заключаются сделки РЕПО (если решением Генерального директора Биржи не определено иное).

10.4. При торгах ценными бумагами, включенными в перечень ценных бумаг, на рынке которых могут подавать заявки и совершать сделки Специалисты, Участники торгов, которым не предоставлен статус Специалиста на рынке данной ценной бумаги, вправе подавать в Систему торгов только следующие виды заявок (если решением Генерального директора Биржи не определено иное):

- лимитные заявки без сохранения в котировках;
- рыночные заявки;
- безадресные и адресные заявки на заключение сделок в РПС;
- безадресные и адресные заявки РЕПО;
- безадресные заявки РЕПО (акции) и адресные заявки РЕПО (акции).

11. Особенности проведения торгов по облигациям

11.1. При торгах по облигациям Участник торгов вправе подавать в Систему торгов все виды заявок, указанных в Разделе 6 «Заявки» настоящих Правил, за исключением безадресных заявок РЕПО (акции) и адресных заявок РЕПО (акции) (если решением Генерального директора Биржи не определено иное).

11.2. В случае, если дата исполнения сделки (части сделки РЕПО) с облигациями, по которым в Системе торгов рассчитывается накопленный купонный доход (далее – НКД), приходится на период до даты составления (фиксации) списка владельцев облигаций для выплаты купонного дохода соответствующего купонного периода включительно, Участник торгов - покупатель обязан уплатить НКД Участнику торгов - продавцу в размере, определяемом в Системе торгов на дату исполнения сделки в соответствии с Решением о выпуске ценных бумаг и/или анкетой ценной бумаги и/или в порядке, установленном эмитентом.

11.3. В соответствии с решением Генерального директора в случае, если дата исполнения сделки (части сделки РЕПО) с облигациями, по которым в Системе торгов рассчитывается НКД, приходится на период после даты составления (фиксации) списка владельцев облигаций для выплаты купонного дохода соответствующего купонного периода, но до даты начала следующего купонного периода, Участник торгов - продавец обязан уплатить Участнику торгов - покупателю разницу между купонным доходом соответствующего купонного периода и НКД, а также сумму погашаемой части основного долга (амортизационной выплаты) в размере, определяемом в Системе торгов на дату исполнения сделки в соответствии с Решением о выпуске ценных бумаг и/или анкетой ценной бумаги и/или в порядке, установленном эмитентом.

12. Порядок взаимодействия с клиринговой организацией. Порядок исполнения сделок

12.1. При подаче Участником торгов в Систему торгов заявки с кодом расчетов

T0, Z0 или Rb на покупку ценных бумаг Биржа направляет в Клиринговую организацию запрос о возможности регистрации заявки для проверки состояния (статуса) в Системе клиринга торгово-клирингового счета, указанного в заявке, а также для проверки величины денежных средств, которые могут служить обеспечением для ее полного удовлетворения, включая уплату комиссионного вознаграждения по сделке и НКД на дату исполнения сделки, в случае его расчета в Системе торгов. На основании данного запроса от Биржи Клиринговая организация в соответствии с Правилами клиринга совершает необходимые действия и передает на Биржу отчет о возможности регистрации заявки или отчет о невозможности регистрации заявки. В случае получения Биржей отчета о невозможности регистрации заявки в Системе торгов данная заявка не регистрируется в Системе торгов.

12.2. При подаче Участником торгов в Систему торгов заявки с кодом расчетов T0 (за исключением заявок с указанием значения реквизита «дата активации», не совпадающего с текущим расчетным днем), Z0 или Rb на продажу ценных бумаг Биржа направляет в Клиринговую организацию запрос о возможности регистрации заявки для проверки состояния (статуса) в Системе клиринга торгово-клирингового счета, указанного в заявке, для проверки количества ценных бумаг, которые могут служить обеспечением для ее полного удовлетворения, а также (в отношении заявок на заключение сделок за иностранную валюту и на заключение сделок с кодом расчетов Z0) для проверки величины денежных средств, которые могут служить обеспечением для уплаты комиссионного вознаграждения по сделке. На основании данного запроса от Биржи Клиринговая организация в соответствии с Правилами клиринга совершает необходимые действия и передает на Биржу отчет о возможности регистрации заявки или отчет о невозможности регистрации заявки. В случае получения Биржей отчета о невозможности регистрации заявки в Системе торгов данная заявка не регистрируется в Системе торгов.

12.3. При подаче Участником торгов в Систему торгов заявки на покупку или на продажу ценных бумаг с кодом расчетов B0-B05, B06-B30, S0-S2 или T0 (с указанием реквизита «дата активации», не совпадающим с текущим расчетным днем) Биржа направляет в Клиринговую организацию запрос о возможности регистрации заявки для проверки состояния (статуса) в Системе клиринга торгово-клирингового счета, указанного в заявке, и величины денежных средств, которые могут служить обеспечением для уплаты комиссионного вознаграждения по сделке. На основании данного запроса от Биржи Клиринговая организация осуществляет проверку состояния (статуса) соответствующего торгово-клирингового счета, после чего передает на Биржу отчет о возможности регистрации заявки или отчет о невозможности регистрации заявки. В случае получения Биржей отчета о невозможности регистрации заявки в Системе торгов данная заявка не регистрируется.

12.4. При снятии Участником торгов в Системе торгов неисполненной заявки на продажу или на покупку ценных бумаг с кодом расчетов T0, Z0 или Rb Биржа направляет

в Клиринговую организацию уведомление о снятии заявки.

12.5. При регистрации в Системе торгов сделки, путем удовлетворения заявки (полном или частичном) Участника торгов в Системе торгов по результатам совершенной сделки с кодом расчетов T0, B0-B05, B06-B30, Z0, S0-S2 или Rb Биржа направляет в Клиринговую организацию уведомление о заключении сделки. В случае если условия сделки и номера заявок, на основании которых заключена сделка, содержащиеся в уведомлении о заключении сделки, не совпадают с реквизитами и номерами заявок, по которым Клиринговой организацией на Биржу были переданы отчеты о возможности регистрации заявки, Клиринговая организация вправе проинформировать Биржу о необеспеченности такой сделки путем передачи уведомления о необеспеченности сделки.

12.6. При регистрации в Системе торгов сделки, путем удовлетворения заявки с кодами расчетов Z0, B0 и S0 Биржа направляет в Клиринговую организацию выписку из реестра сделок.

12.7. Передача запроса Клиринговой организации по заявкам, содержащим дату активации для целей проверки обеспечения такой заявки в соответствии с п.п. 12.1. - 12.2. настоящего раздела Правил осуществляется во время и дату, определенные решением Генерального директора Биржи. При регистрации в Системе торгов сделки на основании таких заявок осуществляется взаимодействие в порядке, предусмотренном в п. 12.5. настоящего Раздела Правил.

12.8. После окончания торгов (в отдельном режиме торгов /по отдельной ценной бумаге) каждого торгового дня Биржа направляет в Клиринговую организацию сводный реестр сделок с ценными бумагами, содержащий информацию обо всех сделках, заключенных на Бирже в ходе торгов (в отдельном режиме торгов /по отдельной ценной бумаге), условиями которых предусмотрен клиринг в данной Клиринговой организации.

12.9. В дату внесения компенсационных взносов после окончания процедуры контроля обеспечения Клиринговая организация направляет на Биржу сводную ведомость об исполнении обязательств по внесению компенсационных взносов, которая содержит информацию о результатах исполнения Участниками торгов своих обязательств по внесению компенсационных взносов (в том числе и указание на получение от Участников торгов-контрагентов по сделке РЕПО поручений на отказ от компенсационного взноса).

12.10. В случае исполнения до даты надлежащего исполнения Участником торгов сделки РЕПО Клиринговая организация направляет на Биржу отчет о досрочном исполнении сделок РЕПО.

12.11. В случае получения от Участников торгов-контрагентов по сделке РЕПО поручений на отказ от компенсационного взноса Клиринговая организация направляет на Биржу информацию об отказе от компенсационных взносов в составе сводной ведомости об исполнении обязательств по внесению компенсационных взносов в срок, предусмотренный в п. 12.9. настоящего Раздела Правил.

12.12. После окончания торгов в дату, предшествующую дате внесения компенсационных взносов, Биржа направляет в Клиринговую организацию сводный реестр компенсационных взносов, который содержит информацию о подлежащих исполнению Участниками торгов обязательств по внесению компенсационных взносов.

12.13. Биржа уведомляет Клиринговую организацию (при получении от Участника торгов Уведомления, предусмотренного в Приложении № 6 к настоящим Правилам) об отказе Участника торгов от получения переменного или фиксированного возмещения, подлежащего уплате в его пользу в соответствии с условиями заключенной сделки с ценными бумагами.

12.14. В случае неисполнения сделки, Клиринговая организация уведомляет об этом Биржу путем направления Уведомления о неисполнении обязательств по сделке с ценными бумагами, условиями которой предусмотрен клиринг в данной Клиринговой организации.

12.15. Исполнение сделок осуществляется в следующем порядке в соответствии с Правилами клиринга:

12.15.1. Определение обязательств по заключенным на Бирже сделкам осуществляется в порядке простого или многостороннего клиринга.

12.15.2. Клиринговая организация осуществляет определение обязательств по сделкам в порядке простого клиринга только по спот-сделкам, заключенным с кодом расчетов Z0, по первым частям сделок РЕПО, заключенных с кодом расчетов Z0, а также по сделкам, по которым были зарегистрированы срочные отчеты на исполнение. По остальным сделкам, заключенным на Бирже, Клиринговая организация осуществляет определение обязательств в порядке многостороннего клиринга с использованием неттинга.

12.15.3. В процессе осуществления клиринга по заключенным на Бирже сделкам Клиринговая организация не выступает стороной по обязательствам, вытекающим из сделок клирингового пула.

12.15.4. Обязательства по спот-сделкам с кодами расчетов T0, Z0 и B0, а также по первым частям сделок РЕПО с кодами расчетов Rb, Z0 и S0 подлежат исполнению в дату заключения этих сделок на Бирже.

12.15.5. Обязательства по сделкам с кодами расчетов B01-B05 и B06-B30 подлежат исполнению в любой расчетный день после даты заключения этих сделок на Бирже, но не позднее соответствующей даты их надлежащего исполнения включительно.

12.15.6. Обязательства по первым частям сделок РЕПО с кодами расчетов S1-S2 подлежат исполнению в соответствующие даты надлежащего исполнения первых частей этих сделок.

12.15.7. Обязательства по вторым частям сделок РЕПО с кодами расчетов Rb,

Z0 и S0-S2 подлежат исполнению в любой расчетный день, начиная с даты надлежащего исполнения первых частей этих сделок, но не позднее соответствующей даты надлежащего исполнения вторых частей этих сделок включительно.

При этом Участник торгов обязан исполнить свои обязательства по второй части сделки РЕПО в надлежащую дату исполнения второй части этой сделки РЕПО, а в случае невнесения (неисполнения обязательств по внесению) одной из сторон компенсационного взноса, предусмотренного условиями данной сделки РЕПО, Участник торгов обязан исполнить свои обязательства по второй части сделки РЕПО в первый расчетный день, следующий за надлежащей датой внесения компенсационного взноса.

12.15.8. Если дата надлежащего исполнения сделки приходится не на расчетный день в соответствии с Правилами клиринга, то датой надлежащего исполнения сделки считается первый следующий за этой датой расчетный день (при этом обязательства по вторым частям сделок РЕПО пересчитываются с учетом такого переноса даты надлежащего исполнения).

13. Маркет-мейкеры и Специалисты

13.1. В целях повышения ликвидности рынка ценных бумаг Участникам торгов может быть предоставлен статус Маркет-мейкера и/или статус Специалиста, предусматривающие добровольное принятие Участниками торгов установленных в настоящем Разделе Правил дополнительных обязательств подавать заявки в Режиме основных торгов, направленные на повышение ликвидности ценных бумаг.

13.2. Статус Маркет-мейкера или статус Специалиста может быть предоставлен Участнику торгов только по ценным бумагам, перечень которых определяется решением Дирекции Биржи, включая ценные бумаги, планируемые к допуску к торгам в котировальных списках, предусматривающих обязательное наличие Маркет-мейкеров.

Перечень ценных бумаг, на рынке которых могут осуществлять свои обязательства Маркет-мейкеры, пересматривается Дирекцией Биржи, исходя из конъюнктуры рынка, и вступает в силу в дату, определяемую решением Дирекции Биржи.

Перечень ценных бумаг, на рынке которых может осуществлять свои обязательства Специалист, пересматривается не реже одного раза в полгода в течение первых 10 торговых дней нового полугодия и вступает в силу в дату, определяемую решением Дирекции Биржи.

13.3. Статус Маркет-мейкера предоставляется Участнику торгов при заключении Соглашения о выполнении функций Маркет-мейкера. Статус Специалиста предоставляется Участнику торгов при заключении Соглашения о выполнении функций Специалиста по покупке ценной бумаги или Соглашения о выполнении функций

Специалиста по продаже ценной бумаги (далее - Соглашение о выполнении функций Специалиста). Формы Соглашения о выполнении функций Маркет-мейкера и Соглашения о выполнении функций Специалиста предусмотрены в Правилах допуска.

13.4. Маркет-мейкер в течение срока действия Соглашения о выполнении функций Маркет-мейкера по ценной бумаге принимает на себя обязательства в ходе торговой сессии Режимы основных торгов (за исключением котировального перерыва) подавать и поддерживать в Системе торгов двустороннюю котировку в отношении данной ценной бумаги.

Дирекция Биржи вправе установить суммарный объем сделок Маркет-мейкера, совершенных с каждой ценной бумагой в течение одного торгового дня в рамках исполнения обязательств, предусмотренных настоящим Разделом Правил, по достижении которого Маркет-мейкер вправе подавать заявки маркет-мейкера на совершение сделок с данной ценной бумагой только одной направленности (покупка или продажа) в объеме не меньше МДО, установленного для данной ценной бумаги, или освобождается от указанных обязательств (далее – достаточный объем сделок, ДО). При этом (если иное не предусмотрено решением Дирекции Биржи) проверяется выполнение следующих условий:

- В случае выставления Маркет-мейкером двусторонней котировки, величина фактического спреда должна быть меньше или равна величине предельного спреда, установленного для данной ценной бумаги.
- В случае выставления Маркет-мейкером только котировки (заявки) на покупку (продажу) отклонение цены в указанных заявках от текущей цены ценной бумаги, выраженное в процентах, не должно превышать половины величины предельного спреда, установленного для данной ценной бумаги. При этом цены заявок на покупку (продажу) должны быть меньше (больше) текущей цены ценной бумаги.
- В случае выставления Маркет-мейкером только котировки (заявки) на покупку (продажу), при условии, что цены заявок на покупку (продажу) больше (меньше) текущей цены ценной бумаги, отклонение цены в указанных заявках от текущей цены ценной бумаги не контролируется.

При необходимости осуществления дополнительных мер, направленных на поддержание ликвидности на рынке отдельной ценной бумаги, Дирекция Биржи вправе принять решение об ограничении видов заявок, которые вправе подавать в Систему торгов в соответствии с п. 6.6. Раздела 6 «Заявки» настоящих Правил Участники торгов, не являющиеся Маркет-мейкерами или Специалистами, только лимитными заявками без сохранения в котировках и рыночными заявками.

13.5. Специалист в течение срока действия Соглашения о выполнении функций Специалиста принимает на себя обязательства в ходе торговой сессии Режимы основных торгов (за исключением котировального перерыва) подавать заявки в Систему торгов с

совокупным объемом в размере не меньше минимально допустимого объема. Специалист вправе осуществлять исполнение принятых на себя обязательств путем подачи в Систему торгов всех видов заявок, предусмотренных настоящими Правилами в ходе торговой сессии Режимы основных торгов, если решением Дирекции Биржи не установлено иное. Отклонение цены в указанных заявках от текущей цены ценной бумаги, выраженное в процентах, не должно превышать половины величины предельного спреда, установленного для данной ценной бумаги (если иное не предусмотрено решением Дирекции Биржи), при условии, что цены заявок на покупку (продажу) меньше (больше) текущей цены ценной бумаги. Если цены заявок на покупку (продажу) больше (меньше) текущей цены ценной бумаги, отклонение цены в указанных заявках от текущей цены ценной бумаги не контролируется.

При заключении Специалистом одновременно Соглашения о выполнении функций Специалиста по покупке и Соглашения о выполнении функций Специалиста по продаже одной и той же ценной бумаги Дирекцией Биржи может быть принято решение, устанавливающее обязанность Специалиста в ходе торговой сессии Режимы основных торгов (за исключением котировального перерыва) подавать в Систему торгов встречные заявки с ценовыми условиями, при которых величина фактического спреда, определяемого в соответствии с п. 13.7. настоящего Раздела Правил, меньше или равна величине предельного спреда, и поддерживать совокупный объем поданных заявок в размере не меньше МДО, установленного для данной ценной бумаги.

13.6. При торгах ценными бумагами, включенными в перечень ценных бумаг, на рынке которых могут подавать заявки и совершать сделки Специалисты, иные Участники торгов, которым не предоставлен статус Специалиста на рынке данной ценной бумаги, вправе подавать в Систему торгов только виды заявок, указанные в п. 10.4. Раздела 10 «Особенности проведения торгов по ценным бумагам, за исключением облигаций» настоящих Правил торгов, если решением Генерального директора Биржи не установлено иное.

Решением Генерального директора Биржи может быть отменено ограничение на виды заявок, которые вправе подавать в Систему торгов Участники торгов, установленное в п.10.4 Раздела 10 «Особенности проведения торгов по ценным бумагам, за исключением облигаций» настоящих Правил в случае прекращения действия Соглашения с Участником торгов об исполнении функций Специалиста при условии, что на рынке данной ценной бумаги отсутствуют иные Специалисты.

13.7. Величина фактического спреда (спреда ценового коридора) рассчитывается в соответствии с формулой:

$$\Phi C = \frac{(C_{\text{продажа}}^{\text{макс}} - C_{\text{покупка}}^{\text{мин}})}{C_{\text{покупка}}^{\text{мин}}} * 100\%, \text{ где:}$$

ФС - фактический спред;

$C_{\text{продажа}}^{\text{макс}}$ - максимальная цена в заявках на продажу данного Участника торгов, при которой суммарное количество ценных бумаг в этих заявках, рассчитанное нарастающим итогом в порядке возрастания цены, составляет величину, не меньшую МДО.

$C_{\text{покупка}}^{\text{мин}}$ - минимальная цена в заявках на покупку данного Участника торгов, при которой суммарное количество ценных бумаг в этих заявках, рассчитанное нарастающим итогом в порядке убывания цены, составляет величину, не меньшую МДО.

13.8. Величины предельных спрэдов и МДО заявок по каждой ценной бумаге устанавливается решением Дирекции Биржи.

13.9. Маркет-мейкер и Специалист имеют право не подавать и не поддерживать в течение одного торгового дня заявки в рамках исполнения своих обязательств на покупку/продажу ценных бумаг в течение периода времени, не превышающего в совокупности времени котировального перерыва (далее - КП).

13.10. Продолжительность КП по каждой ценной бумаге устанавливается равной 120 минутам для Участника торгов, заключившего соглашение по ценной бумаге. При заключении соглашения по более чем одной ценной бумаге продолжительность КП по каждой ценной бумаге, по которой данный Участник торгов выступает Маркет-мейкером или Специалистом, увеличивается на 20 минут за каждую следующую ценную бумагу, но не более 180 минут по каждой ценной бумаге. Дирекция Биржи вправе принять решение об изменении продолжительности КП при заключении соглашения по более чем одной ценной бумаге в случае необходимости осуществления дополнительных мер, направленных на поддержание ликвидности на рынке отдельных ценных бумаг.

13.11. Биржа осуществляет ежедневный контроль за исполнением Маркет-мейкерами и Специалистами обязательств, установленных в настоящем Разделе Правил, по следующим показателям:

- соответствие установленному размеру МДО величины совокупного объема заявок, цены которых находятся в пределах установленного для ценной бумаги предельного спреда;
- соблюдение времени КП;
- поддержание Маркет-мейкером заявок маркет-мейкера одной направленности по достижении ДО;
- иные показатели, определенные в нормативных правовых актах федерального органа исполнительной власти.

14. Заключение сделок в Режиме основных торгов

14.1. Режим основных торгов состоит из следующих периодов:

- предторгового периода;
- торговой сессии;
- послеторгового периода.

По решению Генерального директора Биржи в целях обеспечения стабилизации рынка отдельных ценных бумаг, впервые допускаемых к обращению в ЗАО «ФБ ММВБ», Режим основных торгов (с учетом условий, предусмотренных в п. 14.5. настоящего раздела Правил) вместо указанных периодов может состоять из следующих периодов:

- дискретного аукциона;
- торговой сессии;
- послеторгового периода.

14.2. Заключение сделок в предторговом периоде осуществляется перед каждой торговой сессией (если решением Генерального директора Биржи не определено иное). Заключение сделок в предторговом периоде Режиме основных торгов осуществляется в следующем порядке:

14.2.1. В предторговом периоде в Систему торгов подаются только лимитные заявки.

14.2.2. На основании поданных в предторговый период заявок по каждой ценной бумаге на момент окончания данного периода в Системе торгов определяется цена предторгового периода, обеспечивающая заключение сделок с наибольшим количеством ценных бумаг, являющихся предметом этих сделок.

14.2.3. Цена предторгового периода ценной бумаги определяется в следующем порядке:

- на основании поданных в предторговый период заявок рассчитывается в порядке убывания цены нарастающим итогом для каждого значения цены агрегированный спрос (количество ценных бумаг, выставленное на покупку), и в порядке возрастания цены нарастающим итогом для каждого значения цены рассчитывается агрегированное предложение (количество ценных бумаг, выставленное на продажу);
- для каждого значения цены определяется возможное количество ценных бумаг, которые могут быть предметом сделок (исходя из того, что сделки предторгового периода будут совершены по данной цене), как минимальное из двух значений – величины агрегированного спроса и величины агрегированного предложения;
- определяется значение цены, которое обеспечивает заключение

максимально возможного объема сделок;

- в случае, если указанным условиям удовлетворяют несколько значений цены, то цена предторгового периода определяется как среднее арифметическое максимального и минимального из этих значений.

14.2.4. Заключение сделки по заявкам, поданным в предторговый период, осуществляется при пересечении ее ценовых условий с ценой предторгового периода и при наличии встречных заявок в объеме, достаточном для заключения сделки. Пересечение ценовых условий имеет место:

- для поданной заявки на покупку - если цена предторгового периода не превышает цены, которая указана в поданной заявке;
- для поданной заявки на продажу - если цена предторгового периода не меньше, чем цена, которая указана в поданной заявке.

Если лимитная заявка с сохранением в котировках, поданная в предторговый период, удовлетворяется не полностью, то она (в размере неисполненной части) ставится в очередь с ценой, указанной в заявке, и принимает участие в ближайшей торговой сессии, если иное не определено решением Генерального директора Биржи.

14.2.5. Если наибольшая цена покупки среди всех поданных в предторговый период лимитных заявок не пересекается с наименьшей ценой продажи, или заявки на покупку или продажу отсутствуют в Системе торгов, цена предторгового периода не определяется.

14.2.6. При неравенстве спроса и предложения по цене предторгового периода в первую очередь удовлетворяются заявки на покупку с большей ценой, а на продажу - с меньшей ценой, а при равенстве цен - заявки, поданные ранее по времени.

14.2.7. Участник торгов во время предторгового периода имеет доступ к информации только о своих заявках (если решением Генерального директора Биржи не предусмотрено иное).

14.3. Торговая сессия проводится после окончания предторгового периода, если иное не определено в соответствии с п. 14.1. и п.п. 14.5.4. п.14.5. настоящего раздела Правил. Для участия в торговой сессии данного торгового дня принимаются лимитные заявки, заявки маркет-мейкера и рыночные заявки, поданные Участниками торгов в ходе данной торговой сессии, а также лимитные заявки с сохранением в котировках, находящиеся в Системе торгов к ее началу. Заключение сделок в торговой сессии Режимы основных торгов осуществляется в следующем порядке:

14.3.1. Заключение сделки по лимитной заявке и заявке маркет-мейкера осуществляется при пересечении ее ценовых условий с ценовыми условиями заявок противоположной направленности, зарегистрированными в Системе торгов. Пересечение ценовых условий имеет место:

- для поданной заявки на покупку - при наличии заявок на продажу с ценами, не превышающими цены, которая указана в поданной заявке;
- для поданной заявки на продажу - при наличии заявок на покупку с ценами, не меньшими, чем цена, которая указана в поданной заявке.

14.3.2. Заключение сделки по рыночной заявке осуществляется только при наличии заявок противоположной направленности.

14.3.3. Лимитные заявки, заявки маркет-мейкера и рыночные заявки удовлетворяются в соответствии со следующими правилами:

- сделка заключается по цене заявки, находящейся в очереди первой;
- размер заявки не влияет на ее приоритет.

14.3.4. Если лимитная заявка с сохранением в котировках или заявка маркет-мейкера удовлетворяется не полностью, то она (в размере неисполненной части) ставится в очередь по цене, указанной в заявке.

14.3.5. При постановке заявки в очередь ее место в очереди определяется ценой, указанной в заявке (первыми в очереди заявок на покупку находятся заявки с большими ценами; первыми в очереди заявок на продажу находятся заявки с меньшими ценами). Среди заявок с равными ценами первыми в очереди находятся заявки, поданные ранее.

14.3.6. Если лимитная заявка без сохранения в котировках или рыночная заявка удовлетворяется не полностью, то ее неисполненная часть снимается с торгов.

14.3.7. Участники торгов в ходе торговой сессии имеют доступ к информации о собственных заявках и заявках с двадцатью лучшими ценами (десять заявок на покупку и десять заявок на продажу), находящихся в очереди в Системе торгов (если решением Генерального директора Биржи не предусмотрено иное).

14.3.8. Заявки, не удовлетворенные в ходе торговой сессии, снимаются с торгов.

14.4. После каждой торговой сессии проводится подача заявок и заключение сделок в послеторговом периоде (если решением Генерального директора Биржи не определено иное), в течение которого заключаются сделки только по тем ценным бумагам, для которых может быть рассчитана цена послеторгового периода. Заключение сделок в послеторговом периоде Режиме основных торгов осуществляется в следующем порядке:

14.4.1. Цена послеторгового периода рассчитывается в Системе торгов как результат от деления суммарного объема сделок с данной ценной бумагой, заключенных в течение последних 30 минут Режиме основных торгов, на суммарное количество ценных бумаг в этих сделках. При отсутствии в течение последних 30 минут Режиме основных торгов сделок с данной ценной бумагой в качестве цены послеторгового периода используется средневзвешенная цена данной ценной бумаги; в случае отсутствия сделок

по данной ценной бумаге цена послеторгового периода не рассчитывается. В случае, если по ценной бумаге предусмотрено заключение сделок одновременно за российские рубли и за иностранную валюту, цена послеторгового периода определяется в соответствии с настоящим пунктом Правил только по сделкам за российские рубли, если иной порядок ее расчета не установлен решением Генерального директора Биржи.

14.4.2. В послеторговом периоде в Систему торгов подаются только заявки послеторгового периода (если решением Генерального директора Биржи не определено иное). Цена послеторгового периода, рассчитываемая в порядке, предусмотренном в п.п. 14.4.1. п. 14.1. настоящего Раздела Правил, автоматически указывается при регистрации заявки послеторгового периода в Системе торгов.

14.4.3. В момент окончания послеторгового периода регистрируются сделки по цене послеторгового периода при наличии заявок противоположной направленности, поданных в послеторговый период.

14.4.4. При неравенстве спроса и предложения по цене послеторгового периода в первую очередь удовлетворяются заявки, поданные ранее по времени.

14.4.5. Заявки послеторгового периода, не удовлетворенные при проведении послеторгового периода, снимаются с торгов.

14.4.6. Если заявка послеторгового периода удовлетворяется не полностью, то ее неисполненная часть снимается с торгов.

14.4.7. Участник торгов во время послеторгового периода имеет доступ к информации о собственных заявках и совокупных объемах всех заявок послеторгового периода, находящихся в Системе торгов (если решением Генерального директора Биржи не предусмотрено иное).

14.5. Проведение дискретного аукциона осуществляется в следующем порядке:

14.5.1. С момента начала проведения дискретного аукциона в Систему торгов принимаются лимитные заявки с сохранением в котировках.

14.5.2. На основании поданных заявок по истечении 15 минут с момента начала проведения дискретного аукциона, в Системе торгов определяется цена дискретного аукциона по ценной бумаге при условии наличия в Системе торгов заявок, совокупные параметры которых (количество участников торгов, подавших заявки; величина достаточного спроса; величина достаточного предложения; спрэд, определяемый как отношение разности между средневзвешенной ценой продажи и средневзвешенной ценой покупки, к средневзвешенной цене покупки) соответствуют условиям, устанавливаемым решением Генерального директора Биржи для данной ценной бумаги.

Величина достаточного предложения определяется как сумма количества ценных бумаг в заявках, поданных на продажу, рассчитанная нарастающим итогом в порядке возрастания цены.

Величина достаточного спроса определяется как сумма количества ценных бумаг в заявках, поданных на покупку, рассчитанная нарастающим итогом в порядке убывания цены.

14.5.3. При выполнении условий, указанных в п.п. 14.5.2. настоящего пункта Правил, определяется цена дискретного аукциона, рассчитываемая в следующем порядке:

- на основе поданных заявок нарастающим итогом в направлении убывания цены для каждого значения цены рассчитывается агрегированный спрос (количество ценных бумаг, выставленное на покупку), и в порядке возрастания цены нарастающим итогом для каждого значения цены рассчитывается агрегированное предложение (количество ценных бумаг, выставленное на продажу);

- для каждого значения цены определяется количество ценных бумаг, которые могут быть предметом сделок (исходя из того, что все сделки будут совершены по данной цене), как минимальное из двух значений – величины агрегированного спроса и величины агрегированного предложения для данного значения цены;

- из множества цен, указанных в поданных заявках, определяется цена дискретного аукциона, которая обеспечивает заключение максимально возможного объема сделок; при этом, если максимально возможный объем сделок достижим при нескольких значениях цены, то цена дискретного аукциона определяется как среднее арифметическое максимального и минимального из этих значений;

- если наибольшая цена покупки среди всех поданных в ходе дискретного аукциона лимитных заявок не пересекается с наименьшей ценой продажи, цена дискретного аукциона определяется как среднее арифметическое средневзвешенной цены продажи и средневзвешенной цены покупки.

14.5.4. Если в ходе дискретного аукциона по ценной бумаге цена дискретного аукциона не определена, начинается очередное проведение дискретного аукциона в течение периода времени, предусмотренного в п.п. 14.5.2. настоящего пункта Правил. При этом все ранее поданные в Систему торгов и не снятые заявки повторно участвуют в очередном дискретном аукционе. Количество дискретных аукционов, проводимых для одной ценной бумаги в течение торгового дня, не ограничено. Время окончания последнего дискретного аукциона не может быть позднее времени окончания торговой сессии Режиме основных торгов, установленного в соответствии с п. 2.6. Раздела 2 «Общие положения» настоящих Правил.

В случае, если время окончания дискретного аукциона совпадает со временем окончания торговой сессии, то в текущий торговый день торги данной ценной бумагой в периоде торговой сессии Режиме основных торгов не проводятся.

14.5.5. Если в течение дискретного аукциона цена дискретного аукциона не определена, торги данной ценной бумагой в Режиме основных торгов в следующий

торговый день начинаются с проведения дискретного аукциона (если иное не определено решением Генерального директора Биржи).

14.5.6. Если в ходе дискретного аукциона по ценной бумаге определена цена дискретного аукциона, то по окончании дискретного аукциона торги данной ценной бумагой осуществляются в течение торговой сессии и/или в послеторговом периоде Режимы основных торгов с учетом установленного в соответствии с п. 2.6. Раздела 2 «Общие положения» настоящих Правил времени проведения данных периодов торгов Режимы основных торгов.

14.5.7. Заключение сделок на основании заявки, поданной в ходе дискретного аукциона, осуществляется по цене дискретного аукциона при пересечении ее ценовых условий с ценой встречной заявки (заявок) в объеме, достаточном для заключения сделки. Пересечение ценовых условий имеет место:

- для поданной заявки на покупку - если цена дискретного аукциона не превышает цены, которая указана в поданной заявке;
- для поданной заявки на продажу - если цена дискретного аукциона не меньше, чем цена, которая указана в поданной заявке.

Если лимитная заявка с сохранением в котировках, поданная в ходе дискретного аукциона, не удовлетворяется или удовлетворяется не полностью, то она (в размере неисполненной части) сохраняется в очереди заявок с ценой, указанной в заявке.

При неравенстве спроса и предложения по цене дискретного аукциона в первую очередь удовлетворяются заявки на покупку с большей ценой, а на продажу - с меньшей ценой, а при равенстве цен - заявки, поданные ранее по времени.

14.5.8. Участник торгов во время дискретного аукциона имеет доступ к информации обо всех заявках, поданных в Систему торгов.

15. Заключение сделок в Режиме торгов «Неполные лоты»

15.1. В Режиме торгов «Неполные лоты» данного торгового дня заключаются сделки на основании лимитных и рыночных заявок, поданных Участниками торгов в ходе торгов в Режиме торгов «Неполные лоты».

15.2. При подаче Участником торгов заявки на совершение сделки в Режиме торгов «Неполные лоты» заявка не регистрируется в Системе торгов в случае, если количество ценных бумаг, указанное в заявке, равно или превышает количество ценных бумаг, установленное в качестве стандартного лота в соответствии с п. 9.2. Раздела 9 «Стандартный лот» настоящих Правил для данной ценной бумаги (если решением Генерального директора Биржи не предусмотрено иное).

15.3. Заключение сделки по лимитной заявке осуществляется при пересечении ее ценовых условий с ценовыми условиями заявок противоположной направленности, зарегистрированными в Системе торгов. Пересечение ценовых условий имеет место:

- для поданной заявки на покупку - при наличии заявок на продажу с ценами, не превышающими цены, которая указана в поданной заявке (минимальной цены продажи);
- для поданной заявки на продажу - при наличии заявок на покупку с ценами, не меньшими, чем цена, которая указана в поданной заявке (максимальной цены покупки).

15.4. Заключение сделки по рыночной заявке осуществляется только при наличии заявок противоположной направленности.

15.5. Лимитные и рыночные заявки удовлетворяются в соответствии со следующими правилами:

- сделка заключается по цене заявки, находящейся в очереди первой;
- размер заявки не влияет на ее приоритет.

15.6. Если лимитная заявка с сохранением в котировках удовлетворяется не полностью, то она (в размере неисполненной части) ставится в очередь по цене, указанной в заявке.

15.7. При постановке заявки в очередь ее место в очереди определяется ценой, указанной в заявке (первыми в очереди заявок на покупку находятся заявки с большими ценами; первыми в очереди заявок на продажу находятся заявки с меньшими ценами). Среди заявок с равными ценами первыми в очереди находятся заявки, зарегистрированные в Системе торгов ранее.

15.8. Если лимитная заявка без сохранения в котировках или рыночная заявка удовлетворяется не полностью, то ее неисполненная часть снимается с торгов.

15.9. Участники торгов в Режиме торгов «Неполные лоты» имеют доступ к информации о собственных заявках и заявках с двадцатью лучшими ценами (десять заявок на покупку и десять заявок на продажу), находящихся в очереди в Системе торгов (если решением Генерального директора Биржи не установлено иное).

16. Режим переговорных сделок

16.1. Торги по ценным бумагам в РПС проводятся в торговые дни, устанавливаемые в соответствии с п. 2.4. Раздела 2 «Общие положения» настоящих Правил.

16.2. Участник торгов с целью выразить намерение заключить сделку в РПС подает в Систему торгов безадресные заявки РПС. Участник торгов имеет право подать в

Систему торгов неограниченное число безадресных заявок РПС одной направленности по одной ценной бумаге по одному коду расчетов.

16.3. В безадресной заявке РПС должны быть указаны следующие реквизиты:

- вид заявки (безадресная заявка РПС);
- идентификатор Участника торгов, подавшего заявку;
- краткое наименование Участника торгов, подавшего заявку;
- направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу);
- наименование ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- цена за одну ценную бумагу;
- код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п.п. 1.1.14. Раздела 1 «Термины и определения» настоящих Правил);
- идентификатор трейдера (АСП трейдера).

16.4. Для заключения сделок в РПС Участники торгов подают в Систему торгов адресные заявки РПС. Участник торгов имеет право подавать неограниченное количество адресных заявок РПС.

16.5. В адресной заявке РПС должны быть указаны следующие реквизиты:

- вид заявки (адресная заявка РПС);
- идентификатор Участника торгов, подавшего заявку;
- код Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении);
- краткое наименование Участника торгов, подавшего заявку;
- краткое наименование или идентификатор Участника торгов, которому адресована заявка;
- направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу);
- наименование ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- цена за одну ценную бумагу;
- ставка фиксированного возмещения (процент от объема сделки для адресной заявки с кодом расчетов В0-В05, В06-В30);
- торгово-клиринговый счет;

- код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п.п. 1.1.14. Раздела 1 «Термины и определения» настоящих Правил);

- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе, эмитентов ценных бумаг));

- идентификатор трейдера (АСП трейдера).

Поле «ссылка» не является обязательным реквизитом, т.е. не обязательно для заполнения. В случае заполнения данного поля, в нем может быть указана любая последовательность букв, цифр или знаков.

Биржей для отдельного кода расчетов могут быть установлены предельные значения объема заявки для адресной заявки РПС.

Если в поле «ссылка» обоими контрагентами при заключении сделки в РПС указано «Соглашение», то взаимоотношения сторон в случае неисполнения сделки, заключенной в РПС, регулируются двусторонним соглашением.

При получении встречной адресной заявки РПС к своей безадресной заявке РПС с совпадающими условиями или адресной заявки РПС Участник торгов вправе до окончания торгов в РПС (если решением Генерального директора Биржи не установлено иное) либо заключить сделку на условиях, указанных в адресной заявке РПС, либо направить контрагенту адресную заявку РПС с новыми условиями, либо отклонить полученную заявку. При получении адресной заявки РПС с заполненным полем «ссылка» для заключения сделки необходимо направить контрагенту встречную адресную заявку РПС, в которой поле "ссылка" содержит информацию, точно соответствующую информации, содержащейся в поле "ссылка" полученной адресной заявки РПС.

16.6. Заключение сделки в РПС осуществляется в Системе торгов при совпадении следующих условий, указанных в двух встречных адресных заявках РПС:

- наименование (торговый код) ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- цена за одну ценную бумагу;
- ссылка (проверяемое поле, комментарий);
- ставка фиксированного возмещения;
- код расчетов.

Под встречными заявками понимаются заявки противоположной направленности, адресованные Участниками торгов друг другу.

Решением Генерального директора Биржи может быть предусмотрена возможность

заклучения сделки в Системе торгов при совпадении в двух встречных адресных заявках РПС всех условий, перечисленных в настоящем пункте Правил, за исключением количества ценных бумаг, выраженного в лотах.

16.7. При неисполнении Участником торгов обязательства по поставке ценных бумаг по сделке с кодом расчетов В0-В05 или В06-В30 данный Участник торгов:

- обязан уплатить в порядке, установленном в Правилах клиринга, Участнику торгов - контрагенту по сделке переменное возмещение в размере суммы денежных средств, определяемой как произведение количества ценных бумаг в данной сделке и положительной разницы между максимальной ценой возмещения по соответствующей ценной бумаге (рассчитанной в надлежащую дату исполнения сделки или в следующий расчетный день после надлежащей даты исполнения) и ценой за одну ценную бумагу, указанной в сделке;

- не имеет обязательств по уплате Участнику торгов - контрагенту по сделке переменного возмещения (если максимальная цена возмещения по ценной бумаге, являющейся предметом данной сделки, рассчитанная в надлежащую дату исполнения сделки или в следующий расчетный день после надлежащей даты исполнения, ниже или равна цене за одну ценную бумагу, указанной в сделке).

16.8. При неисполнении Участником торгов обязательства по уплате денежных средств по сделке с кодом расчетов В0-В05 или В06-В30 данный Участник торгов:

- обязан уплатить в порядке, установленном в Правилах клиринга, Участнику торгов - контрагенту по сделке переменное возмещение в размере суммы денежных средств, определяемой как произведение количества ценных бумаг в данной сделке и положительной разницы между ценой за одну ценную бумагу, указанной в сделке, и минимальной ценой возмещения по соответствующей ценной бумаге (рассчитанной в надлежащую дату исполнения сделки или в следующий расчетный день после надлежащей даты исполнения);

- не имеет обязательств по уплате Участнику торгов - контрагенту по сделке переменного возмещения (если минимальная цена возмещения по ценной бумаге, являющейся предметом данной сделки, рассчитанная в надлежащую дату исполнения сделки или в следующий расчетный день после надлежащей даты исполнения, выше или равна цене за одну ценную бумагу, указанной в сделке).

16.9. При неисполнении Участником торгов обязательств (по уплате денежных средств или по поставке ценных бумаг) по сделке с кодом расчетов В0-В05 или В06-В30 данный Участник торгов обязан уплатить Участнику торгов - контрагенту по сделке фиксированное возмещение в порядке, установленном в Правилах клиринга. При этом фиксированное возмещение рассчитывается как произведение ставки фиксированного возмещения, указанной в адресной заявке РПС, на объем данной сделки.

16.10. Переменное и фиксированное возмещение по сделкам с ценными бумагами, заключенным на Бирже за иностранную валюту, удерживается в российских рублях по курсу Банка России на дату неисполнения соответствующих сделок в порядке, установленном в Правилах клиринга.

16.11. Участник торгов имеет право отказаться от получения переменного и фиксированного возмещения, обеспечив поступление на Биржу письменного уведомления по форме, предусмотренной в Приложении №6 к настоящим Правилам, до даты уплаты переменного и фиксированного возмещения в соответствии с Правилами клиринга.

16.12. В случае, если оба Участника торгов - контрагента по сделке с кодом расчетов В0-В05 или В06-В30 не исполнили свои обязательства, то они не имеют взаимных обязательств по уплате фиксированного и переменного возмещения по данной сделке.

16.13. В РПС принимают участие безадресные заявки РПС и адресные заявки РПС, поданные Участниками торгов в ходе торгов текущего торгового дня в РПС (если решением Генерального директора Биржи не определено иное).

16.14. Участник торгов во время торгов имеет доступ к информации об адресных заявках РПС, направленных данному Участнику торгов, собственных адресных заявках РПС, а также обо всех безадресных заявках РПС, находящихся в Системе торгов.

17. Порядок заключения сделок РЕПО

17.1. Торги ценными бумагами по заключению сделок РЕПО с ценными бумагами проводятся в Режимх торгов «Аукцион РЕПО», «РЕПО с акциями», «РЕПО с облигациями», «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», в торговые дни, устанавливаемые в соответствии с п. 2.4. Раздела 2 «Общие положения» настоящих Правил.

17.2. Для безадресных заявок РЕПО (акции), безадресных заявок РЕПО (облигации), адресных заявок РЕПО (акции) и адресных заявок РЕПО (облигации) Биржей устанавливаются возможные предельные значения, включая точность указания, следующих реквизитов:

- Ставка РЕПО;
- Сумма РЕПО;
- Срок сделки РЕПО;
- Начальный дисконт;
- Максимальное предельное значение дисконта;

- Минимальное предельное значение дисконта;
- Предельные значения объема заявки для отдельного кода расчетов (только для адресных заявок РЕПО (акции) и адресных заявок РЕПО (облигации));
- Шаг дисконта.

17.3. Расчет цен первой и второй частей сделки РЕПО осуществляется с точностью до 4-х знаков после запятой (если решением Генерального директора Биржи не установлено иное). В случае, если эмиссионными документами предусмотрено погашение части основного долга (амортизационные выплаты), расчет цены второй части сделки РЕПО в Режиме торгов «Аукцион РЕПО», «РЕПО с облигациями», «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» осуществляется с учетом части номинальной стоимости, непогашенной на момент проведения расчета.

17.4. Для каждого режима торгов, в котором заключаются сделки РЕПО в соответствии с настоящим Разделом Правил, решением Генерального директора Биржи устанавливается перечень ценных бумаг, с которыми допускается совершение сделок РЕПО.

17.5. Заключение сделок РЕПО в Режиме торгов «РЕПО с акциями» осуществляется в следующем порядке:

17.5.1. В Режиме торгов «РЕПО с акциями» принимают участие безадресные заявки РЕПО (акции) и адресные заявки РЕПО (акции), поданные Участниками торгов в ходе торгов текущего торгового дня в данном Режиме торгов (если решением Генерального директора Биржи не установлено иное).

17.5.2. Участник торгов с целью выразить намерение заключить сделку РЕПО в Режиме торгов «РЕПО с акциями» подает в Систему торгов безадресные заявки РЕПО (акции). Участник торгов имеет право подать в Систему торгов неограниченное количество безадресных заявок РЕПО (акции) по одной ценной бумаге и по одному коду расчетов (если решением Генерального директора Биржи не установлено иное).

17.5.3. В безадресной заявке РЕПО (акции) должны быть указаны следующие реквизиты:

- вид заявки (безадресная заявка РЕПО (акции));
- идентификатор Участника торгов, подавшего заявку;
- краткое наименование Участника торгов, подавшего заявку;
- направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу по первой части сделки РЕПО);
- наименование ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;

- сумма РЕПО;
- начальное значение дисконта;
- ставка РЕПО;
- срок сделки РЕПО;
- код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п.п. 1.1.14. Раздела 1 «Термины и определения» настоящих Правил);

- идентификатор трейдера (АСП трейдера).

17.5.4. Для заключения сделок РЕПО в Режиме торгов «РЕПО с акциями» Участники торгов подают в Систему торгов адресные заявки РЕПО (акции). Участник торгов имеет право подавать в Систему торгов неограниченное количество таких адресных заявок РЕПО.

17.5.5. В адресной заявке РЕПО(акции) должны быть указаны следующие реквизиты:

- вид заявки (адресная заявка РЕПО (акции));
- идентификатор Участника торгов, подавшего заявку;
- код Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении);
- краткое наименование Участника торгов, подавшего заявку;
- краткое наименование или идентификатор Участника торгов, которому адресована заявка;
- направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу по первой части сделки РЕПО);
- ставка РЕПО в процентах годовых;
- срок сделки РЕПО (в календарных днях, для внутридневной сделки РЕПО срок сделки РЕПО равен нулю);
- наименование (торговый код) ценной бумаги;
- торгово-клиринговый счет;
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг));
- ставка фиксированного возмещения (процент от Суммы РЕПО);
- код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге

устанавливается в соответствии с п.п. 1.1.14. Раздела 1 «Термины и определения» настоящих Правил);

- сумма РЕПО;
- ссылка (проверяемое поле, комментарий);
- начальное значение дисконта, %;
- максимальное предельное значение дисконта, %;
- минимальное предельное значение дисконта, %;
- количество ценных бумаг, в лотах;
- идентификатор трейдера (АСП трейдера).

Поле «ссылка» не является обязательным реквизитом, т.е. не обязательно для заполнения. В случае заполнения данного поля, в нем может быть указана любая последовательность букв, цифр или знаков.

Если в поле «ссылка» обоими контрагентами при заключении сделки РЕПО указано «Доход», то покупатель по первой части РЕПО обязан передать продавцу по первой части РЕПО любые дивиденды, проценты или иное распределение (далее - Доход) на ценные бумаги, в отношении которых заключена сделка РЕПО, в течение 10 (десяти) календарных дней, следующих за днем получения им Дохода, если право на его получение возникло у покупателя по первой части РЕПО в период с даты исполнения первой части сделки РЕПО по дату исполнения второй части сделки РЕПО включительно. В том случае, если в поле "ссылка" контрагентами при заключении сделки РЕПО не указано "Доход", то взаимоотношения сторон в отношении Дохода урегулируются в двусторонних соглашениях.

Если в поле «ссылка» обоими контрагентами при заключении сделки РЕПО указано «Прил.№14», то урегулирование взаимоотношений по получению (возврату) Дохода, а также в случаях неисполнения обязательств по второй части сделки РЕПО осуществляется с соблюдением требований, предусмотренных в Приложении № 14 к настоящим Правилам.

Если в поле «ссылка» обоими контрагентами при заключении сделки РЕПО указано «Соглашение», то взаимоотношения Участников торгов, являющихся сторонами по сделке РЕПО, по получению (возврату) Дохода, а также в случае неисполнения обязательств по второй части сделки РЕПО, регулируются двусторонним соглашением.

17.5.6. При получении встречной адресной заявки РЕПО (акции) к своей безадресной заявке РЕПО (акции) с совпадающими условиями или адресной заявки РЕПО (акции) Участник торгов вправе до окончания торгов в Режиме торгов «РЕПО с акциями» (если решением Генерального директора Биржи не установлено иное) либо заключить сделку РЕПО на условиях, указанных в адресной заявке РЕПО (акции), либо направить

контрагенту адресную заявку РЕПО (акции) с новыми условиями, либо отклонить полученную заявку. При получении адресной заявки РЕПО (акции) с заполненным полем «ссылка» для заключения сделки необходимо направить контрагенту встречную адресную заявку РЕПО (акции), в которой поле "ссылка" содержит информацию, точно соответствующую информации, содержащейся в поле "ссылка" полученной адресной заявки РЕПО (акции).

17.5.7. Реквизиты заявок: сумма РЕПО, количество ценных бумаг и начальное значение дисконта - являются взаимосвязанными, и указание Участником торгов в адресной заявке РЕПО (акции) любых двух из них является достаточным для расчета в Системе торгов третьего реквизита по следующим формулам:

$$Q = S / ((1 - Dn / 100\%) * Pr),$$

$$S = (1 - Dn / 100\%) * Q * Pr,$$

$$Dn = (1 - S / (Q * Pr)) * 100\%, \text{ где}$$

Dn - начальное значение дисконта;

S - Сумма РЕПО, рассчитывается с точностью до копеек;

Q - Количество ценных бумаг, рассчитывается с округлением в сторону увеличения до целого числа;

Pr - расчетная цена по одной ценной бумаге, методика определения которой устанавливается решением Генерального директора Биржи.

17.5.8. Цена первой части сделки РЕПО рассчитывается по следующей формуле:

$$P_1 = S / Q, \text{ где}$$

P_1 - Цена за одну ценную бумагу по первой части сделки РЕПО;

S - Сумма РЕПО;

Q - Количество ценных бумаг.

17.5.9. При указании Участником торгов в адресной заявке РЕПО (акции) следующих реквизитов:

17.5.9.1. Суммы РЕПО и количества ценных бумаг:

В Системе торгов рассчитывается цена первой части сделки РЕПО. Исходя из рассчитанной цены первой части сделки РЕПО, в Системе торгов рассчитывается новая (скорректированная) сумма РЕПО (путем произведения количества ценных бумаг на цену первой части сделки РЕПО). С учетом новой (скорректированной) суммы РЕПО в Системе торгов рассчитывается начальное значение дисконта для данной сделки РЕПО.

17.5.9.2. Суммы РЕПО и начального значения дисконта:

В Системе торгов рассчитывается количество ценных бумаг и цена первой части

сделки РЕПО. Исходя из рассчитанной цены первой части сделки РЕПО, в Системе торгов рассчитывается новая (скорректированная) сумма РЕПО (путем произведения количества ценных бумаг на цену первой части сделки РЕПО). С учетом новой (скорректированной) суммы РЕПО в Системе торгов рассчитывается новое (скорректированное) начальное значение дисконта для данной сделки РЕПО.

17.5.9.3. Количества ценных бумаг и начального значения дисконта:

В Системе торгов рассчитывается сумма РЕПО и цена первой части сделки РЕПО. Исходя из рассчитанной цены первой части сделки РЕПО, в Системе торгов рассчитывается новая (скорректированная) сумма РЕПО (путем произведения количества ценных бумаг на цену первой части сделки РЕПО). С учетом новой (скорректированной) суммы РЕПО в Системе торгов рассчитывается новое (скорректированное) начальное значение дисконта для данной сделки РЕПО.

17.5.9.4. Суммы РЕПО, количества ценных бумаг и начального значения дисконта:

В Системе торгов рассчитывается цена первой части сделки РЕПО. Исходя из рассчитанной цены первой части сделки РЕПО, в Системе торгов рассчитывается новая (скорректированная) сумма РЕПО (путем произведения количества ценных бумаг на цену первой части сделки РЕПО). С учетом новой (скорректированной) суммы РЕПО в Системе торгов рассчитывается новое (скорректированное) начальное значение дисконта для данной сделки РЕПО.

17.5.10. Для указанных в адресной заявке РЕПО (акции) минимального и максимального предельных значений дисконта, а также для указанного в адресной заявке РЕПО (акции) или рассчитанного в соответствии с настоящими Правилами в Системе торгов начального значения дисконта должны соблюдаться следующие соотношения:

- Максимальное предельное значение дисконта больше минимального предельного значения дисконта.
- Начальное значение дисконта больше минимального предельного значения дисконта и меньше максимального предельного значения дисконта.

При несоблюдении хотя бы одного из указанных в настоящем подпункте Правил соотношений соответствующая адресная заявка РЕПО (акции) не регистрируется (автоматически отклоняется) в Системе торгов.

17.5.11. Адресная заявка РЕПО (акции) Участника торгов (если решением Генерального директора Биржи не установлено иное) не регистрируется Системой торгов при указании в ней наименования (торгового кода) ценной бумаги, по которой в предшествующий торговый день на Бирже отсутствовала расчетная цена, методика определения которой устанавливается решением Генерального директора Биржи, за исключением адресных заявок РЕПО (акции), в которых Участником торгов указаны

следующие реквизиты: Сумма РЕПО и количество ценных бумаг.

17.5.12. При получении адресной заявки РЕПО (акции) Участник торгов вправе до окончания торгов в Режиме торгов «РЕПО с акциями» (если решением Генерального директора Биржи не установлено иное) либо заключить сделку РЕПО на условиях, указанных в полученной заявке, либо направить контрагенту адресную заявку РЕПО (акции) с новыми условиями, либо отклонить полученную заявку.

17.5.13. Заключение сделки РЕПО в Режиме торгов «РЕПО с акциями» осуществляется в Системе торгов при совпадении следующих условий, указанных в двух встречных адресных заявках РЕПО (акции):

- наименование (торговый код) ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- сумма РЕПО;
- срок сделки РЕПО;
- ставка РЕПО;
- ссылка;
- ставка фиксированного возмещения;
- начальное значение дисконта, %;
- максимальное предельное значение дисконта, %;
- минимальное предельное значение дисконта, %;
- код расчетов.

Под встречными адресными заявками РЕПО (акции) понимаются заявки противоположной направленности, адресованные Участниками торгов друг другу.

17.5.14. В случае уплаты продавцом по первой части сделки РЕПО покупателю по первой части сделки РЕПО компенсационных взносов в денежной форме, сумма РЕПО уменьшается на величину таких компенсационных взносов в дату их внесения. В случае отсутствия в течение срока РЕПО по сделке РЕПО компенсационных взносов в денежной форме сумма РЕПО остается неизменной.

17.5.15. В случае внесения покупателем по первой части сделки РЕПО продавцу по первой части сделки РЕПО компенсационных взносов в форме ценных бумаг, текущее количество ценных бумаг по сделке РЕПО (обязательство по второй части сделки РЕПО для покупателя перед продавцом по первой части сделки РЕПО) уменьшается на количество ценных бумаг, составляющих величину таких компенсационных взносов (на дату их внесения). Если внесения компенсационных взносов в форме ценных бумаг не требуется, то текущее количество ценных бумаг по сделке РЕПО остается неизменным.

17.5.16. Цена второй части сделки РЕПО рассчитывается каждый расчетный день, начиная с даты надлежащего исполнения первой части сделки РЕПО, заключенной в Режиме торгов «РЕПО с акциями», до даты, следующей за датой фактического исполнения второй части этой сделки РЕПО, или за датой неисполнения этой сделки РЕПО.

$$P_{2j} = \left(S + I_j + S_j * \frac{R}{100} * \left(\frac{T'_{365}}{365} + \frac{T''_{366}}{366} \right) \right) / Q, \text{ где}$$

P_{2j} - Цена за одну ценную бумагу по второй части сделки РЕПО (цена выкупа) в текущий (j-ый) день;

i-ый день - дата исполнения первой части сделки РЕПО либо дата последнего изменения перед текущим расчетным (j-ым) днем следующих условий по сделке РЕПО: Сумма РЕПО и/или количество ценных бумаг;

I_j - доход по сделке РЕПО в j-ый день;

$$I_j = I_i + S_i * \frac{R}{100} * \left(\frac{T'_{365}}{365} + \frac{T'_{366}}{366} \right)$$

S - Сумма РЕПО;

S_i - Сумма РЕПО в i-ый день;

S_j - Сумма РЕПО на конец текущего (j-ого) дня;

R - Ставка РЕПО;

Для внутрисуточных сделок РЕПО срок между датой заключения сделки и датой исполнения принимается равным 1 (единице) для целей расчета цены второй части.

T'_{365} - фактическое число календарных дней между i-ым днем и текущим днем (j-ый день), приходящееся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T'_{366} - фактическое число календарных дней между i-ым днем и текущим днем (j-ый день), приходящееся на календарный год, состоящий из 366 дней;

T''_{365} - фактическое число календарных дней между текущим днем (j-ый день) и датой исполнения сделки, приходящееся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T''_{366} - фактическое число календарных дней между текущим днем (j-ый день) и датой исполнения сделки, приходящееся на календарный год, состоящий из 366 дней;

N_j - Количество ценных бумаг по сделке РЕПО на конец текущего (j-ого) дня;

Q - Количество ценных бумаг первой части сделки РЕПО.

17.5.17. Одновременно с ценой второй части сделки РЕПО каждый расчетный день, начиная с даты надлежащего исполнения первой части сделки РЕПО, заключенной в Режиме торгов «РЕПО с акциями», до даты, следующей за датой фактического

исполнения второй части этой сделки РЕПО, или за датой неисполнения этой сделки РЕПО, рассчитывается стоимость обратного выкупа по сделке РЕПО (текущее обязательство по второй части сделки РЕПО продавца перед покупателем по первой части сделки РЕПО):

$$L_j = (P_{2j} * Q) - (S - S_j), \text{ где}$$

L_j - Стоимость обратного выкупа по сделке РЕПО на конец текущего (j-го) дня;

P_{2j} - Цена за одну ценную бумагу по второй части сделки РЕПО (цена выкупа) в текущий (j-ый) день;

N_j - Количество ценных бумаг по сделке РЕПО на конец текущего (j-ого) дня;

Q - Количество ценных бумаг первой части сделки РЕПО.

S - Сумма РЕПО;

S_j - Сумма РЕПО на конец текущего (j-ого) дня.

17.5.18. Участник торгов во время торгов имеет доступ к информации об адресных заявках РЕПО (акции), направленных данному Участнику торгов, и собственных адресных заявках РЕПО (акции), находящихся в Системе торгов.

17.6. Заключение сделок РЕПО в Режиме торгов «РЕПО с облигациями» осуществляется в следующем порядке:

17.6.1. В Режиме торгов «РЕПО с облигациями» принимают участие безадресные заявки РЕПО (облигации) и адресные заявки РЕПО (облигации), поданные Участниками торгов в ходе торгов текущего торгового дня в данном режиме торгов (если решением Генерального директора Биржи не установлено иное).

17.6.2. Участник торгов с целью выразить намерение заключить сделку РЕПО с облигациями в Режиме торгов «РЕПО с облигациями» подает в Систему торгов безадресные заявки РЕПО (облигации). Участник торгов имеет право подать в Систему торгов неограниченное количество безадресных заявок РЕПО (облигации) по одной ценной бумаге и по одному коду расчетов (если решением Генерального директора Биржи не установлено иное).

17.6.3. В безадресной заявке РЕПО (облигации) должны быть указаны следующие реквизиты:

- вид заявки (безадресная заявка РЕПО (облигации));
- идентификатор Участника торгов, подавшего заявку;
- краткое наименование Участника торгов, подавшего заявку;
- направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу по первой части сделки РЕПО);

- наименование ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- сумма РЕПО;
- начальное значение дисконта;
- ставка РЕПО;
- срок сделки РЕПО;
- код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п.п. 1.1.14. Раздела 1 «Термины и определения» настоящих Правил);

- идентификатор трейдера (АСП трейдера).

17.6.4. Для заключения сделок РЕПО в Режиме торгов «РЕПО с облигациями» Участники торгов подают в Систему торгов адресные заявки РЕПО (облигации). Участник торгов имеет право подавать в Систему торгов неограниченное количество адресных заявок РЕПО (облигации).

17.6.5. В адресной заявке РЕПО (облигации) указываются следующие реквизиты:

- вид заявки (адресная заявка РЕПО(облигации));
- идентификатор Участника торгов, подавшего заявку;
- код Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении);
- краткое наименование Участника торгов, подавшего заявку;
- краткое наименование или идентификатор Участника торгов, которому адресована заявка;
- направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу по первой части сделки РЕПО);
- ставка РЕПО в процентах годовых;
- срок сделки РЕПО (в календарных днях, для внутрисуточной сделки РЕПО срок сделки РЕПО равен нулю);
- наименование (торговый код) ценной бумаги;
- торгово-клиринговый счет;
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг));
- ставка фиксированного возмещения (процент от Суммы РЕПО);

- код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п.п. 1.1.14. Раздела 1 «Термины и определения» настоящих Правил);

- сумма РЕПО, включая НКД;
- начальное значение дисконта, %;
- ссылка;
- максимальное предельное значение дисконта, %;
- минимальное предельное значение дисконта, %;
- количество ценных бумаг, в лотах;
- идентификатор трейдера (АСП трейдера).

Поле «ссылка» не является обязательным реквизитом, т.е. не обязательно для заполнения. В случае заполнения данного поля, в нем может быть указана любая последовательность букв, цифр или знаков.

Если в поле «ссылка» обоими контрагентами при заключении сделки РЕПО указано «Прил.№14», то урегулирование взаимоотношений по получению (возврату) Дохода, а также в случаях неисполнения обязательств по второй части сделки РЕПО осуществляется с соблюдением требований, предусмотренных в Приложении № 14 к настоящим Правилам.

Если в поле «ссылка» обоими контрагентами при заключении сделки РЕПО указано «Соглашение», то взаимоотношения Участников торгов, являющихся сторонами по сделке РЕПО, по получению (возврату) Дохода, а также в случае неисполнения обязательств по второй части сделки РЕПО, регулируются двусторонним соглашением.

17.6.6. Реквизиты заявок: сумма РЕПО, количество ценных бумаг и начальное значение дисконта - являются взаимосвязанными, и указание Участником торгов в адресной заявке РЕПО (облигации) любых двух из них является достаточным для расчета в Системе торгов третьего реквизита по следующим формулам:

$$Q = S / ((1 - Dn / 100\%) * (Pr + At)),$$

$$S = (1 - Dn / 100\%) * Q * (Pr + At),$$

$$Dn = (1 - S / (Q * (Pr + At))) * 100\%, \text{ где}$$

Dn - начальное значение дисконта;

S - Сумма РЕПО, рассчитывается с точностью до копеек;

Q - Количество ценных бумаг, рассчитывается с округлением в сторону увеличения до целого числа;

Pr - расчетная цена по одной ценной бумаге, методика определения которой

устанавливается решением Генерального директора Биржи;

At - НКД по одной ценной бумаге, на дату исполнения первой части сделки РЕПО.

17.6.7. Цена первой части сделки РЕПО рассчитывается по следующей формуле:

$$P_1 = (S - At * Q) / Q, \text{ где}$$

P_1 - Цена за одну ценную бумагу по первой части сделки РЕПО;

S - Сумма РЕПО;

Q - Количество ценных бумаг;

At - НКД по одной ценной бумаге, на дату исполнения первой части сделки РЕПО.

17.6.8. При указании Участником торгов в адресной заявке РЕПО (облигации) следующих реквизитов:

17.6.8.1. Суммы РЕПО и количества ценных бумаг:

В Системе торгов рассчитывается цена первой части сделки РЕПО. Исходя из рассчитанной цены первой части сделки РЕПО, в Системе торгов рассчитывается новая (скорректированная) сумма РЕПО (путем произведения количества ценных бумаг на цену первой части сделки РЕПО и НКД по одной ценной бумаге на дату исполнения первой части сделки РЕПО). С учетом новой (скорректированной) суммы РЕПО в Системе торгов рассчитывается начальное значение дисконта для данной сделки РЕПО.

17.6.8.2. Суммы РЕПО и начального значения дисконта:

В Системе торгов рассчитывается количество ценных бумаг и цена первой части сделки РЕПО. Исходя из рассчитанной цены первой части сделки РЕПО, в Системе торгов рассчитывается новая (скорректированная) сумма РЕПО (путем произведения количества ценных бумаг на цену первой части сделки РЕПО и НКД по одной ценной бумаге на дату исполнения первой части сделки РЕПО). С учетом новой (скорректированной) суммы РЕПО в Системе торгов рассчитывается новое (скорректированное) начальное значение дисконта для данной сделки РЕПО.

17.6.8.3. Количество ценных бумаг и начального значения дисконта:

В Системе торгов рассчитывается сумма РЕПО и цена первой части сделки РЕПО. Исходя из рассчитанной цены первой части сделки РЕПО, в Системе торгов рассчитывается новая (скорректированная) сумма РЕПО (путем произведения количества ценных бумаг на цену первой части сделки РЕПО и НКД по одной ценной бумаге на дату исполнения первой части сделки РЕПО). С учетом новой (скорректированной) суммы РЕПО в Системе торгов рассчитывается новое (скорректированное) начальное значение дисконта для данной сделки РЕПО.

17.6.8.4. Суммы РЕПО, количества ценных бумаг и начального значения дисконта:

В Системе торгов рассчитывается цена первой части сделки РЕПО. Исходя из рассчитанной цены первой части сделки РЕПО, в Системе торгов рассчитывается новая (скорректированная) сумма РЕПО (путем произведения количества ценных бумаг на цену первой части сделки РЕПО и НКД по одной ценной бумаге на дату исполнения первой части сделки РЕПО). С учетом новой (скорректированной) суммы РЕПО в Системе торгов рассчитывается новое (скорректированное) начальное значение дисконта для данной сделки РЕПО.

17.6.9. Для указанных в адресной заявке РЕПО (облигации) минимального и максимального предельных значений дисконта, а также для указанного в адресной заявке РЕПО (облигации) или рассчитанного в соответствии с настоящими Правилами в Системе торгов начального значения дисконта должны соблюдаться следующие соотношения:

- Максимальное предельное значение дисконта больше минимального предельного значения дисконта.
- Начальное значение дисконта больше минимального предельного значения дисконта и меньше максимального предельного значения дисконта.

При несоблюдении хотя бы одного из указанных в настоящем подпункте Правил соотношений соответствующая адресная заявка РЕПО (облигации) не регистрируется (автоматически отклоняется) в Системе торгов.

17.6.10. Адресная заявка РЕПО (облигации) Участника торгов не регистрируется Системой торгов при указании в ней срока сделки РЕПО и/или кода расчетов, в соответствии с которыми дата исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО приходится на любой день после последнего торгового дня текущего купонного периода.

17.6.11. Адресная заявка РЕПО (облигации) Участника торгов не регистрируется в Системе торгов при указании в ней срока сделки РЕПО и/или кода расчетов, в соответствии с которыми дата исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО приходится на любой день после истечения срока обращения соответствующей облигации на Бирже.

17.6.12. Адресная заявка РЕПО (облигации) Участника торгов (если решением Генерального директора Биржи не установлено иное) не регистрируется в Системе торгов при указании в ней наименования (торгового кода) ценной бумаги, по которой в предшествующий торговый день на Бирже отсутствовала расчетная цена, методика определения которой устанавливается решением Генерального директора Биржи, за исключением адресных заявок РЕПО (облигации), в которых Участником торгов указаны следующие реквизиты: Сумма РЕПО и количество ценных бумаг.

17.6.13. При получении встречной адресной заявки РЕПО (облигации) к своей безадресной заявке РЕПО (облигации) с совпадающими условиями или адресной заявки

РЕПО (облигации) Участник торгов вправе до окончания торгов в режиме торгов «РЕПО с облигациями» (если решением Генерального директора Биржи не установлено иное) либо заключить сделку РЕПО на условиях, указанных в полученной заявке, либо направить контрагенту адресную заявку РЕПО (облигации) с новыми условиями, либо отклонить полученную заявку. При получении адресной заявки РЕПО (облигации) с заполненным полем «ссылка» для заключения сделки необходимо направить контрагенту встречную адресную заявку РЕПО (облигации), в которой поле "ссылка" содержит информацию, точно соответствующую информации, содержащейся в поле "ссылка" полученной адресной заявки РЕПО (облигации).

17.6.14. Заключение сделки РЕПО в Режиме торгов «РЕПО с облигациями» осуществляется в Системе торгов при совпадении следующих условий, указанных в двух встречных адресных заявках РЕПО (облигации):

- наименование (торговый код) ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- сумма РЕПО;
- срок сделки РЕПО;
- ставка РЕПО;
- ссылка;
- ставка фиксированного возмещения;
- начальное значение дисконта, %;
- максимальное предельное значение дисконта, %;
- минимальное предельное значение дисконта, %;
- код расчетов.

Под встречными адресными заявками РЕПО (облигации) понимаются заявки противоположной направленности, адресованные Участниками торгов друг другу.

17.6.15. В случае уплаты продавцом по первой части сделки РЕПО покупателю по первой части сделки РЕПО компенсационных взносов в денежной форме сумма РЕПО уменьшается на величину таких компенсационных взносов в дату их внесения. В случае отсутствия в течение срока РЕПО по сделке РЕПО компенсационных взносов в денежной форме (получения от Клиринговой организации информации об отказе от компенсационного взноса) сумма РЕПО остается неизменной.

17.6.16. В случае начисления покупателю по первой части сделки РЕПО в течение срока сделки РЕПО купонного (процентного) дохода по облигациям и/или погашения части основного долга (проведение амортизационной выплаты) по облигациям, 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, а в случае принятия Генеральным директором Биржи решения в соответствии с п. 11.3. Раздела 11 «Особенности проведения торгов по облигациям» - с даты, следующей за датой фиксации списка владельцев. В случае отсутствия в течение срока сделки РЕПО по сделке начислений купонных (процентных) доходов и погашения части основного долга (проведение амортизационной выплаты) сумма РЕПО остается неизменной.

17.6.17. В случае внесения покупателем по первой части сделки РЕПО продавцу по первой части сделки РЕПО компенсационных взносов в форме ценных бумаг, текущее количество ценных бумаг по сделке РЕПО (обязательство по второй части сделки РЕПО для покупателя перед продавцом по первой части сделки РЕПО) уменьшается на количество ценных бумаг, составляющих величину таких компенсационных взносов (на дату их внесения). Если внесения компенсационных взносов в форме ценных бумаг не требуется, то текущее количество ценных бумаг по сделке РЕПО остается неизменным.

17.6.18. Цена второй части сделки РЕПО рассчитывается каждый расчетный день, начиная с даты надлежащего исполнения первой части сделки РЕПО, заключенной в Режиме торгов «РЕПО с облигациями», до даты, следующей за датой фактического исполнения второй части этой сделки РЕПО, или за датой неисполнения этой сделки РЕПО.

$$P_{2j} = \left(S + I_j + S_j * \frac{R}{100} \left(\frac{T_{365}''}{365} + \frac{T_{366}''}{366} \right) - (A_j + N_j * At_2) \right) / Q, \text{ где}$$

P_{2j} - Цена за одну ценную бумагу по второй части сделки РЕПО (цена выкупа) в текущий (j-ый) день;

i-ый день - дата исполнения первой части сделки РЕПО либо дата последнего изменения перед текущим расчетным (j-ым) днем следующих условий по сделке РЕПО: Сумма РЕПО и/или количество ценных бумаг;

I_j - доход по сделке РЕПО в j-ый день;

$$I_j = I_i + S_i * \frac{R}{100} * \left(\frac{T_{365}'}{365} + \frac{T_{366}'}{366} \right)$$

S - Сумма РЕПО;

S_i - Сумма РЕПО в i-ый день;

S_j - Сумма РЕПО на конец текущего (j-ого) дня;

R - Ставка РЕПО;

Для внутрисуточных сделок РЕПО срок между датой заключения сделки и датой исполнения принимается равным 1 (единице) для целей расчета цены второй части.

T'_{365} - фактическое число календарных дней между i -ым днем и текущим днем (j -ый день), приходящееся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T'_{366} - фактическое число календарных дней между i -ым днем и текущим днем (j -ый день), приходящееся на календарный год, состоящий из 366 дней;

T''_{365} - фактическое число календарных дней между текущим днем (j -ый день) и датой исполнения сделки, приходящееся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T''_{366} - фактическое число календарных дней между текущим днем (j -ый день) и датой исполнения сделки, приходящееся на календарный год, состоящий из 366 дней;

N_j - Количество ценных бумаг по сделке РЕПО на конец текущего (j -ого) дня;

Q - Количество ценных бумаг первой части сделки РЕПО;

A_j - сумма НКД, рассчитанная на текущий день, по уплаченным бумагами компенсационным взносам:

$$A_j = \sum_{i=0}^j (M_{oi} * A_{ii}), \text{ где}$$

M_{oi} - компенсационный взнос в форме ценных бумаг в i -ый день;

A_{ii} - размер НКД в i -ый день;

At_2 - Размер НКД (на дату исполнения).

17.6.19. Одновременно с ценой второй части сделки РЕПО каждый расчетный день, начиная с даты надлежащего исполнения первой части сделки РЕПО, заключенной в Режиме торгов «РЕПО с облигациями», до даты, следующей за датой фактического исполнения второй части этой сделки РЕПО, или за датой неисполнения этой сделки РЕПО, рассчитывается стоимость обратного выкупа по сделке РЕПО (текущее обязательство по второй части сделки РЕПО продавца перед покупателем по первой части сделки РЕПО):

$$L_j = (P_{2j} * Q + (A_j + N_j * At_2)) - (S - S_j), \text{ где}$$

L_j - Стоимость обратного выкупа по сделке РЕПО на конец текущего (j -го) дня;

P_{2j} - Цена за одну ценную бумагу по второй части сделки РЕПО (цена выкупа) в текущий (j -ый) день;

N_j - Количество ценных бумаг по сделке РЕПО на конец текущего (j -ого) дня;

Q - Количество ценных бумаг первой части сделки РЕПО.

A_j - сумма НКД, рассчитанная на текущий день, по уплаченным бумагами компенсационным взносам;

At_2 - Размер НКД (на дату исполнения);

S - Сумма РЕПО;

S_j - Сумма РЕПО на конец текущего (j-ого) дня.

17.6.20. Участник торгов во время торгов имеет доступ к информации об адресных заявках РЕПО (облигации), направленных данному Участнику торгов, и собственных адресных заявках РЕПО (облигации), находящихся в Системе торгов.

17.7. Заключение сделок РЕПО с Банком России может проводиться в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» и в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: фикс.ставка».

17.7.1. Заключение сделок РЕПО с Банком России осуществляется в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» в следующем порядке:

17.7.1.1. Заключение сделок РЕПО с Банком России в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» проводится в форме Аукциона на основании адресных заявок, выставляемых Участниками торгов КО в адрес Банка России, удовлетворяющего их путем подачи встречных адресных заявок, в соответствии с требованиями п.п. 17.5.6. - 17.5.17. п. 17.5. и п.п. 17.6.6. - 17.6.19. п. 17.6. настоящего Раздела Правил.

17.7.1.2. В торгах в данном Режиме торгов могут принимать участие Банк России и Участники торгов КО, выступающие от своего имени и за свой счет, с которыми Банком России заключены необходимые соглашения.

17.7.1.3. Режим торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» состоит из периода сбора заявок и периода удовлетворения заявок. Во время периода сбора заявок Участники торгов КО имеют право подавать заявки и снимать ранее поданные заявки. По окончании периода сбора заявок Участник торгов КО не может снять поданную заявку.

17.7.1.4. При проведении торгов по облигациям в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» сделки заключаются на основании адресных заявок РЕПО (облигации), поданных Участниками торгов в ходе торгов текущего торгового дня в данном Режиме торгов. В адресных заявках РЕПО (облигации) должны быть указаны реквизиты, предусмотренные в п.п. 17.6.5. п. 17.6. настоящего Раздела Правил.

17.7.1.5. При проведении торгов по акциям в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» сделки заключаются на основании адресных заявок РЕПО (акции), поданных Участниками торгов в ходе торгов текущего торгового дня в данном Режиме торгов. В адресных заявках РЕПО (акции) должны быть указаны реквизиты, предусмотренные в п.п. 17.5.5. п. 17.5. настоящего Раздела Правил.

17.7.1.6. Банк России не позднее, чем за 2 рабочих дня до даты проведения аукциона письменно извещает Биржу о дате проведения и условиях аукциона.

17.7.1.7. Биржа с учетом предложений Банка России определяет количество аукционов, проводимых в торговый день, в том числе по одной ценной бумаге, и

возможные параметры реквизитов заявок, в том числе:

- разрешенные типы торгово-клиринговых счетов;
- ценные бумаги, по которым могут приниматься заявки;
- срок, на который заключается сделка РЕПО;
- допустимые коды расчетов;
- начальное, минимальное предельное, максимальное предельное значение дисконта (по каждому выпуску) в зависимости от срока РЕПО;
- минимальная ставка РЕПО;
- максимально допустимый объем заявки, подаваемой Участником торгов КО по одной ставке РЕПО.

17.7.1.8. Ставка фиксированного возмещения в заявках в режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» не указывается.

17.7.1.9. В случае принятия Биржей решения об ограничении возможных значений начального и/или минимального предельного и/или максимального предельного значения дисконта, заявка, в которой указаны значения дисконта, не соответствующие установленным Биржей ограничениям, в Системе торгов не регистрируется.

17.7.1.10. По окончании периода сбора заявок Биржа передает Банку России Сводный реестр заявок (Аукцион РЕПО), подписанный Маклером, в котором указываются все заявки, поданные и не снятые Участниками торгов КО на момент окончания периода сбора заявок в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО».

17.7.1.11. Участники торгов в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» имеют доступ к информации об адресных заявках, адресованных данному Участнику торгов, и собственных адресных заявках, находящихся в Системе торгов.

17.7.1.12. Порядок удовлетворения заявок в режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», определяется Биржей с учетом предложений Банка России, полученных в соответствии с п.п. 17.7.1.6. п. 17.7. настоящего Раздела Правил. Неудовлетворенные на аукционе заявки снимаются по окончании периода удовлетворения заявок.

17.7.2. Заключение сделок РЕПО с Банком России осуществляется в режиме торгов «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» в следующем порядке:

17.7.2.1. Заключение сделок РЕПО с Банком России по фиксированной ставке РЕПО в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» осуществляется на основании адресных заявок, выставляемых Участниками торгов КО в адрес Банка России, удовлетворяющего их путем подачи встречных адресных заявок, в соответствии с требованиями п.п. 17.5.6. - 17.5.17. п. 17.5. и п.п. 17.6.6. - 17.6.19. п. 17.6. настоящего

Раздела Правил.

17.7.2.2. В торгах в данном режиме могут принимать участие Банк России и Участники торгов КО, выступающие от своего имени и за свой счет, с которыми Банком России заключены необходимые соглашения.

17.7.2.3. При проведении торгов по облигациям в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» заключение сделок осуществляется на основании адресных заявок РЕПО (облигации), поданных Участниками торгов в ходе торгов текущего торгового дня в данном Режиме торгов. В адресных заявках РЕПО (облигации) должны быть указаны реквизиты, предусмотренные п.п. 17.6.5. п. 17.6. настоящего Раздела Правил.

17.7.2.4. При проведении торгов по акциям в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» заключение сделок осуществляется на основании адресных заявок (акции), поданных Участниками торгов в ходе торгов текущего торгового дня в данном Режиме торгов. В адресных заявках РЕПО (акции) должны быть указаны реквизиты, предусмотренные п.п. 17.5.5. п. 17.5. настоящего Раздела Правил.

17.7.2.5. Банк России не позднее, чем за 2 рабочих дня до даты проведения торгов по фиксированной ставке РЕПО письменно извещает Биржу о дате проведения и условиях таких торгов.

17.7.2.6. Биржа с учетом предложений Банка России определяет возможные параметры реквизитов заявок, в том числе:

- разрешенные типы торгово-клиринговых счетов;
- ценные бумаги, по которым могут приниматься заявки;
- срок, на который заключается сделка РЕПО;
- допустимые коды расчетов;
- начальное, минимальное предельное, максимальное предельное значение дисконта (по каждому выпуску) в зависимости от срока РЕПО;
- ставка РЕПО;
- максимально допустимый объем заявки, подаваемой Участником торгов КО по одной ставке РЕПО.

17.7.2.7. Ставка фиксированного возмещения в заявках в режиме торгов «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» не указывается.

17.7.2.8. В случае принятия Биржей решения об ограничении возможных значений начального и/или минимального предельного и/или максимального предельного значения дисконта, заявка, в которой указаны значения дисконта, не соответствующие установленным Биржей ограничениям, в Системе торгов не регистрируется.

17.7.2.9. Участники торгов в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» имеют доступ к информации об адресных заявках, адресованных данному Участнику торгов, и собственных адресных заявках, находящихся в Системе торгов.

17.7.2.10. Порядок удовлетворения заявок в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», определяется уполномоченным органом Биржи с учетом предложений Банка России, полученных в соответствии с п.п. 17.7.2.5. настоящего Раздела Правил. Неудовлетворенные заявки снимаются по окончании торгов.

17.8. Заключение сделок РЕПО в Режиме торгов «Аукцион РЕПО» осуществляется в следующем порядке:

17.8.1. Заключение сделок РЕПО в Режиме торгов «Аукцион РЕПО» проводится в форме Аукциона на основании адресных заявок, выставляемых Участниками торгов в адрес Участника торгов, выступающего от своего имени и по поручению и за счет Эмитента, удовлетворяющего их путем подачи встречных адресных заявок, в соответствии с требованиями п.п. 17.5.6. - 17.5.17. п. 17.5. и п.п. 17.6.5. - 17.6.19. п. 17.6. настоящего Раздела Правил.

17.8.2. Аукцион состоит из периода сбора заявок и периода удовлетворения заявок. Во время периода сбора заявок Участники торгов имеют право подавать заявки и снимать ранее поданные заявки. По окончании периода сбора заявок Участник торгов не может снять поданную заявку.

17.8.3. При проведении торгов по облигациям в Режиме торгов «Аукцион РЕПО» принимают участие адресные заявки РЕПО (облигации), поданные Участниками торгов в ходе торгов текущего торгового дня в данном Режиме торгов. В адресных заявках РЕПО (облигации) должны быть указаны реквизиты, предусмотренные п.п. 17.6.5. настоящего Раздела Правил.

17.8.4. При проведении торгов по акциям в Режиме торгов «Аукцион РЕПО» принимают участие адресные заявки РЕПО (акции), поданные Участниками торгов в ходе торгов текущего торгового дня в данном Режиме торгов. В адресных заявках РЕПО (акции) должны быть указаны реквизиты, предусмотренные п.п. 17.5.5. настоящего Раздела Правил.

17.8.5. Не позднее, чем за 3 рабочих дня до даты проведения Аукциона РЕПО Эмитент или его уполномоченный представитель (далее – Эмитент) письменно извещает Биржу путем направления заявления об Участнике торгов, выступающем от своего имени и по поручению Эмитента с указанием даты и порядка проведения таких торгов и условиях Аукциона. На основании данного заявления и при наличии технической возможности по проведению таких торгов Биржа проводит Аукцион в Режиме торгов «Аукцион РЕПО».

17.8.6. Биржа с учетом предложений Эмитента определяет возможные параметры

реквизитов заявок, в том числе:

- разрешенные типы торгово-клиринговых счетов;
- ценные бумаги, по которым могут приниматься заявки;
- срок, на который заключается сделка РЕПО;
- допустимые коды расчетов;
- начальное, минимальное предельное, максимальное предельное значение дисконта (по каждому выпуску) в зависимости от срока РЕПО;
- минимальная ставка РЕПО;
- максимально допустимый объем заявки (количество ценных бумаг), подаваемой Участником торгов по одной ставке РЕПО;
- ставка фиксированного возмещения;
- а также иные параметры, указанные в заявлении.

17.8.7. В случае принятия Биржей решения об ограничении возможных значений начального и/или минимального предельного и/или максимального предельного значения дисконта, заявка, в которой указаны значения дисконта, не соответствующие установленным Биржей ограничениям, в Системе торгов не регистрируется.

17.8.8. По окончании периода сбора заявок Биржа передает Участнику торгов, выступающему от своего имени и по поручению Эмитента, Сводный реестр заявок (Аукцион РЕПО), подписанный Маклером, в котором указываются все заявки, поданные и не снятые Участниками торгов на момент окончания периода сбора заявок в Режиме торгов «Аукцион РЕПО».

17.8.9. Участники торгов в Режиме торгов «Аукцион РЕПО» имеют доступ к информации об адресных заявках, адресованных данному Участнику торгов, и собственных адресных заявках, находящихся в Системе торгов.

17.8.10. Порядок удовлетворения заявок в Режиме торгов «Аукцион РЕПО», определяется Биржей с учетом предложений Эмитента, полученных в соответствии с п.п. 17.8.5. п. 17.8 настоящего Раздела Правил. Неудовлетворенные на аукционе заявки снимаются по окончании периода удовлетворения заявок.

17.9. Определение обязательств по внесению компенсационных взносов по сделкам РЕПО в Режиме торгов «РЕПО с облигациями», «РЕПО с акциями», «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» осуществляется в следующем порядке:

17.9.1. Каждый торговый день при условии проведения торгов по ценной бумаге, по которой заключена данная сделка РЕПО, начиная с даты надлежащего исполнения первой части сделки РЕПО, условиями которой заданы максимальные и/или минимальные

предельные значения дисконта, до даты, следующей за датой фактического исполнения второй части этой сделки РЕПО, или за датой неисполнения этой сделки РЕПО, в Системе торгов рассчитывается текущее значение дисконта:

$$Dt = \left(1 - \frac{(S_j + I_j)}{C_j} \right) * 100\%, \text{ где}$$

Dt - текущее значение дисконта;

S_j - Сумма РЕПО на конец текущего (j -ого) дня;

I_j - доход по сделке РЕПО в j -ый день;

$C_j = N_j * (P_j + At_j)$, где

C_j - рыночная стоимость ценных бумаг по сделке РЕПО на конец текущего (j -го) дня;

N_j - Количество ценных бумаг по сделке РЕПО на конец текущего (j -ого) дня;

P_j - расчетная цена по ценной бумаге текущего торгового дня, порядок определения которой устанавливается распоряжением Генерального директора Биржи;

At_j - НКД по одной ценной бумаге на конец текущего (j -го) дня.

В случае, если расчетная цена не установлена, то расчет текущего значения дисконта не производится.

17.9.2. При превышении текущим значением дисконта величины максимального предельного значения дисконта у покупателя по первой части сделки РЕПО возникает обязательство по внесению в следующий расчетный день Компенсационного взноса в форме ценных бумаг (путем частичной предварительной поставки ценных бумаг по второй части сделки РЕПО). Если текущее значение дисконта становится меньше минимального предельного значения дисконта, у продавца по первой части сделки РЕПО возникает обязательство в следующий расчетный день по внесению Компенсационного взноса в денежной форме (путем частичной предварительной оплаты по второй части сделки РЕПО).

17.9.3. Размер Компенсационного взноса в денежной форме по сделке РЕПО, рассчитываемого по итогам текущего j -го дня $Md(j)$ рассчитывается по формуле:

$$Md(j) = (S_j + I_j) - C_j * \left(1 - \frac{Dn}{100\%} \right), \text{ где}$$

S_j - Сумма РЕПО на конец текущего (j -ого) дня;

I_j - доход по сделке РЕПО в j -ый день;

C_j - рыночная стоимость ценных бумаг по сделке РЕПО на конец текущего (j -го) дня;

Dn - начальное значение дисконта.

17.9.4. Размер Компенсационного взноса в форме ценных бумаг по сделке РЕПО, рассчитываемого по итогам текущего j -го дня $Mo(j)$ рассчитывается по формуле:

$$Mo(j) = N_j - \text{int} \left\{ \frac{S_j + I_j}{\left(1 - \frac{Dn}{100\%}\right) * (P_j + At_j)} \right\}, \text{ где}$$

N_j - Количество ценных бумаг по сделке РЕПО на конец текущего (j -ого) дня;

S_j - Сумма РЕПО на конец текущего (j -ого) дня;

I_j - доход по сделке РЕПО в j -ый день;

Dn - начальное значение дисконта;

At_j - НКД по одной ценной бумаге на конец текущего (j -го) дня;

P_j - расчетная цена по ценной бумаге текущего торгового дня, порядок определения которой устанавливается распоряжением Генерального директора Биржи;

$\text{int}\{X\}$ - функция выделения целой части значения X .

17.9.5. Порядок внесения Компенсационных взносов определяется в соответствии с Правилами клиринга. Частичное внесение компенсационных взносов не допускается.

17.9.6. В случае, если в надлежащую дату Биржей была получена от Клиринговой организации информация об отказе Участника торгов от компенсационного взноса, то Участник торгов - контрагент по сделке освобождаются от уплаты компенсационного взноса. В случае, если в надлежащую дату компенсационный взнос не был внесен, и Биржей не получена от Клиринговой организации информация об отказе от компенсационного взноса, то обязательство по уплате компенсационного взноса считается неисполненным и срок его исполнения не подлежит пролонгации. В этом случае надлежащей датой исполнения второй части соответствующей сделки РЕПО в соответствии с настоящими Правилами является первый расчетный день, следующий за датой невнесения компенсационного взноса. Вторая часть соответствующей сделки РЕПО должна быть исполнена обеими ее сторонами досрочно (до даты надлежащего исполнения второй части сделки РЕПО, определенной при ее заключении), а именно, в первый расчетный день, следующий за датой невнесения компенсационного взноса (исходя из рассчитанных в Системе торгов на соответствующую дату параметров сделки РЕПО).

17.10. Устанавливается следующий порядок уплаты фиксированного и переменного возмещения по сделкам РЕПО:

17.10.1. При неисполнении Участником торгов обязательства по поставке ценных бумаг по второй части сделки РЕПО, данный Участник торгов:

- обязан уплатить в порядке, установленном в Правилах клиринга, Участнику торгов - контрагенту по сделке РЕПО переменное возмещение в размере суммы денежных средств, определяемой как произведение количества ценных бумаг в данной сделке РЕПО (текущее обязательство по второй части сделки РЕПО покупателя перед продавцом по первой части сделки РЕПО) и положительной разницы между максимальной ценой возмещения по соответствующей ценной бумаге (рассчитанной в надлежащую дату исполнения второй части сделки РЕПО или в следующий расчетный день после надлежащей даты её исполнения) и ценой второй части сделки РЕПО;

- не имеет обязательств по уплате Участнику торгов - контрагенту по сделке РЕПО переменного возмещения (если максимальная цена возмещения по ценной бумаге, являющейся предметом данной сделки РЕПО, рассчитанная в надлежащую дату исполнения второй части сделки РЕПО или в следующий расчетный день после надлежащей даты её исполнения, ниже или равна цене второй части сделки РЕПО).

17.10.2. При неисполнении Участником торгов обязательства по уплате денежных средств по второй части сделки РЕПО данный Участник торгов:

- обязан уплатить в порядке, установленном в Правилах клиринга, Участнику торгов - контрагенту по сделке РЕПО переменное возмещение в размере суммы денежных средств, определяемой как произведение количества ценных бумаг в данной сделке РЕПО (текущее обязательство по второй части сделки РЕПО покупателя перед продавцом по первой части сделки РЕПО) и положительной разницы между ценой второй части сделки РЕПО и минимальной ценой возмещения по соответствующей ценной бумаге (рассчитанной в надлежащую дату исполнения второй части сделки РЕПО или в следующий расчетный день после надлежащей даты её исполнения);

- не имеет обязательств по уплате Участнику торгов - контрагенту по сделке РЕПО переменного возмещения (если минимальная цена возмещения по ценной бумаге, являющейся предметом данной сделки РЕПО, рассчитанная в надлежащую дату исполнения второй части сделки РЕПО или в следующий расчетный день после надлежащей даты её исполнения, выше или равна цене второй части сделки РЕПО).

17.10.3. При неисполнении Участником торгов обязательств (по уплате денежных средств или по поставке ценных бумаг) по первой или второй части сделки РЕПО, данный Участник торгов обязан уплатить Участнику торгов - контрагенту по сделке РЕПО фиксированное возмещение в порядке, установленном в настоящих Правилах и Правилах клиринга. При этом, фиксированное возмещение рассчитывается как произведение ставки фиксированного возмещения, указанной контрагентами в адресных заявках, на основании которых была заключена данная сделка РЕПО, на сумму РЕПО текущего торгового дня.

17.10.4. Переменное и фиксированное возмещение по сделкам РЕПО, заключенным на Бирже за иностранную валюту, удерживается в российских рублях по

курсу Банка России на дату неисполнения соответствующих сделок в порядке, установленном в Правилах клиринга.

17.10.5. Участник торгов имеет право отказаться от получения переменного и фиксированного возмещения по сделке РЕПО, обеспечив поступление на Биржу письменного уведомления по форме, предусмотренной в Приложении № 6 к настоящим Правилам, до даты уплаты переменного и фиксированного возмещения в соответствии с Правилами клиринга.

17.10.6. В случае если оба Участника торгов - контрагента по сделке РЕПО не исполнили свои обязательства по данной сделке, то они не имеют взаимных обязательств по уплате фиксированного и переменного возмещения друг другу по данной сделке.

18. Торги по акциям и облигациям, допущенным к размещению

18.1. При проведении торгов по ценным бумагам, допущенным к размещению, Участники торгов, за исключением Участника торгов, являющегося Участником торгов, выполняющим функции продавца ценных бумаг при торгах по ценным бумагам, допущенным к размещению (далее – Продавец), не имеют права подавать заявки на продажу этих ценных бумаг.

18.2. Торги по ценным бумагам, допущенным к размещению, могут проводиться в следующих формах: в форме Аукциона (в Режиме торгов «Размещение: Аукцион») или в форме Конкурса (в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки»), и/или путем заключения сделок на основании адресных заявок по фиксированной цене (доходности), выставляемых Участниками торгов в адрес Продавца, удовлетворяющего их путем подачи встречной адресной заявки (в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки») в сроки и в порядке, определяемые Разделом 19 «Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» и «Размещение: Адресные заявки»» настоящих Правил. Формы проведения торгов по ценным бумагам, допущенным к размещению, определяются Генеральным директором Биржи. Генеральным директором и/или Дирекцией Биржи может быть также определен иной срок или порядок на основании эмиссионных документов и иных документов, регламентирующих порядок проведения размещения выпуска ценных бумаг.

19. Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» и «Размещение: Адресные заявки»

19.1. При необходимости проведения торгов по ценным бумагам, допущенным к

обращению на Бирже, в форме Аукциона или Конкурса не позднее, чем за десять рабочих дней до даты проведения Аукциона или Конкурса, Заявитель письменно извещает Биржу об Участнике торгов, выполняющем функции продавца ценных бумаг при торгах в форме Аукциона или Конкурса (далее – Продавец) с указанием порядка проведения торгов по ценным бумагам, соответствующего одной из форм, предусмотренных в настоящем разделе Правил торгов.

19.2. При необходимости проведения торгов в Режиме "Размещение: Аукцион" по ценным бумагам, допущенным к обращению на Бирже и оставшимся у Банка России в связи с отказом контрагента от исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО, заключенной в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» или в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», Банк России, являющийся Продавцом, не позднее, чем за один рабочий день до даты проведения торгов, письменно извещает Биржу о дате и условиях их проведения. Решением Генерального директора Биржи такая ценная бумага допускается к торгам в Режиме торгов «Размещение: Аукцион». Подача заявок и заключение сделок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» осуществляется в форме аукциона в соответствии с положениями п.п. 19.3.1. - 19.3.4., п.п. 19.3.7.-19.3.10. пункта 19.3. настоящего раздела Правил.

19.3. Торги, проводимые в Режиме торгов “Размещение: Аукцион” в форме Аукциона, осуществляются в следующем порядке:

19.3.1. Режим торгов «Размещение: Аукцион» состоит из периода сбора заявок и периода удовлетворения заявок.

19.3.2. Условия подачи, снятия и удовлетворения заявок на покупку ценных бумаг в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» определяются в Разделах 6, 7 настоящих Правил. По окончании периода сбора заявок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» Участник торгов не может снять поданную заявку в данном режиме торгов.

19.3.3. Во время периода сбора заявок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» подаются лимитные заявки с сохранением в котировках.

Решением Генерального директора Биржи может быть предусмотрена возможность подачи в Систему торгов во время периода сбора заявок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» рыночных заявок с указанием объема денежных средств, предназначенных для покупки ценных бумаг.

19.3.4. Заявки на покупку, подаваемые в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» содержат реквизиты, указанные в п.п. 6.10.1., 6.10.4. пункта 6.10. Раздела 6 «Заявки» настоящих Правил.

19.3.5. Решением Генерального директора Биржи может быть предусмотрена возможность подачи Участником торгов в Систему торгов лимитной или рыночной заявки, в которой наряду с реквизитами, предусмотренными п.п. 6.10.1 и 6.10.4. пункта

6.10. Раздела 6 «Заявки» настоящих Правил, также может быть указана дата активации заявки в формате «ДДММГГГГ». При наступлении времени, определенного решением Генерального директора Биржи, в указанную дату осуществляется проверка обеспечения такой заявки в соответствии с Правилами клиринга, по итогам которой возможна регистрация сделки/сделок на основании данной заявки. Решением Генерального директора Биржи может быть предусмотрена единая дата активации для всех заявок определенной направленности по данной ценной бумаге или возможность указания самим Участником торгов даты активации.

Заявка, в которой указана дата активации, в соответствии с настоящими Правилами может быть отменена или изменена Участником торгов до наступления времени активации, определенного решением Генерального директора Биржи.

19.3.6. Решением Генерального директора Биржи может быть предусмотрена возможность подачи Участником торгов – продавцом в Систему торгов лимитной заявки, в которой наряду с реквизитами, предусмотренными п. 6.10.1. пункта 6.10. Раздела 6 «Заявки» настоящих Правил, также может быть указано время в течение текущего дня в формате «ЧЧ:ММ:СС», с которого возможно заключение сделок на основании данной заявки (далее - время активации заявки).

При этом, если Участником торгов – продавцом при подаче заявки не указано время ее активации или указанное время уже наступило, то считается, что в такой заявке в качестве времени активации установлено текущее время.

При регистрации в Системе торгов заявки, в которой указано время активации, такая заявка проходит проверку обеспечения в порядке, установленном Правилами клиринга в момент подачи заявки.

Информация об условиях заявок, в которых указано время активации, становится доступна Участникам торгов с момента их регистрации в Системе торгов наряду с информацией по иным заявкам на заключение сделок.

Лимитная заявка, в которой указано время активации, в соответствии с настоящими Правилами не может быть отменена Участником торгов - продавцом и/или удовлетворена до наступления времени активации. После наступления времени активации заявка, в которой указано время активации, может быть отменена Участником (в том числе в части остатка) и/или удовлетворена в соответствии с п.п. 19.3.10. настоящего пункта Правил.

19.3.7. Участники торгов во время периода сбора заявок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» имеют доступ к информации обо всех заявках, поданных в данном режиме торгов от имени данного Участника торгов, если иное не установлено решением Генерального директора Биржи.

19.3.8. По окончании периода сбора заявок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» Биржа передает Продавцу Сводный реестр заявок на покупку ценных бумаг,

подписанный Маклером, в котором указываются все заявки, поданные и не снятые Участниками торгов на момент окончания периода сбора заявок в режиме торгов «Размещение: Аукцион».

19.3.9. Во время периода удовлетворения заявок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» Продавец подает в Систему торгов заявку на продажу ценных бумаг, которая является лимитной заявкой без сохранения в котировках. В данной заявке должны быть указаны:

- идентификатор Продавца;
- наименование ценной бумаги;
- торгово-клиринговый счет;
- направленность заявки (продажа);
- цена за одну ценную бумагу;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- код расчетов (всегда T0);
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг));
- идентификатор трейдера (АСП трейдера).

19.3.10. Порядок удовлетворения заявок на покупку ценных бумаг в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» определяется Решением о выпуске и/или иными документами, регламентирующими порядок проведения размещения и обращения ценной бумаги.

19.4. Торги, проводимые в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» в форме Конкурса, осуществляются в следующем порядке:

19.4.1. Заключение сделок в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» может проводиться в форме Конкурса на основании адресных заявок, выставяемых Участниками торгов в адрес Продавца, удовлетворяющего их путем подачи встречных адресных заявок. Конкурс состоит из периода сбора заявок и периода удовлетворения заявок на Конкурсе. Во время периода сбора заявок на Конкурсе Участники торгов имеют право подавать заявки на покупку ценных бумаг на Конкурсе и снимать ранее поданные заявки на покупку ценных бумаг на Конкурсе. По окончании периода сбора заявок на Конкурсе Участник торгов не может снять поданную заявку на покупку ценных бумаг.

19.4.2. При проведении Конкурса в Системе торгов принимаются безадресные и адресные заявки. Если иное не определено решением Генерального директора в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» только Продавец имеет право подавать как

адресные, так и безадресные заявки. Участник торгов, не являющийся Продавцом, имеет право подавать только адресные заявки на покупку ценных бумаг.

В адресной заявке при проведении Конкурса в дополнение к реквизитам адресной заявки Режим торгов «Размещение: Адресные заявки», указанным в п.п. 19.5.2. и 19.5.3. настоящего Раздела Правил торгов, должен быть заполнен дополнительный реквизит – «ссылка». Реквизит «ссылка» используется для указания величины приемлемой для Участников торгов процентной ставки по определяемой в ходе конкурса ставки по купону (Под термином "величина приемлемой процентной ставки" понимается величина процентной ставки по купону, при объявлении которой эмитентом потенциальный инвестор был бы готов купить количество ценных бумаг, указанных в заявке по цене, объявленной в заявке).

19.4.3. По окончании периода сбора заявок на Конкурсе Биржа передает Продавцу (эмитенту) Сводный реестр заявок на Конкурсе, подписанный Маклером, в котором указываются все заявки на покупку ценных бумаг на Конкурсе, поданные и не снятые Участниками торгов на момент окончания периода сбора заявок на Конкурсе в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки». Участники торгов в режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» имеют доступ к информации об адресных заявках, адресованных данному Участнику торгов, собственных адресных заявках, а также обо всех безадресных заявках, находящихся в Системе торгов.

19.4.4. Порядок удовлетворения заявок на покупку ценных бумаг на Конкурсе в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки», в которых величина процентной ставки меньше либо равна величине установленной процентной ставки по купону, определяется Решением о выпуске и/или иными документами эмитента, регламентирующими порядок проведения размещения и обращения ценной бумаги.

В ходе торгов по ценным бумагам, допущенным к размещению путем проведения Конкурса в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки», решением Генерального директора Биржи может быть предусмотрена возможность заключения сделки в Системе торгов при совпадении в двух встречных адресных заявках всех условий, перечисленных в настоящем пункте Правил, за исключением количества ценных бумаг, выраженного в лотах.

19.5. Заключение сделок с ценными бумагами в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» по фиксированной цене (доходности) осуществляется на основании адресных заявок, выставляемых Участниками торгов в адрес Продавца, удовлетворяющего их путем подачи встречных адресных заявок.

19.5.1. Если иное не определено решением Генерального директора в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» только Продавец имеет право подавать как адресные, так и безадресные заявки. Участник торгов, не являющийся Продавцом, имеет право подавать только адресные заявки на покупку ценных бумаг.

19.5.2. В Режиме торгов “Размещение: Адресные заявки” в Системе торгов принимаются безадресные и адресные заявки.

В безадресной заявке в Режиме торгов “Размещение: Адресные заявки” должны быть указаны следующие реквизиты:

- вид заявки (безадресная заявка);
- краткое наименование Продавца, подавшего заявку;
- направленность заявки (заявка на продажу);
- наименование ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- цена за одну ценную бумагу;
- код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п.п. 1.1.14. Раздела 1 «Термины и определения» настоящих Правил);
- идентификатор трейдера (АСП трейдера).

В адресной заявке на покупку ценных бумаг в Режиме торгов “Размещение: Адресные заявки” должны быть указаны следующие реквизиты:

- вид заявки (адресная заявка);
- краткое наименование Участника торгов, подавшего заявку;
- код Участника торгов, подавшего заявку (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении);
- краткое наименование или идентификатор Участника торгов, которому адресована заявка;
- направленность заявки (заявка на покупку);
- наименование ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- цена за одну ценную бумагу (или «по цене контрагента»);
- торгово-клиринговый счет;
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг));
- код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п.п. 1.1.14. Раздела 1 «Термины и определения»

настоящих Правил);

- идентификатор трейдера (АСП трейдера).

Поле «ссылка» не является обязательным реквизитом, т.е. не обязательно для заполнения. В случае заполнения данного поля, в нем может быть указана любая последовательность букв, цифр или знаков.

Биржей могут быть установлены предельные значения объема заявки для адресной заявки.

19.5.3. Решением Генерального директора Биржи в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» может быть предусмотрена возможность подачи Участником торгов в Систему торгов адресной заявки, в которой наряду с реквизитами, предусмотренными п.п. 19.5.2. настоящего Раздела Правил, также может быть указана дата активации заявки в формате «ДДММГГГГ». При наступлении времени, определенного решением Генерального директора Биржи, в указанную дату осуществляется проверка обеспечения такой заявки в соответствии с Правилами клиринга, по итогам которой возможна регистрация сделок на основании таких заявок. Решением Генерального директора Биржи может быть предусмотрена единая дата активации для всех заявок определенной направленности по данной ценной бумаге или возможность указания самим Участником торгов даты активации.

Заявка, в которой указана дата активации, в соответствии с настоящими Правилами может быть отменена или изменена Участником торгов до наступления времени активации, определенного решением Генерального директора Биржи.

19.5.4. При получении в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» встречной адресной заявки к своей безадресной заявке с совпадающими условиями или при получении адресной заявки на покупку ценных бумаг Продавец вправе либо заключить сделку на условиях, указанных в адресной заявке, направив контрагенту адресную заявку, либо отклонить полученную заявку, либо направить контрагенту адресную заявку с новыми условиями, в которой должны быть указаны следующие реквизиты:

- вид заявки (адресная заявка);
- краткое наименование Участника торгов, подавшего заявку;
- краткое наименование или идентификатор Участника торгов, которому адресована заявка;
- направленность заявки (заявка на продажу);
- наименование ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- цена за одну ценную бумагу;

- торгово-клиринговый счет;
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг));
- код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п.п. 1.1.14. Раздела 1 «Термины и определения» настоящих Правил);
- идентификатор трейдера (АСП трейдера).

При получении адресной заявки в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» с заполненным полем «ссылка» для заключения сделки необходимо направить контрагенту встречную адресную заявку, в которой поле «ссылка» содержит информацию, точно соответствующую информации, содержащейся в поле «ссылка» полученной адресной заявки.

19.5.5. Заключение сделок в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» происходит автоматически при совпадении следующих условий, указанных в двух встречных адресных заявках:

- вид заявки;
- наименование ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- цена за одну ценную бумагу;
- код расчетов;
- ссылка.

Под встречными адресными заявками понимаются заявки противоположной направленности, адресованные Участниками торгов друг другу.

Решением Генерального директора Биржи может быть предусмотрена возможность заключения сделки в Системе торгов при совпадении в двух встречных адресных заявках всех условий, перечисленных в настоящем пункте Правил, за исключением количества ценных бумаг, выраженного в лотах.

19.5.6. Участники торгов во время проведения торгов ценной бумагой по фиксированной цене (доходности) в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» имеют доступ к информации о собственных адресных заявках, а также обо всех безадресных заявках, находящихся в Системе торгов.

19.6. Сроки и время проведения торгов в режиме торгов «Размещение: Аукцион» или в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» по ценной бумаге определенного эмитента устанавливается решением Дирекции Биржи или в случаях проведения конкурса

и/или аукциона - решением Генерального директора Биржи и/или иного уполномоченного лица в случаях, установленных Генеральным директором Биржи, на основании Решения о выпуске и/или иных документов эмитента, регламентирующих порядок проведения размещения и обращения ценной бумаги.

19.7. По окончании периода удовлетворения заявок в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» все неудовлетворенные заявки на покупку ценных бумаг снимаются из Системы торгов Продавцом. В соответствии с решением Генерального директора Биржи и/или на основании распоряжения уполномоченного лица эмитента Маклер снимает заявки, не подлежащие удовлетворению в режиме торгов «Размещение: Аукцион» в соответствии с Решением о выпуске и/или иными документами эмитента, регламентирующих порядок проведения размещения и обращения выпуска ценных бумаг.

19.8. По решению Генерального директора Биржи могут быть установлены дополнительные условия проведения торгов в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» или в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» в соответствии с документами, регламентирующими условия проведения размещения и обращения ценной бумаги.

20. Проведение торгов по приобретению акций и выкупу облигаций

Выкуп облигаций

20.1. Решением о выпуске и/или иными документами эмитента, регламентирующими условия выпуска облигаций, могут быть определены возможность и порядок досрочного погашения эмитентом облигаций, а также возможность и порядок приобретения облигаций эмитентом по соглашению с владельцем (владельцами) облигаций с возможностью их дальнейшего обращения до истечения срока погашения (далее – выкуп облигаций).

20.2. Выкуп облигаций на Бирже может проводиться во всех режимах торгов, предусмотренных в п. 2.5. Раздела 2 «Общие положения» настоящих Правил, за исключением следующих Режимов торгов: «Размещение: Аукцион», «Размещение: Адресные заявки», а также путем заключения сделок РЕПО, если иное не определено решением Генерального директора Биржи. Порядок заключения сделок при проведении торгов по выкупу облигаций в Режиме основных торгов, в Режиме торгов «Неполные лоты» и в РПС определяется в соответствующих Разделах Правил. Торги по выкупу облигаций в Режиме торгов «Выкуп: Аукцион» и «Выкуп: Адресные заявки» осуществляется в порядке, предусмотренном в настоящем Разделе Правил, если иное не определено решением Генерального директора Биржи.

20.3. При проведении торгов по выкупу облигаций в Режиме торгов «Выкуп: Аукцион» и/или в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» эмитент не позднее, чем за

десять рабочих дней до даты выкупа облигаций, письменно извещает Биржу об Участнике торгов, выполняющем функции покупателя облигаций, подлежащих выкупу, а также об особенностях проведения выкупа облигаций, с приложением документа, определяющего порядок и условия выкупа облигаций. Сроки, форма и порядок проведения торгов по выкупу облигаций на Бирже определяются решением Генерального директора Биржи. Биржа в сроки, установленные решением Генерального директора Биржи (при проведении Аукциона) или в иных случаях Дирекцией Биржи, сообщает Участникам торгов наименование Участника торгов, выполняющего функции покупателя облигаций, подлежащих выкупу, а также об особенностях и времени проведения операций по выкупу облигаций на Бирже.

20.4. При проведении торгов по выкупу облигаций Участники торгов, за исключением Участника торгов, выполняющего функции покупателя облигаций, подлежащих выкупу, в соответствии с п. 20.1. настоящего Раздела (далее – Покупатель), не имеют права подавать заявки на покупку этих облигаций.

20.5. В течение всего срока проведения торгов по выкупу облигаций только Покупатель имеет право подавать как адресные, так и безадресные заявки. Участник торгов, не являющийся Покупателем, имеет право подавать только адресные заявки на продажу облигаций.

20.6. Торги по выкупу облигаций в форме Аукциона проводятся в Режиме торгов «Выкуп: Аукцион». В ходе Аукциона определяется цена выкупа. Аукцион состоит из периода сбора заявок и периода удовлетворения заявок.

20.6.1. Условия подачи, снятия и удовлетворения заявок на продажу облигаций на Аукционе в Режиме торгов «Выкуп: Аукцион» осуществляются в соответствии с Разделами 6, 7 настоящих Правил. По окончании периода сбора заявок Участник торгов не может снять поданную заявку на Аукционе.

20.6.2. Во время периода сбора заявок в Режиме торгов «Выкуп: Аукцион» подаются лимитные заявки с сохранением в котировках.

Решением Генерального директора Биржи может быть предусмотрена возможность подачи в Систему торгов во время периода сбора заявок в Режиме торгов «Выкуп: Аукцион» рыночных заявок с указанием объема денежных средств, предназначенных для покупки облигаций.

20.6.3. Заявки на продажу, подаваемые в Режиме торгов «Выкуп: Аукцион» содержат реквизиты, указанные в п.п. 6.10.1. и 6.10.4. п. 6.10. Раздела 6 «Заявки».

20.6.4. Решением Генерального директора Биржи может быть предусмотрена возможность подачи Участником торгов в Систему торгов лимитной или рыночной заявки, в которой наряду с реквизитами, предусмотренными п.п. 6.10.1. и 6.10.4. п. 6.10. Раздела 6 «Заявки», также может быть указана дата активации заявки в формате

«ДДММГТТТГ». При наступлении времени, определенного решением Генерального директора Биржи, в указанную дату осуществляется проверка обеспечения такой заявки в соответствии с Правилами клиринга, по итогам которой возможна регистрация сделок на основании данной заявки. Решением Генерального директора Биржи может быть предусмотрена единая дата активации для всех заявок определенной направленности по данным облигациям или возможность указания самим Участником торгов даты активации.

Заявка, в которой указана дата активации, в соответствии с настоящими Правилами может быть отменена или изменена Участником торгов до наступления времени активации, определенного решением Генерального директора Биржи.

20.6.5. Участники торгов во время периода сбора заявок имеют доступ к информации обо всех заявках, поданных от имени данного Участника торгов, если иное не установлено решением Генерального директора Биржи.

20.6.6. По окончании периода сбора заявок Биржа передает Покупателю Сводный реестр заявок на Аукционе, подписанный Маклером, в котором указываются все заявки, поданные и не снятые Участниками торгов на момент окончания периода сбора заявок на Аукционе в Режиме торгов «Выкуп: Аукцион».

20.6.7. Во время периода удовлетворения заявок Покупатель подает в Систему торгов заявку на покупку облигаций, которая является лимитной заявкой без сохранения в котировках. В данной заявке в Режиме торгов «Выкуп: Аукцион» должны быть указаны:

- идентификатор Покупателя;
- наименование ценной бумаги;
- торгово-клиринговый счет;
- направленность заявки (покупка);
- цена за одну ценную бумагу;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- код расчетов (всегда Т0);
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг));
- идентификатор трейдера (АСП трейдера).

20.6.8. Порядок удовлетворения заявок на Аукционе определяется Решением о выпуске и/или иными документами, регламентирующими порядок проведения выкупа облигаций.

20.7. В Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» в Системе торгов принимаются

безадресные и адресные заявки.

В безадресной заявке в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» должны быть указаны следующие реквизиты:

- вид заявки (безадресная заявка);
- краткое наименование Покупателя, подавшего заявку;
- направленность заявки (заявка на покупку);
- наименование ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- цена за одну ценную бумагу;
- код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п.п. 1.1.14. Раздела 1 «Термины и определения» настоящих Правил);
- идентификатор трейдера (АСП трейдера).

В адресной заявке в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» должны быть указаны следующие реквизиты:

- вид заявки (адресная заявка);
- краткое наименование Участника торгов, подавшего заявку;
- код Участника торгов, подавшего заявку (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении);
- краткое наименование Участника торгов, которому адресована заявка;
- направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу);
- наименование ценой бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- цена за одну ценную бумагу (или «по цене контрагента»);
- торгово-клиринговый счет;
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг));
- код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п.п. 1.1.14. Раздела 1 «Термины и определения» настоящих Правил);
- идентификатор трейдера (АСП трейдера).

Поле «ссылка» не является обязательным реквизитом, т.е. не обязательно для заполнения. В случае заполнения данного поля, в нем может быть указана любая последовательность букв, цифр или знаков.

Биржей могут быть установлены предельные значения объема заявки для адресной заявки.

20.8. Решением Генерального директора Биржи может быть предусмотрена возможность подачи Участником торгов в Систему торгов адресной заявки, в которой наряду с реквизитами, предусмотренными в п. 20.7. настоящего Раздела Правил, также может быть указана дата активации заявки в формате «ДДММГГГГ». При наступлении времени, определенного решением Генерального директора Биржи, в указанную дату осуществляется проверка обеспечения такой заявки в соответствии с Правилами клиринга, по итогам которой возможна регистрация сделок на основании таких заявок. Решением Генерального Биржи может быть предусмотрена единая дата активации для всех заявок определенной направленности по данной облигации или возможность указания самим Участником торгов даты активации.

Заявка, в которой указана дата активации, в соответствии с настоящими Правилами может быть отменена или изменена Участником торгов до наступления времени активации, определенного решением Генерального директора Биржи.

20.9. В Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» при получении встречной адресной заявки к своей безадресной заявке с совпадающими условиями или при получении адресной заявки на продажу облигаций Покупатель вправе до окончания торгов либо заключить сделку на условиях, указанных в адресной заявке, либо направить контрагенту адресную заявку с новыми условиями, либо отклонить полученную заявку. При получении адресной заявки в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» с заполненным полем «ссылка» для заключения сделки необходимо направить контрагенту встречную адресную заявку, в которой поле «ссылка» содержит информацию, точно соответствующую информации, содержащейся в поле «ссылка» полученной адресной заявки.

20.10. Заключение сделок в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» происходит автоматически при совпадении следующих условий, указанных в двух встречных адресных заявках:

- вид заявки;
- наименование ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- цена за одну ценную бумагу;
- ссылка;

- код расчетов.

Под встречными адресными заявками понимаются заявки противоположной направленности, адресованные Участниками торгов друг другу.

Решением Генерального директора Биржи может быть предусмотрена возможность заключения сделки в Системе торгов при совпадении в двух встречных адресных заявках всех условий, перечисленных в настоящем пункте Правил, за исключением количества ценных бумаг, выраженного в лотах.

20.11. Участники торгов во время проведения торгов в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» имеют доступ к информации о собственных адресных заявках, а также обо всех безадресных заявках режима торгов «Выкуп: Адресные заявки», находящихся в Системе торгов.

20.12. В соответствии с решением Генерального директора Биржи и/или на основании распоряжения уполномоченного лица эмитента Маклер может снять заявки, не подлежащие удовлетворению в соответствии с Решением о выпуске и/или иными документами, регламентирующими порядок проведения обращения выпуска облигаций.

Приобретение акций

20.13. Уставом эмитента и иными документами эмитента могут быть определены возможность и порядок приобретения размещенных акций эмитентом (далее – приобретение акций).

20.14. Заключение сделок по приобретению акций на Бирже осуществляется в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» в порядке, предусмотренном п.п. 20.7. - 20.12. настоящего Раздела Правил с учетом особенностей, предусмотренных п.п. 20.15. - 20.19. настоящего Раздела Правил, в течение срока приобретения, составляющего не менее 30 дней с даты определения цены приобретения.

20.15. Эмитент предоставляет на Биржу следующие документы:

20.15.1. Нотариально удостоверенную копию устава (со всеми изменениями и дополнениями), в которой предусмотрено право приобретать размещенные акции;

20.15.2. Протокол уполномоченного органа эмитента, содержащий решение о приобретении размещенных акций, либо его нотариально удостоверенную копию, либо выписку из указанного документа, подписанную уполномоченным лицом и скрепленную печатью эмитента;

20.15.3. Заявление, соответствующее требованиям, предусмотренным в п. 20.16 настоящего Раздела Правил;

20.15.4. Протокол уполномоченного органа эмитента, содержащий решение о цене приобретения, либо его нотариально удостоверенную копию, либо выписку из указанного документа, подписанную уполномоченным лицом и скрепленную печатью эмитента;

20.15.5. Документ, подтверждающий согласование с федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным Правительством Российской Федерации, цены приобретения (в случаях, предусмотренных в нормативных правовых актах Российской Федерации);

20.15.6. Документы, подтверждающие выполнение эмитентом требований по уведомлению акционеров о принятии решения о приобретении акций.

20.16. В Заявлении должны быть указаны:

- категории (типы) приобретаемых акций;
- количество приобретаемых обществом акций каждой категории (типа);
- цена приобретения акций, исходя из их рыночной стоимости;
- форма (денежная) и срок оплаты;
- срок, в течение которого осуществляется приобретение акций;
- Участник торгов - покупатель приобретаемых акций;
- подтверждение соблюдения эмитентом требований, предусмотренных в нормативных правовых актах Российской Федерации, в том числе к размеру уставного капитала, количеству акций в обращении, требований по уведомлению акционеров о принятии решения о приобретении акций, пропорциональности удовлетворения полученных заявок (в случае превышения общего количества акций, в отношении которых поступили заявки на продажу, над количеством акций, приобретаемых эмитентом);

и иные сведения, подтверждающие выполнение эмитентом требований, установленных в нормативных правовых актах Российской Федерации.

20.17. Не позднее, чем за десять рабочих дней до даты приобретения акций, эмитент предоставляет на биржу Заявление, предусмотренное п. 20.16. настоящего Раздела Правил.

20.18. Биржа в сроки, установленные решением Генерального директора Биржи, сообщает Участникам торгов наименование Покупателя, а также об особенностях проведения таких операций на Бирже.

20.19. При проведении торгов по приобретению акций в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» Участники торгов, за исключением Покупателя, не имеют права подавать заявки на покупку этих ценных бумаг. В течение всего срока проведения

приобретения акций только Покупатель имеет право подавать как адресные, так и безадресные заявки в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки». Участник торгов, не являющийся Покупателем, имеет право подавать только адресные заявки на продажу ценных бумаг.

20.20. При подаче заявки на продажу Участниками торгов используется указание на согласие продать по цене, определенной Эмитентом, или указывается цена приобретения акций, определенная решением уполномоченного органа эмитента.

21. Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Облигации Д - Режим основных торгов» и «Облигации Д - РПС»

21.1. При возникновении ситуации дефолта по выпуску облигаций, как он определен в Правилах листинга, Генеральный директор Биржи может принять решение об ограничении перечня доступных Режимов торгов для данного выпуска облигаций или всех выпусков облигаций соответствующего эмитента следующими Режимами торгов:

- Режим торгов «Облигации Д - Режим основных торгов» и/или
- Режим торгов «Облигации Д - РПС».

21.2. Заключение сделок в Режиме торгов «Облигации Д - Режим основных торгов» осуществляется в следующем порядке:

21.2.1. Для участия в торгах в Режиме торгов «Облигации Д - Режим основных торгов» принимаются лимитные заявки и рыночные заявки, поданные Участниками торгов в Систему торгов.

21.2.2. Заключение сделки по лимитной заявке осуществляется при пересечении ее ценовых условий с ценовыми условиями заявок противоположной направленности, зарегистрированными в Системе торгов. Пересечение ценовых условий имеет место:

- для поданной заявки на покупку - при наличии заявок на продажу с ценами, не превышающими цены, которая указана в поданной заявке;
- для поданной заявки на продажу - при наличии заявок на покупку с ценами, не меньшими, чем цена, которая указана в поданной заявке.

21.2.3. Заключение сделки по рыночной заявке осуществляется только при наличии заявок противоположной направленности.

21.2.4. Лимитные заявки и рыночные заявки удовлетворяются в соответствии со следующими правилами:

- сделка заключается по цене заявки, находящейся в очереди первой;
- размер заявки не влияет на ее приоритет.

21.2.5. Если лимитная заявка с сохранением в котировках удовлетворяется не полностью, то она (в размере неисполненной части) ставится в очередь по цене, указанной в заявке.

21.2.6. При постановке заявки в очередь ее место в очереди определяется ценой, указанной в заявке (первыми в очереди заявок на покупку находятся заявки с большими ценами; первыми в очереди заявок на продажу находятся заявки с меньшими ценами). Среди заявок с равными ценами первыми в очереди находятся заявки, поданные ранее.

21.2.7. Если лимитная заявка без сохранения в котировках или рыночная заявка удовлетворяется не полностью, то ее неисполненная часть снимается с торгов.

21.2.8. Участники торгов имеют доступ к информации о собственных заявках и заявках с двадцатью лучшими ценами (десять заявок на покупку и десять заявок на продажу), находящихся в очереди в Системе торгов (если решением Генерального директора Биржи не предусмотрено иное).

21.2.9. Заявки, не удовлетворенные в ходе торгов в Режиме торгов «Облигации Д - Режим основных торгов, снимаются с торгов по окончании торгов в данном Режиме торгов.

21.3. Заключение сделок в Режиме торгов «Облигации Д – РПС» осуществляется в следующем порядке:

21.3.1. При проведении торгов в Режиме торгов «Облигации Д – РПС» сделки заключаются на основании адресных заявок РПС, поданных Участниками торгов в ходе торгов текущего торгового дня в данном Режиме торгов. В адресных заявках РПС должны быть указаны реквизиты, предусмотренные в п. 16.5. Раздела 16 «Режим переговорных сделок» настоящих Правил.

21.3.2. При получении встречной адресной заявки РПС к своей адресной заявке РПС Участник торгов вправе до окончания торгов в Режиме торгов «Облигации Д – РПС» (если решением Генерального директора Биржи не установлено иное) либо заключить сделку на условиях, указанных в адресной заявке РПС, либо направить контрагенту адресную заявку РПС с новыми условиями, либо отклонить полученную заявку. При получении адресной заявки РПС с заполненным полем «ссылка» для заключения сделки необходимо направить контрагенту встречную адресную заявку РПС, в которой поле "ссылка" содержит информацию, точно соответствующую информации, содержащейся в поле "ссылка" полученной адресной заявки РПС.

21.3.3. Заключение сделки в Режиме торгов «Облигации Д – РПС» осуществляется в Системе торгов при совпадении следующих условий, указанных в двух встречных адресных заявках РПС:

- наименование (торговый код) ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;

- цена за одну ценную бумагу;
- ссылка (проверяемое поле, комментарий);
- ставка фиксированного возмещения;
- код расчетов.

Под встречными заявками понимаются заявки противоположной направленности, адресованные Участниками торгов друг другу.

Решением Генерального директора Биржи может быть предусмотрена возможность заключения сделки в Системе торгов при совпадении в двух встречных адресных заявках РПС всех условий, перечисленных в настоящем подпункте Правил, за исключением количества ценных бумаг, выраженного в лотах.

21.3.4. При неисполнении Участником торгов обязательства по поставке ценных бумаг по сделке с кодом расчетов В0-В05 или В06-В30 данный Участник торгов:

- обязан уплатить в порядке, установленном в Правилах клиринга, Участнику торгов - контрагенту по сделке переменное возмещение в размере суммы денежных средств, определяемой как произведение количества ценных бумаг в данной сделке и положительной разницы между максимальной ценой возмещения по соответствующей ценной бумаге (рассчитанной в надлежащую дату исполнения сделки или в следующий расчетный день после надлежащей даты исполнения) и ценой за одну ценную бумагу, указанной в сделке;
- не имеет обязательств по уплате Участнику торгов - контрагенту по сделке переменного возмещения (если максимальная цена возмещения по ценной бумаге, являющейся предметом данной сделки, рассчитанная в надлежащую дату исполнения сделки или в следующий расчетный день после надлежащей даты исполнения, ниже или равна цене за одну ценную бумагу, указанной в сделке).

21.3.5. При неисполнении Участником торгов обязательства по уплате денежных средств по сделке с кодом расчетов В0-В05 или В06-В30 данный Участник торгов:

- обязан уплатить в порядке, установленном в Правилах клиринга, Участнику торгов - контрагенту по сделке переменное возмещение в размере суммы денежных средств, определяемой как произведение количества ценных бумаг в данной сделке и положительной разницы между ценой за одну ценную бумагу, указанной в сделке, и минимальной ценой возмещения по соответствующей ценной бумаге (рассчитанной в надлежащую дату исполнения сделки или в следующий расчетный день после надлежащей даты исполнения);
- не имеет обязательств по уплате Участнику торгов - контрагенту по сделке переменного возмещения (если минимальная цена возмещения по ценной бумаге, являющейся предметом данной сделки, рассчитанная в надлежащую дату исполнения

сделки или в следующий расчетный день после надлежащей даты исполнения, выше или равна цене за одну ценную бумагу, указанной в сделке).

21.3.6. При неисполнении Участником торгов обязательств (по уплате денежных средств или по поставке ценных бумаг) по сделке с кодом расчетов В0-В05 или В06-В30 данный Участник торгов обязан уплатить Участнику торгов - контрагенту по сделке фиксированное возмещение в порядке, установленном в Правилах клиринга. При этом фиксированное возмещение рассчитывается как произведение ставки фиксированного возмещения, указанной в адресной заявке РПС, на объем данной сделки.

21.3.7. Переменное и фиксированное возмещение по сделкам с ценными бумагами, заключенным на Бирже за иностранную валюту, удерживается в российских рублях по курсу Банка России на дату неисполнения соответствующих сделок в порядке, установленном в Правилах клиринга.

21.3.8. Участник торгов имеет право отказаться от получения переменного и фиксированного возмещения, обеспечив поступление на Биржу письменного уведомления по форме, предусмотренной в Приложении №6 к настоящим Правилам, до даты уплаты переменного и фиксированного возмещения в соответствии с Правилами клиринга.

21.3.9. В случае, если оба Участника торгов - контрагента по сделке с кодом расчетов В0-В05 или В06-В30 не исполнили свои обязательства, то они не имеют взаимных обязательств по уплате фиксированного и переменного возмещения по данной сделке.

21.3.10. Участник торгов во время торгов имеет доступ к информации об адресных заявках РПС, направленных данному Участнику торгов, собственных адресных заявках РПС.

22. Подведение итогов торгов. Биржевая информация

22.1. По окончании торгов Биржа проводит сверку сделок, заключенных на Бирже, с данными по заключенным сделкам, переданными в ходе торгов из Системы торгов Биржи в Клиринговую организацию в соответствии с внутренними документами ФБ ММВБ и Правилами клиринга.

22.1.1. При проведении Биржей сверки сделок осуществляется проверка условий сделок, зарегистрированных в Системе торгов и включенных в реестр сделок по окончании торгов, на соответствие условиям сделок, данные о которых направлены в Клиринговую организацию в момент их заключения.

22.1.2. При выявлении по результатам сверки сделок, не соответствующих требованиям настоящих Правил, Генеральный директор Биржи вправе принять решение

об отмене результатов торгов (частично или полностью).

22.2. Раскрытие Участникам торгов текущей информации о торгах, а также информации об итогах торгов (в том числе отчетных документов об итогах торгов) осуществляется в соответствии с требованиями внутренних документов Биржи, нормативных правовых актов федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иных нормативных правовых актов Российской Федерации.

Требования к содержанию отчетных документов, предусмотрены в Приложениях № 2, № 3, № 3А, № 4, № 5, № 7, № 7А, № 8 и № 8А к настоящим Правилам. Формы данных документов могут быть дополнены отдельными расчетными и/или информационными показателями. При этом Участникам торгов предоставляется только информация, не относящаяся к служебной информации и/или коммерческой тайне в соответствии с внутренними документами Биржи.

Раскрытие информации, содержащейся в реестре заявок и реестре сделок, не относящейся к служебной информации и/или коммерческой тайне в соответствии с внутренними документами Биржи, осуществляется только Участникам торгов, за исключением случаев, когда предоставление такой информации должно быть осуществлено в силу требований законов и иных нормативных правовых актов Российской Федерации.

22.3. Биржа в соответствии с требованиями нормативных правовых актов федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг формирует и предоставляет каждому из Участников торгов информацию в срок и объеме, определенных в нормативных правовых актах федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и настоящих Правилах.

22.4. После окончания торгов и/или торгов в отдельном Режиме торгов и/или окончания отдельных периодов соответствующих Режимов торгов в Системе торгов формируются следующие отчетные документы каждому Участнику торгов:

22.4.1. Выписка из реестра сделок, в которой отражаются все сделки, заключенные Участником торгов в течение торгового дня и/или отдельного режима торгов и/или периода режима торгов (форма предусмотрена в Приложении № 2 к настоящим Правилам, формат электронного документа в Приложении № 9 к настоящим Правилам);

22.4.2. Выписка из реестра заявок, в которой отражаются все заявки, поданные Участником торгов в течение торгового дня и/или отдельного режима торгов и/или периода режима торгов (предоставляется по письменному запросу Участника торгов) (форма предусмотрена в Приложении № 3 к настоящим Правилам, формат электронного документа в Приложении № 9 к настоящим Правилам);

22.4.3. Выписка по обязательствам Участника торгов по комиссионному вознаграждению (по форме, предусмотренной в Приложении № 4 к настоящим Правилам)

(форма предусмотрена в Приложении № 4 к настоящим Правилам, формат электронного документа в Приложении № 9 к настоящим Правилам);

22.4.4. Выписка по обязательствам Участника торгов по уплате возмещения (по форме, предусмотренной в Приложении № 5 к настоящим Правилам) (форма предусмотрена в Приложении № 5 к настоящим Правилам, формат электронного документа в Приложении № 9 к настоящим Правилам);

22.4.5. Уведомление о необходимости внесения компенсационных взносов, в случае возникновения соответствующих обязательств (по форме, предусмотренной в Приложении № 7 к настоящим Правилам) (форма предусмотрена в Приложении № 7 к настоящим Правилам, формат электронного документа в Приложении № 9 к настоящим Правилам).

22.4.6. В дополнение к отчетным документам, указанным в п.п. 22.4.1. - 22.4.5. настоящего пункта Правил, в Системе торгов формируются следующие отчетные документы:

- При наступлении даты составления перечня владельцев и/или номинальных держателей облигаций для целей выплаты купонного дохода по облигациям и/или погашением части основного долга (проведением амортизационной выплаты) (далее - фиксация списка владельцев) Биржа направляет Участникам торгов Уведомление об изменении расчетных параметров сделки РЕПО (форма предусмотрена в Приложении № 7А к настоящим Правилам, формат электронного документа в Приложении № 9 к настоящим Правилам) по итогам торгового дня, предшествующего дате начала следующего купонного периода по облигациям, с которыми была заключена сделка РЕПО, а в случае принятия Генеральным директором Биржи решения в соответствии с п. 11.3. Раздела 11 «Особенности проведения торгов по облигациям» - по итогам торгового дня, по окончании которого происходит фиксация списка владельцев.

- По окончании периода сбора заявок в Режимы торгов «Размещение: Адресные заявки», «Выкуп: Адресные заявки», «Размещение: Аукцион», «Выкуп: Аукцион» Эмитенту и/ или Участнику торгов, выступающему по поручению Эмитента, направляется Сводный реестр заявок (форма предусмотрена в Приложении № 8 к настоящим Правилам, формат электронного документа в Приложении № 9 к настоящим Правилам). В случае проведения Аукциона по заявлению Банка России в режиме торгов «Размещение:Аукцион» по окончании периода сбора заявок Банку России направляется Сводный реестр заявок (форма предусмотрена в Приложении № 8 к настоящим Правилам, формат электронного документа в Приложении № 9 к настоящим Правилам).

- По окончании периода сбора заявок в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» Банку России направляется Сводный реестр заявок (Аукцион РЕПО) (форма предусмотрена в Приложении № 8А к настоящим Правилам, формат электронного документа в Приложении № 9 к настоящим Правилам).

- По окончании периода сбора заявок в Режиме торгов «Аукцион РЕПО» Участнику торгов, выступающему от своего имени за счет Эмитента, направляется Сводный реестр заявок (Аукцион РЕПО) (форма предусмотрена в Приложении № 8А к настоящим Правилам, формат электронного документа в Приложении № 9 к настоящим Правилам).

- Выписка из реестра полученных адресных заявок, в которой отражаются все полученные в течение торгового дня данным Участником торгов адресные заявки (предоставляется по письменному запросу Участника торгов) (форма предусмотрена в Приложении № 3А к настоящим Правилам, формат электронного документа в Приложении № 9 к настоящим Правилам).

22.5. Отчетные документы, указанные в пункте 22.4. настоящего Раздела Правил, направляются в форме электронных документов в соответствии с Правилами ЭДО, за исключением Сводного реестра заявок и Сводного реестра заявок (Аукцион РЕПО), которые могут предоставляться одновременно как в бумажной форме, так и в форме электронного документа. Фактом вручения отчетных документов, указанных в пункте 22.4 настоящего Раздела Правил, является их формирование и направление в форме электронных документов в соответствии с Правилами ЭДО.

22.6. Участнику торгов отчетные документы, указанные в пункте 22.4. настоящего Раздела Правил, могут быть выданы в бумажной форме на основании письменного запроса. Для получения отчетных документов, указанных в пункте 22.4. настоящего Раздела Правил, в бумажной форме Участник торгов обязан предоставить на Биржу Список лиц, уполномоченных от его имени получать отчетные документы (по форме, предусмотренной в Приложении № 12 к настоящим Правилам).

22.7. В случае обнаружения ошибок в ранее отправленных Участнику торгов отчетных документах (в форме электронных документов), указанных в пункте 22.4. настоящего Раздела Правил, Участнику торгов отправляется электронный документ «Уведомление об ошибке» (по форме, предусмотренной в Приложении № 10 к настоящим Правилам).

22.8. Перечень документов, форматы файлов, форматы электронных документов, а также категории электронных документов в соответствии с Правилами ЭДО установлены в Приложении № 9 к настоящим Правилам.

22.9. В соответствии с требованиями нормативных правовых актов уполномоченного федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иных нормативных правовых актов Российской Федерации Биржа осуществляет ведение реестра заявок, объявленных Участниками торгов (далее – реестр заявок). Реестр заявок за каждый торговый день формируется в электронной форме после окончания торгов и содержит следующие сведения:

- идентификационный номер заявки;

- вид заявки (в соответствии с п.п. 6.8. – 6.9. Раздела 6 «Заявки» настоящих Правил вид заявки указывает на то, что заявка адресована конкретному Участнику торгов либо всем Участникам торгов);

- направленность заявки;
- наименование ценной бумаги;
- цена одной ценной бумаги (или цена первой части сделки РЕПО);
- количество ценных бумаг;
- ставка РЕПО (для адресных заявок РЕПО (акции) и адресных заявок РЕПО (облигации));

- сумма РЕПО, включая НКД (для сделок РЕПО Режимов торгов «Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» и «РЕПО с облигациями») или не включая НКД (для сделок РЕПО Режимов торгов «Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», «РЕПО» и «РЕПО с акциями»);

- начальное значение дисконта (для адресных заявок РЕПО (акции) и адресных заявок РЕПО (облигации));

- срок сделки РЕПО (для адресных заявок РЕПО (акции) и адресных заявок РЕПО (облигации));

- максимальное предельное значение дисконта (для адресных заявок РЕПО (акции) и адресных заявок РЕПО (облигации));

- минимальное предельное значение дисконта (для адресных заявок РЕПО (акции) и адресных заявок РЕПО (облигации));

- ставка фиксированного возмещения (для сделок РЕПО и сделок в Режиме торгов РПС и «Облигации Д – РПС»);

- код Участника торгов, подавшего заявку;
- код клиента Участника торгов, по поручению которого подана заявка;
- код Участника торгов, которому адресована заявка (для сделок РЕПО и сделок в Режиме торгов РПС и «Облигации Д – РПС»);

- дата и время регистрации заявки в Системе торгов;
- результат подачи заявки (состояние заявки);
- количество сделок, заключенных по данной заявке;
- накопленный купонный доход (для сделок с облигациями);
- время исполнения заявки (для адресных заявок РПС, адресных заявок на заключение сделок в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки», «Выкуп: Адресные

заявки», адресных заявок РЕПО (акции) и адресных заявок РЕПО (облигации));

- дата и время отмены заявки;
- дата и/или время активации заявки (для заявок в Режимов торгов «Размещение: Аукцион», «Размещение: Адресные заявки», «Выкуп: Аукцион», «Выкуп: Адресные заявки»);
- код расчетов;
- идентификатор трейдера (АСП трейдера);
- ссылка.

22.10. В соответствии с требованиями нормативных правовых актов уполномоченного федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иных нормативных правовых актов Российской Федерации Биржа осуществляет ведение реестра сделок, совершенных Участниками торгов (далее – реестр сделок). Реестр сделок за каждый торговый день формируется в электронной форме после окончания торгов и содержит следующие сведения:

- идентификационный номер сделки;
- дата и время регистрации сделки в Системе торгов;
- вид заявки, на основании которой заключена сделка (в соответствии с п.п. 6.8. – 6.9. Раздела 6 «Заявки» настоящих Правил вид заявки указывает на то, что сделка совершена на основании заявки, адресованной конкретному Участнику торгов, либо на основании заявки, адресованной всем Участникам торгов);
- коды Участников торгов, совершивших сделку;
- коды клиентов Участников торгов на Бирже, по поручению которых заключена сделка;
- наименование эмитента (название паевого инвестиционного фонда), вид, категорию (тип), серию ценной бумаги, являющуюся предметом сделки;
- номинальная стоимость одной ценной бумаги (непогашенная часть основного долга), если таковая имеется;
- цена одной ценной бумаги (или цену первой части сделки РЕПО);
- объем сделки;
- сумма РЕПО, включая НКД (для сделок РЕПО Режимов торгов «Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» и «РЕПО с облигациями») или не включая НКД (для сделок РЕПО Режимов торгов «Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», «РЕПО» и «РЕПО с акциями»);

- начальное значение дисконта (для сделок РЕПО);
- срок сделки РЕПО (для сделок РЕПО);
- максимальное предельное значение дисконта (для сделок РЕПО);
- минимальное предельное значение дисконта (для сделок РЕПО);
- количество ценных бумаг;
- накопленный купонный доход (для сделок с облигациями);
- ставка РЕПО (для сделок РЕПО);
- ставка фиксированного возмещения (для сделок РЕПО и сделок в Режиме торгов РПС и «Облигации Д – РПС»);
- номера заявок, на основании которых заключена сделка;
- величина комиссионного вознаграждения Биржи, уплаченного по сделке;
- код расчетов;
- ссылка.

22.11. Вся информация, связанная с ходом и итогами проведения торгов на Бирже, является собственностью Биржи. Участники торгов и/или их клиенты имеют право распространять указанную информацию только на основании договора, заключаемого с Биржей и/или организацией, которой Биржей передано право распространения принадлежащей Бирже информации. В случае распространения Участником торгов и/или его клиентом информации о ходе и итогах торгов без заключения договора с Биржей, Участник торгов несет ответственность в порядке, предусмотренном в Разделе 29 «Ответственность за нарушение правил совершения операций на Бирже» настоящих Правил. Не является распространением информации и не влечет применение мер ответственности в соответствии с настоящим пунктом предоставление Участником торгов своему клиенту информации о ходе и итогах торгов только в объеме, необходимом для принятия решения о заключении сделок.

22.12. Состав раскрываемой Биржей Участникам торгов информации, связанной с ходом и итогами торгов на Бирже, предусмотрен требованиями нормативных правовых актов федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг, иных нормативных правовых актов Российской Федерации и внутренними документами Биржи.

23. Чрезвычайные ситуации

23.1. Под чрезвычайной ситуацией на Бирже понимаются обстоятельства, которые по оценке Генерального директора Биржи нарушили, нарушают или могут

нарушить нормальное функционирование процесса торгов на Бирже. Для признания ситуации на Бирже чрезвычайной достаточно решения Генерального директора Биржи.

23.2. Чрезвычайными могут быть признаны ситуации, связанные с наступлением обстоятельств, препятствующих проведению торгов на Бирже и подведению итогов торгов на Бирже, в том числе обстоятельств непреодолимой силы: пожаров, аварий, стихийных бедствий, а также действий, которые могут быть приравнены к обстоятельствам непреодолимой силы, в том числе: военных действий, актов террора, диверсии и саботажа, забастовок, смены политического режима и других политических осложнений, изменений законодательных или иных актов государственных органов Российской Федерации, решений законодательных и исполнительных органов власти, а также технических сбоев, возникших вследствие неисправностей и отказов оборудования, сбоев и ошибок программного обеспечения, сбоев, неисправностей и отказов систем связи, энергоснабжения, кондиционирования и других систем жизнеобеспечения.

23.3. Чрезвычайными могут быть признаны также ситуации, связанные с наступлением иных обстоятельств, препятствующих проведению торгов на Бирже и подведению итогов торгов на Бирже, которые, как и обстоятельства, указанные в п. 23.2. настоящего Раздела Правил, находятся вне контроля Биржи.

24. Порядок мониторинга и контроля за сделками, совершаемыми на Бирже

Содержание данного раздела не раскрывается в соответствии с требованием пункта 7.2. Раздела VII «Раскрытие и предоставление информации организатором торговли» Положения о деятельности по организации торговли на рынке ценных бумаг, утвержденного Приказом Федеральной службы по финансовым рынкам от 9 октября 2007 г. № 07-102/пз-н.

25. Правила, ограничивающие манипулирование ценами

25.1. В целях предотвращения манипулирования ценами, возникновения конфликта интересов, неправомерного использования при совершении сделок служебной информации, а также в целях снижения рисков на рынке ценных бумаг, при организации торгов ценными бумагами на Бирже действует следующая система мер:

25.1.1. В целях осуществления контроля за сделками с ценными бумагами, заключенными на Бирже, а также за Участниками торгов, Биржа обеспечивает функционирование системы контроля, отвечающей требованиям нормативных правовых актов федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иных

нормативных правовых актов Российской Федерации, которая предусматривает:

- осуществление мониторинга торгов с целью выявления нестандартных сделок и проверку их на предмет совершения действий, имеющих признаки манипулирования ценами, нарушений настоящих Правил и иных внутренних документов Биржи, регламентирующих порядок проведения торгов на Бирже, а также на предмет использования при их совершении служебной информации и нарушения требований об обязательных действиях в случае возникновения конфликта интересов;
- контроль за Участниками торгов, осуществляемый путем сбора и анализа финансовой и иной отчетности и сведений, предусмотренных внутренними документами Биржи и требованиями нормативных правовых актов федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иных нормативных правовых актов Российской Федерации.

25.1.2. В целях контроля за подачей заявок на совершение сделок с ценными бумагами на Бирже, устанавливаются дополнительные ограничения на параметры заявок, при превышении которых заявки не регистрируются в Системе торгов, в том числе:

- предельные границы колебания цены ценной бумаги;
- перечень допустимых кодов расчетов;
- ограничение количества ценных бумаг, выраженного в лотах и указываемого в заявке.

Указанные ограничения устанавливаются решением Генерального директора Биржи, при этом может устанавливаться перечень ценных бумаг и/или Режимов торгов, а также категорий Участников торгов, для которых устанавливаются соответствующие ограничения, а также иные ограничения. Кроме того, решением Генерального директора Биржи могут устанавливаться ограничения на подачу определенных видов заявок на совершение сделок с ценными бумагами на ФБ ММВБ.

25.1.3. Биржа осуществляет непрерывное предоставление в федеральный орган исполнительной власти по рынку ценных бумаг сведений о ходе торгов ценными бумагами на Бирже, включая сведения о выставляемых Участниками торгов заявках и совершаемых ими сделках, а также иные установленные законодательством о ценных бумагах, нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иных нормативных правовых актов Российской Федерации сведения.

25.1.4. Установлена процедура приостановки и возобновления торгов ценными бумагами (отдельной ценной бумагой или несколькими ценными бумагами) на ФБ ММВБ в случаях и порядке, указанных в Приложении № 1 к настоящим Правилам.

25.2. В целях предотвращения дестабилизации рынка акций устанавливается, что если в течение 40 и более любых торговых дней предыдущего квартала с акцией,

допущенной к торгам на ФБ ММВБ, не заключено ни одной сделки и/или в течение предыдущего квартала сделки с акцией заключались менее чем пятью различными Участниками торгов, то решением Генерального директора Биржи может быть определено, что при торгах данной акцией Участник торгов вправе подавать в Систему торгов только заявки, указанные в Разделе 16 «Режим переговорных сделок» и в Разделе 17 «Порядок заключения сделок РЕПО» настоящих Правил.

Сделки РЕПО и сделки, заключенные при размещении акций, для проверки соответствия данной акции требованиям настоящего пункта не учитываются. Если торги акцией на Бирже ранее не проводились или проводились менее одного квартала, то ограничение на подачу заявок, предусмотренное настоящим пунктом, может быть распространено на данную акцию по решению Генерального директора Биржи.

Перечень акций, при торгах которыми действует указанное ограничение, устанавливается решением Генерального директора Биржи и пересматривается по окончании каждого квартала. Если по окончании квартала в данный перечень акций вносятся изменения, то они вступают в силу не позднее 7 (седьмого) дня нового квартала (если иное не определено решением Генерального директора Биржи).

25.3. В целях предотвращения дестабилизации рынка ценных бумаг, манипулирования ценами и использования методов недобросовестной торговли (возникновения конфликта интересов и неправомерного использования при совершении сделок служебной информации) устанавливается, что нарушением настоящих Правил могут быть признаны следующие действия Участников торгов, необусловленные объективными событиями, влияющими на рынок ценных бумаг, в ходе торгов:

25.3.1. Подача заявки, в результате которой совершена сделка, приведшая к существенному изменению одного или нескольких из перечисленных ниже показателей:

- цены предторгового периода;
- цены послеторгового периода;
- цены закрытия;
- текущей цены;
- средневзвешенной цены (текущей средневзвешенной цены);
- рыночной цены, рассчитываемой в порядке, установленном нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации;
- значения фондовых индексов, рассчитываемых Биржей.

25.3.2. Совершение сделки в ходе торговой сессии, цена которой отличается от текущей средневзвешенной цены более чем на 15% при совершении сделки с акциями, и более чем на 5% - при совершении сделки с облигациями или инвестиционными паями.

25.3.3. Совершение сделки в РПС, цена которой отличается от текущей средневзвешенной цены ценной бумаги более чем на 20%.

25.4. При совершении Участником торгов действий, указанных в п. 25.3. настоящего Раздела Правил, Биржа имеет право направить Участнику торгов запрос, предусматривающий предоставление документов и сведений, прямо или косвенно касающиеся такой сделки (заявки), и раскрывающих причины и обстоятельства совершения сделки (подачи заявки), включая поручение клиента Участника торгов, на основании которого была подана заявка (если заявка подана Участником торгов на совершение сделки по поручению и за счет клиента).

Участник торгов обязан в течение 5-ти рабочих дней с момента получения данного запроса представить на Биржу письменное объяснение своих действий.

25.5. В случае предоставления Участником торгов неудовлетворительных объяснений совершения им действий, подпадающих под условия п. 25.3. настоящих Правил, или неполучения от Участника торгов объяснений в установленный срок, или при наличии оснований квалифицировать в соответствии с п. 25.3. действия Участника торгов как нарушение настоящих Правил, Биржа имеет право применить к Участнику торгов меры ответственности, установленные в п. 29.6. Раздела 29 «Ответственность за нарушения правил совершения операций на Бирже» настоящих Правил, и/или обратиться в федеральный орган исполнительной власти по рынку ценных бумаг.

26. Фондовые индексы

26.1. Биржа рассчитывает в соответствии с установленными Биржей методиками (правилами) следующие фондовые индексы:

- Индекс ММВБ, используемый в целях приостановления торгов;
- иные фондовые индексы.

26.2. Методики (правила) расчета фондовых индексов утверждаются Дирекцией Биржи и подлежат согласованию с Закрытым акционерным обществом «Московская межбанковская валютная биржа», являющимся правообладателем товарных знаков «Индекс ММВБ» и «MICEX Index», используемых в наименованиях фондовых индексов. Правила расчета Индекса ММВБ, а также методики (правила) расчета иных фондовых индексов разрабатываются при участии Индексного комитета при Дирекции Закрытого акционерного общества «Фондовая биржа ММВБ», осуществляющего свою деятельность в соответствии с Положением, утверждаемым Дирекцией Биржи.

26.3. Индекс ММВБ рассчитывается в соответствии с требованиями, предъявляемыми к фондовым индексам в нормативных правовых актах федерального

органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг, устанавливающих требования к деятельности по организации торговли на рынке ценных бумаг. Методика расчета Индекса ММВБ определяется Правилами расчета Индекса ММВБ, утверждаемыми Дирекцией Биржи и подлежащими регистрации в Федеральной службе по финансовым рынкам.

26.4. Биржа направляет утвержденные Дирекцией Биржи методики (правила) расчета фондовых индексов, за исключением Правил расчета Индекса ММВБ, в Федеральную службу по финансовым рынкам в порядке и сроки, предусмотренные нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг.

27. Уплата комиссионного вознаграждения

27.1. Участник торгов обязан уплачивать комиссионное вознаграждение по сделкам с ценными бумагами, заключенным на Бирже за российские рубли и за иностранную валюту, (далее – комиссионное вознаграждение) в российских рублях в размере, установленном Советом директоров ФБ ММВБ.

27.2. По сделкам с любыми кодами расчетов комиссионное вознаграждение удерживается в пользу Биржи в день заключения сделки в порядке, определенном в Правилах клиринга.

27.3. Совет директоров ФБ ММВБ вправе в соответствии с настоящими Правилами устанавливать льготы по уплате комиссионного вознаграждения по сделкам с определенными видами ценных бумаг, в определенных режимах торгов, либо для всех Участников торгов на Бирже, либо для всех Участников торгов на Бирже, заключивших соглашение о выполнении функций маркет-мейкеров или специалистов.

27.4. Комиссионное вознаграждение по сделкам с ценными бумагами, заключенным на Бирже за иностранную валюту, определяется по курсу Банка России, установленному на дату совершения соответствующих сделок.

27.5. Размер комиссионного вознаграждения и его калькуляция раскрывается через представительство ФБ ММВБ в сети ИНТЕРНЕТ в порядке, предусмотренном во внутренних документах ФБ ММВБ, нормативных правовых актах уполномоченного федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иных нормативных правовых актах Российской Федерации.

27.6. В случае невозможности произвести удержание комиссионного вознаграждения в порядке, определенном в п.п. 27.2. - 27.5. настоящего Раздела Правил, величина комиссионного вознаграждения учитывается каждый следующий расчетный день после даты заключения этих сделок вплоть до даты погашения обязательств в

качестве ограничительного лимита по уплате комиссионного вознаграждения для данного Участника торгов, устанавливаемого Клиринговой организацией в отношении позиции по денежным средствам, соответствующей определенному условиям сделки торгового-клиринговому счету.

27.7. Неустойка, начисленная в связи с неисполнением обязательств по уплате комиссионного вознаграждения в пользу Биржи, удерживается с Участников торгов, начиная со второго расчетного дня после даты заключения соответствующих сделок с ценными бумагами в порядке, определенном в Правилах клиринга. При этом, на второй расчетный день после даты заключения вышеуказанных сделок с ценными бумагами величина неустойки по этим сделкам учитывается в качестве ограничительного лимита по уплате комиссионного вознаграждения для данного Участника торгов, устанавливаемого Клиринговой организацией в отношении позиции по денежным средствам, соответствующей определенному условиям сделки торгового-клиринговому счету.

27.8. Неустойка, начисленная в связи с неисполнением обязательств по уплате комиссионного вознаграждения, удерживается с Участника торгов только после полной уплаты им в пользу Биржи комиссионного вознаграждения по сделкам с ценными бумагами.

28. Контроль за исполнением Участниками торгов обязательств по сделкам с ценными бумагами

28.1. Биржа осуществляет контроль за исполнением Участниками торгов обязательств по заключенным сделкам с ценными бумагами с кодами расчетов T0, Z0, B0-B05, B06-B30, а также сделкам РЕПО в порядке, предусмотренном Разделом 12 «Порядок взаимодействия с клиринговой организацией. Порядок исполнения сделок» настоящих Правил и Правилами клиринга.

28.2. По сделкам, заключаемым в соответствии с Разделом 16 «Режим переговорных сделок», Разделом 17 «Порядок заключения сделок РЕПО» или Разделом 21 «Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Облигации Д - Режим основных торгов» и «Облигации Д - РПС»» может предусматриваться уплата фиксированного возмещения и/или переменного возмещения. Обязательства по уплате фиксированного и/или переменного возмещения представляют собой способ обеспечения исполнения обязательств, вытекающих из сделок, заключаемых в соответствии с Разделом 16 «Режим переговорных сделок», Разделом 17 «Порядок заключения сделок РЕПО» или Разделом 21 «Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Облигации Д - Режим основных торгов» и «Облигации Д - РПС»» настоящих Правил.

28.3. Уплата фиксированного возмещения или фиксированного и переменного

возмещения Участником торгов, не исполнившим своих обязательств по сделке, не освобождает такого Участника торгов от исполнения всех обязательств по заключенной сделке, условия которой предусматривают уплату фиксированного или фиксированного и переменного возмещения. При этом уплата фиксированного возмещения или фиксированного и переменного возмещения Участником торгов, не исполнившим своих обязательств по сделке, не освобождает такого Участника торгов от возмещения убытков, причиненных неисполнением сделки, заключенной в соответствии с настоящими Правилами, Участнику торгов, исполнившему свои обязательства по сделке, в размере, превышающем размер суммы фиксированного возмещения или фиксированного и переменного возмещения, уплачиваемого Участнику торгов, исполнившему свои обязательства по сделке. В случае возникновения споров и разногласий между Участниками торгов в связи с неисполнением обязательств по уплате фиксированного возмещения или фиксированного и переменного возмещения, такие споры подлежат разрешению в соответствии с Разделом 30 «Порядок разрешения споров» настоящих Правил.

28.4. При неисполнении Участником торгов своих обязательств по заключенным на Бирже сделкам, Участнику торгов могут быть применены виды ответственности, предусмотренные в Разделе 29 «Ответственность за нарушение правил совершения операций на Бирже».

29. Ответственность за нарушение правил совершения операций на Бирже

29.1. За нарушение правил совершения операций на Бирже Участник торгов несет ответственность, предусмотренную настоящими Правилами и законодательством Российской Федерации.

29.2. ФБ ММВБ, являясь организатором торговли на рынке ценных бумаг, на которого в соответствии с требованиями нормативных правовых актов федерального органа исполнительной власти и иных нормативных правовых актов Российской Федерации возложены функции контроля за Участниками торгов, включая соблюдение ими правил организатора торговли, устанавливает виды и размеры ответственности за нарушение настоящих Правил, применение которых осуществляется по решению Генерального директора Биржи.

29.3. В случае нарушения Участником торгов правил совершения операций на Бирже Участнику торгов может быть объявлено официальное предупреждение.

29.4. Биржа через представительство ФБ ММВБ в сети «ИНТЕРНЕТ» раскрывает информацию о неисполнении Участником торгов обязательств по заключенной сделке всем заинтересованным лицам.

29.5. При неисполнении Маркет-мейкером или Специалистом обязательств, предусмотренных п.п. 13.4. и 13.5. Раздела 13 «Маркет-мейкеры и Специалисты» настоящих Правил, к ним может быть применен один из следующих видов ответственности:

- вынесение официального предупреждения Участнику торгов, заключившему с Биржей Соглашение о выполнении функций Маркет-мейкера или Соглашение о выполнении функций Специалиста;
- лишение Участника торгов статуса Маркет-мейкера (с расторжением в одностороннем порядке соответствующего Соглашения);
- лишение Участника торгов статуса Специалиста на рынке определенной ценной бумаги (с расторжением в одностороннем порядке соответствующего Соглашения).

29.6. При совершении Участником торгов действий, указанных в п. 25.5. Раздела 25 «Правила, ограничивающие манипулирования ценами» настоящих Правил, к Участнику торгов может применяться один из следующих видов ответственности:

- официальное предупреждение;
- наложение штрафа в размере рублевого эквивалента 300 долларов США за первый установленный факт нарушения. Размер штрафа увеличивается на 50% за каждое повторное нарушение, но не свыше 3000 долларов США. Штраф уплачивается Бирже;
- приостановка допуска к торгам на Бирже на срок до 3 месяцев;
- обращение к Совету директоров ФБ ММВБ с ходатайством об исключении из состава Участников торгов.

29.7. При неисполнении Участником торгов сделки с ценными бумагами, в том числе, в надлежащую дату ее исполнения, к данному Участнику торгов по решению Генерального директора Биржи может применяться один из следующих видов ответственности:

- официальное предупреждение;
- наложение штрафа в размере 0,05% (ноль целых пяти сотых процента) от объема данной сделки. Штраф уплачивается Бирже;
- приостановка допуска к торгам в отдельных режимах торгов или к заключению сделок с отдельными кодами расчетов;
- приостановка допуска к торгам на Бирже на срок до 3 месяцев;
- обращение к Совету директоров ФБ ММВБ с ходатайством об исключении из состава Участников торгов.

29.8. При неуплате Участником торгов компенсационного взноса в размере и порядке, определенном в соответствии с настоящими Правилами, на данного Участника

торгов по решению Генерального директора Биржи может быть наложен штраф в размере 0,05% (ноль целых пяти сотых процента) от текущей суммы РЕПО по соответствующей сделке.

29.9. При применении ответственности в виде штрафа, взыскиваемого Биржей с Участника торгов, штраф должен быть уплачен в течение 5 банковских дней со дня получения Участником торгов от Биржи уведомления о наложении штрафа.

Подлежащие взысканию ФБ ММВБ штрафы уплачиваются в российских рублях по курсу Банка России, установленному на дату принятия Генеральным директором Биржи решения о наложении штрафа.

29.10. В случае неуплаты в установленные сроки и в установленных размерах штрафов Бирже, предусмотренных в настоящем Разделе Правил, Генеральный директор Биржи вправе:

- приостановить допуск Участника торгов к участию в торгах на Бирже на срок до торгового дня, следующего за днем получения Биржей подтверждения об уплате штрафа;
- обратиться к Совету директоров ФБ ММВБ с ходатайством об исключении из состава Участников торгов.

29.11. За неуплату в установленные сроки в установленных размерах комиссионного вознаграждения, применяется один из следующих видов ответственности:

- уплата Бирже неустойки в размере 2% от суммы подлежащего уплате комиссионного вознаграждения за каждый день просрочки;
- приостановка допуска к участию в торгах на Бирже на срок до торгового дня, следующего за днем получения Биржей подтверждения об уплате комиссионного вознаграждения;
- обращение к Совету директоров ФБ ММВБ с ходатайством об исключении из состава Участников торгов.

29.12. Удержание с Участника торгов неустойки, предусмотренной в п. 29.11. настоящего Раздела, осуществляется в порядке, предусмотренном в Правилах клиринга.

29.13. При распространении Участником торгов и/или его клиентом информации о ходе и итогах торгов на Бирже без заключения соответствующего договора с Биржей, к Участнику торгов применяются следующие виды ответственности:

- наложение штрафа в размере рублевого эквивалента 1000 долларов США. Штраф уплачивается Бирже и/или;
- приостановка допуска к участию в торгах на Бирже на срок до 1 года и/или;
- обращение к Совету директоров ФБ ММВБ с ходатайством об исключении из состава Участников торгов.

29.14. Неисполнение Участниками торгов – контрагентами обязательств по сделке с кодами расчетов В0-В05, В06-В30 или обязательств по первой и/или второй части сделки РЕПО в случае прекращения торгов по ценной бумаге на Бирже, в том числе, в связи с конвертацией ценной бумаги, составляющей предмет обязательства Участника торгов в соответствии с заключенной на Бирже сделкой, не является нарушением настоящих Правил, за которое установлены меры ответственности в соответствии с настоящими Правилами, если такое прекращение торгов по ценной бумаге повлекло невозможность исполнения обязательств по заключенной сделке в порядке, установленном настоящими Правилами и Правилами клиринга.

29.15. За нарушение требований в отношении порядка разрешения споров, а также правил поведения сторон при разрешении споров в соответствии с Разделом 30 «Порядок разрешения споров» настоящих Правил к Участнику торгов может быть применен один из следующих видов ответственности:

- вынесение официального предупреждения Участнику торгов;
- приостановка допуска к участию в торгах на Бирже на срок, установленный решением Генерального директора;
- обращение к Совету директоров ФБ ММВБ с ходатайством об исключении из состава Участников торгов.

30. Порядок разрешения споров

30.1. Все гражданско-правовые споры и разногласия, возникающие в связи с осуществлением деятельности на ФБ ММВБ в соответствии с настоящими Правилами, заключением, изменением и прекращением сделок на ФБ ММВБ, признанием сделок недействительными или незаключенными, а также исполнением обязательств, вытекающих из заключенных на ФБ ММВБ сделок или в связи с ними, подлежат рассмотрению и разрешению в Арбитражной комиссии при Закрытом акционерном обществе «Московская межбанковская валютная биржа» в соответствии с Регламентом третейского разбирательства Арбитражной комиссии при Закрытом акционерном обществе «Московская межбанковская валютная биржа».

30.2. Решения Арбитражной комиссии при Закрытом акционерном обществе «Московская межбанковская валютная биржа» являются окончательными и обязательными для сторон. Неисполненное добровольно решение Арбитражной комиссии при Закрытом акционерном обществе «Московская межбанковская валютная биржа» подлежит принудительному исполнению в соответствии с законодательством Российской Федерации или законодательством иной страны места принудительного исполнения и/или международными соглашениями.

30.3. Участники торгов обязаны предпринимать все возможные усилия, направленные на то, чтобы возникший спор был разрешен в максимально короткий срок. С этой целью Участники торгов обязаны совершать действия, необходимые для формирования состава суда в максимально короткий срок, обеспечивать своевременное предоставление суду объяснений по делу, доказательств и иных документов и/или материалов, необходимых для рассмотрения спора.

30.4. Участники торгов обязаны воздерживаться от действий, направленных на необоснованное затягивание процедуры рассмотрения спора в Арбитражной комиссии при Закрытом акционерном обществе «Московская межбанковская валютная биржа» (далее – Арбитражная комиссия при ЗАО ММВБ).

30.5. Участники торгов в случае передачи спора на разрешение в Арбитражную комиссию при ЗАО ММВБ обязаны прилагать усилия, способствующие разрешению спора путем заключения мирового соглашения. В случае завершения разбирательства заключением мирового соглашения Участники торгов обязаны добросовестно и неукоснительно исполнять заключенное мировое соглашение.

30.6. Участники торгов обязаны в максимально короткие сроки исполнять определения и решения, вынесенные Арбитражной комиссией при ЗАО ММВБ. Участники торгов обязаны воздерживаться от совершения действий, направленных на необоснованное затягивание процедуры исполнения вынесенных решений и/или определений Арбитражной комиссии при ЗАО ММВБ.

к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»

Порядок приостановки и возобновления торгов при наступлении чрезвычайных ситуаций (обстоятельств, которые могут быть признаны чрезвычайными ситуациями), а также иных ситуаций, определенных настоящими Правилами, нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

1. Под чрезвычайной ситуацией на Бирже понимаются обстоятельства, которые по оценке Генерального директора Биржи нарушили, нарушают или могут нарушить нормальное функционирование процесса торгов на Бирже. Перечень обстоятельств, наступление которых является основанием для признания ситуации чрезвычайной, а также порядок признания ситуации чрезвычайной определяются Разделом 23 «Чрезвычайные ситуации» настоящих Правил.

2. В случае наступления в ходе торгов обстоятельств, которые могут являться основанием для признания ситуации чрезвычайной, Маклер приостанавливает (задерживает) торги на период не более 60 минут для осуществления необходимых мероприятий, направленных на обеспечение нормального проведения торгов на Бирже. Не позднее 60 минут с момента приостановки торгов Маклер вправе возобновить торги, если Генеральным директором Биржи не будет принято иное решение. Сообщения о приостановке (задержке) торгов, а также о возобновлении торгов направляются Участникам торгов средствами Системы торгов.

Сообщение об изменении времени начала торгов или окончания торгов в отдельных Режимах торгов направляется Участникам торгов средствами Системы торгов.

3. В случае признания ситуации чрезвычайной, по решению Генерального директора Биржи торги могут быть задержаны, приостановлены или признаны несостоявшимися. В случае признания торгов несостоявшимися заявки считаются неподанными, сделки – незаключенными.

4. В случае приостановки торгов в связи с наступлением чрезвычайной ситуации, по решению Генерального директора Биржи или по требованию Участника торгов может быть организована сверка результатов торгов, которая осуществляется в следующем порядке:

4.1. При проведении Биржей по решению Генерального директора Биржи сверки

сделок осуществляется проверка реквизитов заявок, условий заключения сделок на соответствие реквизитам заявок, на основании которых они заключены, а также проверяется соблюдение требований порядка заключения сделок, установленного в настоящих Правилах;

4.2. По итогам проведения сверки оформляется протокол проведения сверки сделок, подписываемый Генеральным директором Биржи и/или иным уполномоченным лицом в случаях, установленных Генеральным директором Биржи.

4.3. При выявлении по результатам сверки заявок и сделок, несоответствующих требованиям настоящих Правил, Генеральный директор Биржи вправе принять решение об отмене результатов торгов (частично или полностью).

5. По итогам сверки и/или урегулирования чрезвычайной ситуации, по решению Генерального директора Биржи торги могут быть завершены досрочно или возобновлены. При этом, досрочное завершение торгов не означает признания их несостоявшимися.

6. В случае признания по решению Генерального директора Биржи ситуации чрезвычайной Маклер может приостановить или задержать доступ Участника торгов к Системе торгов.

7. В случае признания по решению Генерального директора Биржи ситуации чрезвычайной Участники торгов средствами Системы торгов или иным способом оповещаются о возникновении такой ситуации, а также о предпринятых Генеральным директором Биржи в связи с этим действиях. Решения Генерального директора Биржи по урегулированию чрезвычайной ситуации на Бирже являются обязательными для исполнения Участниками торгов.

8. В чрезвычайных ситуациях, исходя из конкретных обстоятельств, Генеральный директор Биржи вправе принимать иные решения, и требовать от Участников торгов на Бирже выполнения этих решений. По решению Генерального директора Биржи все или часть вопросов, связанных с урегулированием чрезвычайных ситуаций, могут быть переданы на рассмотрение Дирекции ФБ ММВБ.

9. В случае урегулирования чрезвычайной ситуации Генеральный директор Биржи вправе возобновить торги. Сообщение о возобновлении торгов на Бирже направляется Участникам торгов средствами Системы торгов.

10. Торги на Бирже приостанавливаются по решению Генерального директора Биржи или иного уполномоченного лица (в случаях, установленных Генеральным директором Биржи), при наступлении условий, являющихся основанием для приостановки/прекращения торгов в соответствии с требованиями нормативных правовых актов федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг. Сообщение о приостановке торгов направляется Участникам торгов средствами Системы торгов.

11. Торги по отдельной ценной бумаге приостанавливаются в первый день ее обращения на Бирже до конца текущего торгового дня в случае повышения или снижения текущей цены данной ценной бумаги по сравнению с расчетной ценой для целей определения отклонений цен более чем на 20%.

12. В случае приостановки торгов в соответствии с п. 10. настоящего Приложения к Правилам торги возобновляются по решению Генерального директора Биржи или иного уполномоченного лица (в случаях, установленных Генеральным директором Биржи), за исключением случаев, предусмотренных нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг, когда торги возобновляются на основании распоряжения федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг.

13. В случае приостановки торгов в соответствии с п. 10. настоящего Приложения к Правилам в федеральный орган исполнительной власти по рынку ценных бумаг незамедлительно направляется сообщение о факте приостановки торгов на Бирже, а также не позднее следующего рабочего дня справка обо всех случаях приостановления (прекращения) торгов, содержащие сведения, предусмотренные нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг.

14. При наступлении ситуации ценовой нестабильности ценной бумаги торги отдельной ценной бумагой могут быть приостановлены во всех режимах торгов, либо в отдельном режиме торгов по решению Генерального директора Биржи или иного уполномоченного лица в случаях, установленных Генеральным директором Биржи. При этом все неудовлетворенные заявки, поданные в соответствующих режимах торгов и находящиеся в Системе торгов на момент приостановки торгов, удаляются из Системы торгов. Торги ценной бумагой возобновляются по истечении периода приостановки, если Генеральным директором Биржи или иного уполномоченного лица в случаях, установленных Генеральным директором Биржи, не будет принято иное решение.

15. Торги отдельной ценной бумагой могут быть приостановлены во всех режимах торгов, либо в отдельном режиме торгов по решению Генерального директора Биржи (или иного уполномоченного лица в случаях, установленных Генеральным директором Биржи), в случае выявления нарушений, указанных в п. 25.3. настоящих Правил. При этом все неудовлетворенные заявки, поданные в соответствующих режимах торгов и находящиеся в Системе торгов на момент приостановки торгов, удаляются из Системы торгов. Торги ценной бумагой возобновляются по истечении периода приостановки, если Генеральным директором Биржи (или иного уполномоченного лица в случаях, установленных Генеральным директором Биржи), не будет принято иное решение.

ПРИЛОЖЕНИЕ №2

**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»**

Форма выписки из реестра сделок

День недели, дата

ФБ ММВБ

Участник торгов (Код Участника торгов)

Идентификатор Участника торгов

Режим торгов

Ценная бумага

Номинальная стоимость(непогашенная часть основного долга)

Номер торгового-клирингового счета

№ п/п	Номер сделки	Время	Вид сделки	Цена	Количество	Объем	Контрагент (Код Участника торгов-Контрагент	Номер торгового-клирингового счета контрагента	Код расчетов	Комиссионное вознагражд	Номер заявки	Вид заявки	НКД	Ставка РЕПО	Сумма РЕПО, включая	Начальное значение дисконта, %	Срок РЕПО	Минимальное предельное значение	Максимальное предельное значение	Ставка фикс. Возмещени	Ссылка	Клиент	Примечани е
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24

Маклер ФБ ММВБ

(подпись)

*Сделки, заключенные Участником торгов в Системе торгов на основании подаваемых им заявок, были заключены в соответствии с Правилами проведения торгов по ценным бумагам в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ», которые являются неотъемлемой частью каждой из заключенных сделок. Участник торгов согласен с тем, что все споры и разногласия, возникающие из сделки или сделок, заключенных Участником торгов в Системе торгов, в том числе, касающиеся ее (их) исполнения, нарушения, прекращения, признания ее (их) недействительной(ыми) (ничтожной(ыми) или незаключенной(ыми), подлежат рассмотрению и разрешению в Арбитражной комиссии при ЗАО ММВБ в соответствии с документами, определяющими ее правовой статус и порядок разрешения споров,

действующими на момент подачи искового заявления. Решения Арбитражной комиссии при ЗАО ММВБ являются окончательными и обязательными для исполнения. Неисполненное добровольно решение Арбитражной комиссии при ЗАО ММВБ подлежит принудительному исполнению в соответствии с законодательством Российской Федерации или законодательством страны места принудительного исполнения и международными соглашениями.

Колонка 1 – Номер по порядку;

Колонка 2 – Номер сделки;

Колонка 3 – Время заключения сделки;

Колонка 4 – Вид сделки (В – покупка, S – продажа);

Колонка 5 – Цена одной бумаги;

Колонка 6 – Количество бумаг (шт);

Колонка 7 – Объем сделки;

Колонка 8 – Код участника торгов, краткое наименование, ИНН контрагента;

Колонка 9 – Номер торгового-клирингового счета контрагента;

Колонка 10 – Код расчетов;

Колонка 11 – Сумма комиссионного вознаграждения Биржи;

Колонка 12 – Номер заявки, на основании которой была заключена сделка;

Колонка 13 – Вид заявки, на основании которой была заключена сделка;

Колонка 14 – НКД;

Колонка 15 – Ставка РЕПО (для сделок РЕПО);

Колонка 16 – Сумма РЕПО, включая НКД;

Колонка 17 – Начальное значение дисконта, %;

Колонка 18 – Срок РЕПО, дней;

Колонка 19 – Минимальное предельное значение дисконта, %;

Колонка 20 – Максимальное предельное значение дисконта, %;

Колонка 21 – Ставка фиксированного возмещения, %;

Колонка 22 – Ссылка;

Колонка 23 – Код клиента;

Колонка 24 – Примечание.

ПРИЛОЖЕНИЕ №3

**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»**

Форма выписки из реестра заявок

День недели, дата

ФБ ММВБ

Участник торгов (Код Участника торгов)

Идентификатор Участника торгов

Режим торгов

Дата регистрации заявки

Дата и/или время активации

№ п/п	Номер заявки	Состояние	Вид заявки	Направленность	Ценная бумага	Цена	Количество	Номер торгового-клирингового счета	Контрагент (Код Участника торгов-Контрагента)	Время регистрации	Время исполнения (адр.заявки)	Время отмены	Код расчетов	НКД	Количество сделок	Ставка РЕПО	Сумма РЕПО, включая НКД	Начальное значение дисконта, %	Срок РЕПО	Минимальное предельное значение дисконта	Максимальное предельное значение дисконта	Идентификатор трейдера (АСП трейдера)	Ставка фикс.Возмещения	Ссылка	Клиент	Примечание
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27

Маклер ФБ ММВБ

(подпись)

*Подача (объявление) Участником торгов заявки (заявок) в Систему торгов в соответствии с Правилами проведения торгов по ценным бумагам в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ» означает безусловное согласие Участника торгов на то, что заявки подаются, а сделки (или сделка), которые могут быть заключены в Системе торгов на основании поданных заявок, заключаются в соответствии с Правилами проведения торгов по ценным бумагам в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ», которые являются неотъемлемой частью поданной заявки или заявки и заключенной на ее основании сделки. Участник торгов согласен с тем, что все

споры и разногласия, возникающие из заключенной в Системе торгов сделки (сделок) или в связи с ними, в том числе, касающиеся ее (их) исполнения, нарушения, прекращения, признания ее (их) недействительной(ыми) (ничтожной(ыми) или незаключенной(ыми)), подлежат разрешению в Арбитражной комиссии при ЗАО ММВБ в соответствии с документами, определяющими ее правовой статус и порядок разрешения споров, действующими на момент подачи искового заявления. Решения Арбитражной комиссии при ЗАО ММВБ являются окончательными и обязательными для исполнения. Неисполненное добровольно решение Арбитражной комиссии при ЗАО ММВБ подлежит принудительному исполнению в соответствии с законодательством Российской Федерации или законодательством страны места принудительного исполнения и международными соглашениями.

Колонка 1 - Номер по порядку;

Колонка 2 - Номер заявки в Системе торгов;

Колонка 3 - Состояние заявки (М - заявка удовлетворена, W - заявка снята Участником торгов, С - заявка снята Системой торгов, О - заявка не удовлетворена и не снята);

Колонка 4 - Вид заявки (в соответствии с п.п. 6.8 – 6.9 Раздела 6 «Заявки» Правил торгов вид заявки указывает на то, что заявка адресована конкретному Участнику торгов либо всем Участникам торгов);

Колонка 5 - Направленность заявки (покупка/продажа);

Колонка 6 - Ценная бумага;

Колонка 7 - Цена за одну ценную бумагу (или ссылка на цену, определяемую Эмитентом);

Колонка 8 - Количество ценных бумаг, выраженное в лотах;

Колонка 9 - Торгово-клиринговый счет, указанный при подаче заявки в Систему торгов

Колонка 10 - Идентификатор, код участника торгов-контрагента;

Колонка 11 - Время регистрации заявки в Системе торгов;

Колонка 12 - Время исполнения заявки;

Колонка 13 - Время снятия заявки;

Колонка 14 - Код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п.п. 1.1.14 Раздела 1 «Термины и определения» Правил торгов);

Колонка 15 - НКД.;

Колонка 16 - Количество сделок, заключенных на основании заявки;

Колонка 17 - Ставка РЕПО, %;

Колонка 18 - Сумма РЕПО, включая НКД.;

Колонка 19 - Начальное значение дисконта, %;

Колонка 20 - Срок РЕПО;

Колонка 21 - Минимальное предельное значение дисконта;

Колонка 22 - Максимальное предельное значение дисконта;

Колонка 23 - Идентификатор трейдера (АСП трейдера), подавшего заявку;

Колонка 24 - Ставка фиксированного возмещения, %;

Колонка 25 - Ссылка;

Колонка 26 - Код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг));

Колонка 27 - Примечание.

ПРИЛОЖЕНИЕ №3А

**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»**

Форма выписки из реестра полученных адресных заявок

День недели, дата

ФБ ММВБ

Участник торгов (Код Участника торгов)

Идентификатор Участника торгов

Режим торгов

Дата регистрации заявки

Дата и/или время активации

№ п/п	Номер заявки	Состояние	Вид заявки	Направленность	Ценная бумага	Цена	Количество	Контрагент (Код Участника торгов-Контрагента)	Время регистрации	Время исполнения (адр.заявки)	Время отмены	Код расчетов	НКД	Количество сделок	Ставка РЕПО	Сумма РЕПО, включая НКД	Начальное значение дисконта, %	Срок РЕПО	Минимальное предельное значение дисконта	Максимальное предельное значение дисконта	Идентификатор трейдера (АСП трейдера)	Ставка фикс.Возмещения	Ссылка	Примечание
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25

Маклер ФБ ММВБ

(подпись)

Колонка 1 - Номер по порядку;

Колонка 2 - Номер заявки в Системе торгов;

Колонка 3 - Состояние заявки (М - заявка удовлетворена, W - заявка снята Участником торгов, С - заявка снята Системой торгов, О - заявка не удовлетворена и не снята);

Колонка 4 - Вид заявки (в соответствии с п.п. 6.8 – 6.9 Раздела 6 «Заявки» Правил торгов вид заявки указывает на то, что заявка адресована конкретному Участнику торгов либо всем Участникам торгов);

Колонка 5 - Направленность заявки (покупка/продажа);

Колонка 6 - Ценная бумага;

Колонка 7 - Цена за одну ценную бумагу (или ссылка на цену, определяемую Эмитентом);

Колонка 8 - Количество ценных бумаг, выраженное в лотах;

Колонка 9 - Идентификатор, код участника торгов-контрагента;

Колонка 10 - Время регистрации заявки в Системе торгов;

Колонка 11 - Время исполнения заявки;

Колонка 12 - Время снятия заявки;

Колонка 13 - Код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п.п. 1.1.14 Раздела 1 «Термины и определения» Правил торгов);

Колонка 14 - НКД;

Колонка 15 - Количество сделок, заключенных на основании заявки;

Колонка 16 - Ставка РЕПО, %;

Колонка 17 - Сумма РЕПО, включая НКД;

Колонка 18 - Начальное значение дисконта, %;

Колонка 19 - Срок РЕПО;

Колонка 20 - Минимальное предельное значение дисконта;

Колонка 21 - Максимальное предельное значение дисконта;

Колонка 22 - Идентификатор трейдера (АСП трейдера), подавшего заявку;

Колонка 23 - Ставка фиксированного возмещения, %;

Колонка 24 - Ссылка;

Колонка 25 - Примечание

ПРИЛОЖЕНИЕ №4

**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»**

**Форма выписки по обязательствам Участника торгов по комиссионному
вознаграждению**

День недели, дата

ФБ ММВБ

Участник торгов (Код Участника торгов)

Идентификатор Участника торгов

Номер торгово-клирингового счета	Обязательство по уплате комиссии	в т.ч. НДС

Маклер ФБ ММВБ

(подпись)

ПРИЛОЖЕНИЕ №5

**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»**

Форма выписки по обязательствам Участника торгов по уплате возмещения

День недели, дата

ФБ ММВБ

Участник торгов (Код Участника торгов)

Идентификатор Участника торгов

Номер торгово- клирингового счета	Наименовани е возмещения	Обязательств о по уплате возмещения	Ставка фиксированн ого возмещения	Цена переменного возмещения	Номер сделки	Идентификат ор Участника торгов – контрагента

Маклер ФБ ММВБ

(подпись)

ПРИЛОЖЕНИЕ №6

к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»

Форма уведомления Участника торгов об отказе от возмещения по сделке с ценными
бумагами

_____ *наименование Участника торгов* _____, являющийся _____
Участником торгов на ФБ ММВБ, в лице _____, действующего на
основании _____, уведомляет ФБ ММВБ об отказе в получении _____ *переменного,*
фиксированного _____ возмещения, подлежащего уплате в соответствии с Правилами
проведения торгов по ценным бумагам в Закрытом акционерном обществе «Фондовая
биржа ММВБ» контрагентом по сделке № _____ *номер сделки* _____, заключенной _____ *дата*
_____ с _____ *наименование Участника торгов – контрагента* _____.

Руководитель Участника торгов
или иное уполномоченное лицо

(должность)

_____/_____/

(подпись) (Фамилия И.О.)

« ____ » _____ 20 ____ г.

М.П.

ПРИЛОЖЕНИЕ №7

**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»**

Форма уведомления Участника торгов о необходимости внесения компенсационного взноса

День недели, дата

ФБ ММВБ

Участник торгов (Код Участника торгов)

Идентификатор Участника торгов

Ценная бумага (торговый код)

№ п/п	Номер сделки	Дата заключения сделки	Дата внесения	Вид операции	Текущее значение дисконта	Максимальное (или минимальное) предельное значение дисконта	Сумма денежных средств (в рублях), которые необходимо внести/получить	Количество ценных бумаг (в штуках), которые необходимо внести/получит	Расчетное значение дисконта*	Расчетное значение суммы РЕПО*	Расчетное значение количества ценных бумаг по второй части сделки РЕПО*	Расчетное значение цены за одну ценную бумагу по второй части сделки РЕПО (цены выкупа)*	Торгово-клиринговый счет (указанный при подаче заявки на заключение соответствующей сделки РЕПО), с которого должна произойти поставка (выплата) компенсационного взноса	Код клиента	Код (краткое наименование) Участника торгов – контрагента по сделке РЕПО
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16

Маклер ФБ ММВБ

(подпись)

*при условии внесения компенсационного взноса

<p>Колонка 1 – Номер по порядку;</p> <p>Колонка 2 – Номер сделки РЕПО, по которой должен быть внесен/получен Компенсационный взнос, в Системе торгов;</p> <p>Колонка 3 – Дата заключения сделки РЕПО, по которой должен быть внесен/получен Компенсационный взнос;</p> <p>Колонка 4 – Дата внесения/получения Компенсационного взноса;</p> <p>Колонка 5 – Вид операции (D- списание, К – зачисление);</p> <p>Колонка 6 – Текущее значение дисконта;</p> <p>Колонка 7 – Максимальное (или минимальное) предельное значение дисконта, которое было превышено;</p> <p>Колонка 8 – Сумма денежных средств (в рублях), которые необходимо внести/получить;</p> <p>Колонка 9 – Количество ценных бумаг (в штуках), которые необходимо внести/получить;</p> <p>Колонка 10 – Расчетное значение текущего дисконта при условии внесения компенсационного взноса;</p>	<p>Колонка 11 – Расчетное значение суммы РЕПО (если он производится в денежной форме) при условии внесения компенсационного взноса;</p> <p>Колонка 12 – Расчетное значение количества ценных бумаг по второй части сделки РЕПО* (если он производится в форме ценных бумаг) при условии внесения компенсационного взноса;</p> <p>Колонка 13 – Расчетное значение цены за одну ценную бумагу по второй части сделки РЕПО (цены выкупа) при условии внесения компенсационного взноса;</p> <p>Колонка 14 – Торгово-клиринговый счет (указанный при подаче заявки на заключение соответствующей сделки РЕПО), с которого должна произойти поставка (выплата) компенсационного взноса;</p> <p>Колонка 15 – Код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг));</p> <p>Колонка 16 – Код (краткое наименование) Участника торгов – контрагента по сделке РЕПО.</p>
---	--

ПРИЛОЖЕНИЕ №7А

**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»**

Форма уведомления об изменении расчетных параметров сделки РЕПО в связи с выплатой купонного дохода и/или погашением части основного долга (проведением амортизационной выплаты) по облигациям

День недели, дата

ФБ ММВБ

Участник торгов (Код Участника торгов)

Идентификатор Участника торгов

Ценная бумага (торговый код)

№ п/п	Номер сделки	Дата заключения сделки	Дата изменения Суммы РЕПО	Величина погашенной части основного долга (амортизационной выплаты)	Размер купона	Текущее значение суммы РЕПО	Текущее значение стоимости обратного выкупа	Значение расчетных параметров сделки с учетом выплаты купонного дохода		Код клиента
								Сумма РЕПО	Стоимость обратного выкупа	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11

Маклер ФБ ММВБ

<p>Колонка 1 – Номер по порядку;</p> <p>Колонка 2 – Номер сделки РЕПО, по облигациям которой, выплачивается купонный доход;</p> <p>Колонка 3 – Дата заключения сделки РЕПО, по облигациям которой, выплачивается купонный доход;</p> <p>Колонка 4 – Дата, с которой изменяется Сумма РЕПО;</p> <p>Колонка 5 – Величина погашенной части основного долга (амортизационной выплаты), руб.;</p> <p>Колонка 6 – Размер купонного дохода, руб.;</p>	<p>Колонка 7 – Сумма РЕПО до получения купонного дохода по облигациям, в рублях;</p> <p>Колонка 8 – Стоимость обратного выкупа до получения купонного дохода по облигациям, в рублях;</p> <p>Колонка 9 – Сумма РЕПО после получения купонного дохода по облигациям, в рублях;</p> <p>Колонка 10 – Стоимость обратного выкупа после получения купонного дохода по облигациям, в рублях;</p> <p>Колонка 11 – Код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг)).</p>
--	---

ПРИЛОЖЕНИЕ №8

**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»**

Форма сводного реестра заявок

День недели, дата

ФБ ММВБ

Наименование ценной бумаги

Торговый код ценной бумаги

Наименование и идентификатор Участника торгов, которому адресованы заявки

Режим торгов

№ п/п	Номер заявки	Время регистрации	Участник торгов	Вид заявки	Направленность	Цена	Количество	Объем	Номер торгового клирингового счета	Дата и/или время активации	Код расчета	НКД	Клиент	Ссылка	Примечание	Дополнительная информация	Доходность	Итого бумаг (нарастающим итогом)	Итогообъем (объем сделок нарастающим итогом)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20

Маклер ФБ ММВБ

(подпись)

- Колонка 1 – Номер по порядку;
- Колонка 2 – Номер заявки в Системе торгов;
- Колонка 3 – Время регистрации заявки в Системе торгов;
- Колонка 4 – Идентификатор и краткое наименование Участника торгов, подавшего заявку;
- Колонка 5 – Вид заявки (в соответствии с п.п. 6.8 – 6.9. Раздела 6 «Заявки» Правил торгов вид заявки указывает на то, что заявка адресована конкретному Участнику торгов либо всем Участникам торгов);
- Колонка 6 – Направленность заявки (покупка/продажа);
- Колонка 7 – Цена за одну ценную бумагу (или ссылка на цену, определяемую Эмитентом);
- Колонка 8 – Количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- Колонка 9 – Объем заявки;
- Колонка 10 – Торгово-клиринговый счет, указанный при подаче заявки в Систему торгов;
- Колонка 11 – Срок и время активация заявки, при наступлении которого происходит проверка обеспечения в соответствии с Правилами клиринга и возможно заключение сделок на основании данной заявки;
- Колонка 12 – Код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п.п. 1.1.14 Раздела 1 «Термины и определения» Правил торгов);
- Колонка 13 – Накопленный купонный доход (для сделок с облигациями);
- Колонка 14 – Код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг));
- Колонка 15 – Ссылка;
- Колонка 16 – Примечание;
- Колонка 17 – Дополнительная информация;
- Колонка 18 – Доходность;
- Колонка 19 – Итого бумаг (нарастающим итогом);
- Колонка 20 – Итого объем (объем сделок нарастающим итогом).

ПРИЛОЖЕНИЕ №8А

**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»**

Форма сводного реестра заявок (Аукцион РЕПО)

День недели, дата, время формирования

ФБ ММВБ

Наименование ценной бумаги

Торговый код ценной бумаги

Наименование и идентификатор Участника торгов, которому адресованы заявки

Режим торгов

Дата исполнения

Ставка РЕПО, % годовых	Объем заявок, руб	Объем заявок нарастающим итогом, руб	Сумма обязательств по части сделки РЕПО, руб	Средневзвешенная ставка РЕПО, %

Итого

Количество Участников торгов

Количество заявок

Маклер ФБ ММВБ

(подпись)

ПРИЛОЖЕНИЕ №9**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»****Форматы электронных документов**

Название документа	Категория *	Формат файла	Форма электронного документа
1. Выписка из реестра сделок	“В”	Текстовый формат	Приложение № 2 к настоящим Правилам
2. Выписка из реестра заявок	“В”	Текстовый формат	Приложение № 3 к настоящим Правилам
3. Выписка из реестра полученных адресных заявок	“В”	Текстовый формат	Приложение № 3А к настоящим Правилам
4. Выписка по обязательствам Участника торгов по комиссионному вознаграждению	“В”	Текстовый формат	Приложение № 4 к настоящим Правилам
5. Выписка по обязательствам Участника торгов по уплате возмещения	“В”	Текстовый формат	Приложение № 5 к настоящим Правилам
6. Уведомление Участника торгов о необходимости внесении компенсационного взноса	“В”	Текстовый формат	Приложение № 7 к настоящим Правилам
7. Уведомление об изменении расчетных параметров сделки РЕПО в связи с выплатой купонного дохода по облигациям и/или погашением части основного долга (проведением амортизационной выплаты) по облигациям	“В”	Текстовый формат	Приложение № 7А к настоящим Правилам
8. Сводный реестр заявок	“В”	Текстовый формат	Приложение № 8 к настоящим Правилам
9. Сводный реестр заявок (Аукцион РЕПО)	“В”	Текстовый формат	Приложение № 8А к настоящим Правилам
10. Уведомление об ошибке	“В”	Текстовый формат	Приложение № 10 к настоящим Правилам

*- Понятие категории электронного документа определяется Правилами ЭДО.

ПРИЛОЖЕНИЕ №10

**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»**

Форма уведомления об ошибке

Настоящим уведомляем, что в отправленном электронном документе /название и реквизиты электронного документа/ обнаружена ошибка.

[Дополнительная информация об ошибке]

**Уполномоченное лицо организации,
отправившей электронный документ**

ПРИЛОЖЕНИЕ №11**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»****Формы заявок, подаваемые Участниками торгов в Систему торгов****Лимитная заявка**

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (лимитная заявка с сохранением или лимитная заявка без сохранения в котировках)
2	Идентификатор Участника торгов
3	Код Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении)
4	Направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу)
5	Наименование ценной бумаги
6	Количество ценных бумаг, выраженное в лотах
7	Цена за одну ценную бумагу
8	Торгово-клиринговый счет
9	Код расчетов
10	Время активации заявки (для лимитных заявок на продажу в режиме торгов «Размещение: Аукцион»)
11	Дата активации (для заявок в режимах торгов «Размещение: Аукцион», «Выкуп: Аукцион»)
12	Краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг))
13	Идентификатор трейдера (АСП трейдера)

Заявка маркет-мейкера

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (заявка маркет-мейкера)
2	Идентификатор Участника торгов
3	Код Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении)
4	Направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу)
5	Наименование ценной бумаги
6	Количество ценных бумаг, выраженное в лотах
7	Цена за одну ценную бумагу
8	Торгово-клиринговый счет

9	Код расчетов
10	Краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг))
11	Идентификатор трейдера (АСП трейдера)

Заявка послеторгового периода

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (заявка послеторгового периода)
2	Идентификатор Участника торгов
3	Код Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении)
4	Направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу)
5	Наименование ценной бумаги
6	Количество ценных бумаг, выраженное в лотах
7	Цена послеторгового периода
8	Торгово-клиринговый счет
9	Код расчетов
10	Краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг))
11	Идентификатор трейдера (АСП трейдера)

Рыночная заявка

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (рыночная заявка с указанием количества ценных бумаг или рыночная заявка с указанием объема денежных средств, предназначенных для покупки ценных бумаг)
2	Идентификатор Участника торгов
3	Код Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении)
4	Направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу)
5	Наименование ценной бумаги
6	Количество ценных бумаг, выраженное в лотах или объем денежных средств, предназначенных для покупки ценных бумаг
7	Торгово-клиринговый счет
8	Код расчетов
9	Дата активации (для заявок в режимах торгов «Размещение: Аукцион», «Выкуп: Аукцион»)

10	Краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг))
11	Идентификатор трейдера (АСП трейдера)

Безадресная заявка РПС

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (безадресная заявка РПС)
2	Идентификатор Участника торгов
3	Краткое наименование Участника торгов
4	Направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу)
5	Наименование ценной бумаги
6	Количество ценных бумаг, выраженное в лотах
7	Цена за одну ценную бумагу
8	Код расчетов
9	Идентификатор трейдера (АСП трейдера)

Адресная заявка РПС

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (адресная заявка РПС)
2	Идентификатор Участника торгов, подавшего заявку
3	Краткое наименование Участника торгов, подавшего заявку
4	Код Участника торгов, подавшего заявку (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении)
5	Краткое наименование или идентификатор Участника торгов, которому адресована заявка
6	Направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу)
7	Наименование ценной бумаги
8	Количество ценных бумаг, выраженное в лотах
9	Цена за одну ценную бумагу
10	Ставка фиксированного возмещения (процент от объема сделки для адресной заявки с кодом расчетов В0-В05, В06-В30)
11	Торгово-клиринговый счет
12	Код расчетов
13	Краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг))
14	Идентификатор трейдера (АСП трейдера)

Безадресная заявка в режиме торгов «РЕПО с акциями»

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (безадресная заявка РЕПО (акции))
2	Идентификатор Участника торгов, подавшего заявку
3	Краткое наименование Участника торгов, подавшего заявку
4	Направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу по первой части сделки РЕПО)
5	Наименование ценной бумаги
6	Количество ценных бумаг, выраженное в лотах
7	Ставка РЕПО
8	Сумма РЕПО
9	Начальное значение дисконта
10	Срок РЕПО
11	Код расчетов
12	Идентификатор трейдера (АСП трейдера)

Адресная заявка в режиме торгов «РЕПО с акциями»

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (адресная заявка РЕПО (акции))
2	Идентификатор Участника торгов, подавшего заявку
3	Краткое наименование Участника торгов, подавшего заявку
4	Код Участника торгов, подавшего заявку (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении)
5	Краткое наименование или идентификатор Участника торгов, которому адресована заявка
6	Направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу по первой части сделки РЕПО)
7	Наименование ценной бумаги
8	Количество ценных бумаг, выраженное в лотах
9	Ставка РЕПО
10	Сумма РЕПО (в рублях)
11	Начальное значение дисконта
12	Срок РЕПО
13	Ставка фиксированного возмещения (процент от объема сделки)
14	Предельное максимальное значение дисконта
15	Предельное минимальное значение дисконта
16	Торгово-клиринговый счет
17	Код расчетов

18	Краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг))
19	Идентификатор трейдера (АСП трейдера)

Безадресная заявка в режиме торгов «РЕПО с облигациями»

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (безадресная заявка РЕПО (облигации))
2	Идентификатор Участника торгов, подавшего заявку
3	Краткое наименование Участника торгов, подавшего заявку
4	Направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу по первой части сделки РЕПО)
5	Наименование ценной бумаги
6	Количество ценных бумаг, выраженное в лотах
7	Ставка РЕПО
8	Сумма РЕПО
9	Начальное значение дисконта
10	Срок РЕПО
11	Код расчетов
12	Идентификатор трейдера (АСП трейдера)

Адресная заявка в режиме торгов «РЕПО с облигациями»

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (адресная заявка РЕПО (облигации))
2	Идентификатор Участника торгов, подавшего заявку
3	Краткое наименование Участника торгов, подавшего заявку
4	Код Участника торгов, подавшего заявку (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении)
5	Краткое наименование или идентификатор Участника торгов, которому адресована заявка
6	Направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу по первой части сделки РЕПО)
7	Наименование ценной бумаги
8	Количество ценных бумаг, выраженное в лотах
9	Ставка РЕПО
10	Сумма РЕПО, включая НКД
11	Начальное значение дисконта
12	Срок РЕПО
13	Ставка фиксированного возмещения (процент от объема сделки)

14	Предельное максимальное значение дисконта
15	Предельное минимальное значение дисконта
16	Торгово-клиринговый счет
17	Код расчетов
18	Краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг))
19	Идентификатор трейдера (АСП трейдера)

Безадресная заявка на заключение сделок в режиме «Размещение: Адресные заявки»

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (безадресная заявка режима «Размещение: Адресные заявки»)
2	Идентификатор Участника торгов
3	Краткое наименование Участника торгов
4	Направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу)
5	Наименование ценной бумаги
6	Количество ценных бумаг, выраженное в лотах
7	Цена за одну ценную бумагу
8	Код расчетов
9	Идентификатор трейдера (АСП трейдера)

Адресная заявка на заключение сделок в режиме «Размещение: Адресные заявки»

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (адресная заявка режима «Размещение: Адресные заявки»)
2	Идентификатор Участника торгов, подавшего заявку
3	Краткое наименование Участника торгов, подавшего заявку
4	Код Участника торгов, подавшего заявку (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении)
5	Краткое наименование или идентификатор Участника торгов, которому адресована заявка
6	Направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу)
7	Наименование ценной бумаги
8	Количество ценных бумаг, выраженное в лотах
9	Цена за одну ценную бумагу (или «по цене контрагента»)
10	Торгово-клиринговый счет
11	Ссылка
12	Код расчетов
13	Краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг))

	числе эмитентов ценных бумаг))
14	Дата активации заявки
15	Идентификатор трейдера (АСП трейдера)

Безадресная заявка на заключение сделок в режиме «Выкуп: Адресные заявки»

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (безадресная заявка режима «Выкуп: Адресные заявки»)
2	Идентификатор Участника торгов
3	Краткое наименование Участника торгов
4	Направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу)
5	Наименование ценной бумаги
6	Количество ценных бумаг, выраженное в лотах
7	Цена за одну ценную бумагу
8	Код расчетов
9	Идентификатор трейдера (АСП трейдера)

Адресная заявка на заключение сделок в режиме «Выкуп: Адресные заявки»

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (адресная заявка режима «Выкуп: Адресные заявки»)
2	Идентификатор Участника торгов, подавшего заявку
3	Краткое наименование Участника торгов, подавшего заявку
4	Код Участника торгов, подавшего заявку (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении)
5	Краткое наименование или идентификатор Участника торгов, которому адресована заявка
6	Направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу)
7	Наименование ценной бумаги
8	Количество ценных бумаг, выраженное в лотах
9	Цена за одну ценную бумагу (или «по цене контрагента»)
10	Торгово-клиринговый счет
11	Ссылка
12	Код расчетов
13	Краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени, по поручению и за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг))
14	Дата активации заявки
15	Идентификатор трейдера (АСП трейдера)

ПРИЛОЖЕНИЕ №12

**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»**

На бланке организации

Список уполномоченных лиц № _____

г. _____

“ ____ ” _____ 200_г.

(наименование организации - Участника торгов на ФБ ММВБ)

в лице _____

(занимаемая должность лица, Ф.И.О.)

действующе ___ на основании _____

уполномочивает получать отчетные документы, составляемые в соответствии с
Правилами проведения торгов по ценным бумагам в Закрытом акционерном обществе
«Фондовая биржа ММВБ», следующих лиц:

ФИО	Паспортные данные	Образец личной подписи

Подписи вышеуказанных лиц удостоверяю.

Срок действия полномочий _____.

Контактные телефоны: _____.

Руководитель _____

ПРИЛОЖЕНИЕ №13

к Правилам проведения торгов по ценным бумагам в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»

ТАБЛИЦА КРИТЕРИЕВ НЕСТАНДАРТНЫХ СДЕЛОК

Содержание данного приложения не раскрывается в соответствии с требованием пункта 7.2. Раздела VII «Раскрытие и предоставление информации организатором торговли» Положения о деятельности по организации торговли на рынке ценных бумаг, утвержденного Приказом Федеральной службы по финансовым рынкам от 9 октября 2007 г. № 07-102/пз-н.

**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»**

Процедура урегулирования взаимных требований по сделкам РЕПО

1. Урегулирование вопросов, связанных с выплатой доходов по ценным бумагам.

1.1. В случае неисполнения эмитентом своих обязательств по выплате доходов (процентного или купонного дохода, частичного погашения части основного долга) по облигациям, являющимся предметом сделки РЕПО, Участник торгов - покупатель по первой части сделки РЕПО имеет право на получение средств, уменьшивших Сумму РЕПО. Данное право может быть реализовано путем направления соответствующего заявления Участнику торгов - продавцу по первой части сделки РЕПО. Возврат (выплата) доходов Участниками торгов – сторонами по сделке РЕПО осуществляется в следующем порядке:

1.1.1. Участник торгов - продавец по первой части сделки РЕПО осуществляет возврат доходов в срок не позднее 10 (Десяти) рабочих дней со дня получения им соответствующего письменного заявления от Участника торгов - покупателя по первой части сделки РЕПО.

1.1.2. В случае выплаты указанных доходов эмитентом после того, как они были перечислены Участником торгов - продавцом по первой части сделки РЕПО Участнику торгов - покупателю по первой части сделки РЕПО, Участник торгов - покупатель по первой части сделки РЕПО в срок не позднее 3 (Трёх) рабочих дней с даты получения доходов от эмитента обязан возвратить полученные доходы Участнику торгов - продавцу по первой части сделки РЕПО.

1.2. В случае получения Участником торгов - покупателем по первой части сделки РЕПО дивидендов, начисления акций, иных выплат в виде денежных средств или другого имущества Участник торгов - продавец по первой части сделки РЕПО имеет право на их получение при условии надлежащего исполнения им обязательств по второй части сделки РЕПО. Данное право может быть реализовано путем направления соответствующего заявления Участнику торгов - покупателю по первой части сделки РЕПО.

Участник торгов - покупатель по первой части сделки РЕПО осуществляет возврат доходов, полученных в денежной форме, в срок не позднее 10 (Десяти) рабочих дней со дня получения им соответствующего письменного заявления от Участника торгов - продавца по первой части сделки РЕПО. Порядок и сроки передачи иного имущества определяются в заявлении.

1.3. В случае ненадлежащего исполнения Участником торгов требований, предусмотренных в п.п. 1.1 - 1.2 настоящего Приложения №14 к Правилам, Участник торгов обязан уплатить контрагенту по сделке РЕПО неустойку в размере двойной ставки рефинансирования Банка России, действующей на день неисполнения указанных требований, начисленной на сумму подлежащих возврату (выплате) доходов за каждый день просрочки их возврата(выплаты).

2. Урегулирование вопросов, связанных с неисполнением обязательств по второй части сделок РЕПО.

2.1. В случае неисполнения Участником торгов обязательств по второй части сделки РЕПО другой Участник торгов вправе по своему выбору:

2.1.1. Требовать от Участника торгов – контрагента по сделке исполнения им своих обязательств. Процедура урегулирования, предусмотренная в п.п. 2.2 настоящего пункта Приложения №14 к Правилам, в этом случае не проводится.

2.1.2. Уведомить Участника торгов - контрагента по сделке об одностороннем отказе от дальнейшего исполнения сделки РЕПО. Процедура урегулирования, предусмотренная в п.п. 2.2 настоящего пункта Приложения №14 к Правилам, в этом случае не проводится.

2.1.3. Провести процедуру урегулирования взаимных требований в порядке, предусмотренном в п.п. 2.2 настоящего пункта Приложения №14 к Правилам.

2.2. В случае принятия Участником торгов, исполнившим обязательства по второй части сделки РЕПО, решения о проведении процедуры урегулирования взаимных требований в связи с неисполнением Участником торгов - контрагентом обязательств по второй части сделки РЕПО (согласно п.п. 2.1.3 настоящего пункта Приложения №14 к Правилам), данный Участник торгов в течение 25 (Двадцати пяти) календарных дней с даты надлежащего исполнения сделки РЕПО направляет Участнику торгов, исполнившему обязательства, уведомление о принятом решении в отношении порядка прекращения обязательств по неисполненной сделке РЕПО, содержащее информацию о размере обязательств, возникших в результате неисполнения второй части сделки РЕПО (далее - остаточные обязательства по сделке РЕПО), включая расчет их суммы.

При этом Участник торгов, исполнивший обязательства по второй части сделки РЕПО, вправе:

2.2.1. Отказаться от продажи/покупки ценных бумаг, полученных /переданных по первой части сделки РЕПО от Участника торгов, не исполнившего обязательства по второй части сделки РЕПО, и осуществить расчет суммы остаточных обязательств путем определения разницы между стоимостью обратного выкупа по сделке РЕПО (с учетом полученных (уплаченных) в течение Срока РЕПО компенсационных взносов и выплат от

эмитента, учитываемых в расчете стоимости обратного выкупа по сделке РЕПО) и стоимостью ценных бумаг по сделке РЕПО, определенной по расчетной цене ценных бумаг на Дату надлежащего исполнения второй части сделки РЕПО, либо, при её отсутствии – на дату ближайших торгов, состоявшихся в течение последних 12 месяцев до даты надлежащего исполнения второй части данной сделки РЕПО;

или

2.2.2. Начиная со второго рабочего дня с даты надлежащего исполнения второй части сделки РЕПО, но в срок, не превышающий 25 (Двадцати пяти) календарных дней с даты надлежащего исполнения второй части сделки РЕПО - осуществить следующие действия:

- Осуществить продажу в полном объеме ценных бумаг, полученных по первой части сделки РЕПО от Участника торгов, не исполнившего обязательства по второй части сделки РЕПО или покупку в полном объеме ценных бумаг, переданных по первой части сделки РЕПО Участнику торгов, не исполнившему обязательства по второй части сделки РЕПО.

- Осуществить расчет суммы остаточных обязательств по сделке РЕПО путем определения разницы между стоимостью обратного выкупа по сделке РЕПО (с учетом полученных (уплаченных) в течение Срока РЕПО компенсационных взносов и выплат от эмитента, учитываемых в расчете стоимости обратного выкупа по сделке РЕПО), и объемами заключенных сделок с учетом расходов на их осуществление.

2.2.3. Сумма остаточных обязательств по сделке РЕПО должна быть перечислена соответствующим Участником торгов, являющимся стороной по неисполненной сделке РЕПО, в течение 30 (Тридцати) календарных дней с даты надлежащего исполнения второй части сделки РЕПО.

2.2.4. Обязательства по уплате суммы, составляющей остаточные обязательства по сделке РЕПО, прекращаются с момента зачисления на счет Участника торгов - получателя суммы остаточных обязательств по сделке РЕПО в полном объеме.

2.2.5. В сумму остаточных обязательств по сделке РЕПО не включаются переменное и фиксированное возмещение.

3. Урегулирование вопросов, связанных с выплатой доходов по ценным бумагам и неисполнением обязательств по второй части сделок РЕПО в случае возникновения обстоятельств непреодолимой силы.

3.1. В случае возникновения обстоятельств непреодолимой силы (чрезвычайные и непредотвратимые обстоятельства, возникающие после наступления даты надлежащего исполнения сделок), влияющих на способность выполнения Участником торгов требований, предусмотренных в пунктах 1, 2 настоящего Приложения №14 к Правилам,

Участник торгов обязан проинформировать контрагента по сделке об их наступлении и прекращении в день их наступления и прекращения (в первый следующий рабочий день в случае их наступления и прекращения в нерабочий день) путем направления уведомления в письменной форме с приложением документов, подтверждающих наступление/прекращение таких обстоятельств, выданных компетентными государственными органами.

3.2. В качестве обстоятельств непреодолимой силы не могут рассматриваться аннулирование/приостановка лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг, отзыв лицензии на осуществление банковских операций, назначение временной администрации или возбуждения процедуры банкротства.

3.3. Неисполнение требования, предусмотренного подпунктом п.3.1. настоящего пункта Приложения №14 к Правилам, лишает Участника торгов, нарушившего данное требование, права ссылаться на обстоятельства непреодолимой силы

3.4. После прекращения действия обстоятельств непреодолимой силы Участники торгов обязаны исполнить требования, предусмотренные в пунктах 1, 2 настоящего Приложения №14 к Правилам.

В случае если обстоятельства непреодолимой силы действуют только в отношении одного из Участников торгов и длятся более 10 (Десяти) рабочих дней, другой Участник торгов вправе отказаться от дальнейшего исполнения сделки/сделок РЕПО.

**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»**

Методика расчета текущих цен ценных бумаг

1. Общие положения

1.1. Настоящая Методика определяет правила и порядок расчета Биржей текущих цен ценных бумаг, требования к которым установлены нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг.

1.2. Текущие цены ценных бумаг рассчитываются по всем ценным бумагам, допущенным к торгам на Бирже.

1.3. Текущие цены ценных бумаг, включенных в котировальный список "А" и в список ценных бумаг для расчета Индекса ММВБ, рассчитываются для целей приостановки торгов в случаях, установленных нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

2. Порядок расчета текущих цен ценных бумаг

2.1. Текущая цена ценной бумаги рассчитывается не реже одного раза в минуту в течение времени проведения торгов в режимах торгов, проводимых на основании заявок, адресованных всем участникам торгов (далее – безадресные заявки), начиная с десятой минуты после начала проведения торгов в соответствующем режиме торгов.

2.2. Текущая цена ценной бумаги рассчитывается как средневзвешенная цена данной ценной бумаги за предшествующие моменту расчета десять минут в режимах торгов, проводимых на основании безадресных заявок, отдельно по каждому режиму торгов.

2.3. В случае отсутствия в течение последней минуты торгов сделок, совершенных на основании безадресных заявок, текущая цена ценной бумаги принимается равной последней рассчитанной текущей цене данной ценной бумаги.

2.4. Ценой закрытия ценной бумаги за определенный торговый день является последняя рассчитанная текущая цена данной ценной бумаги в соответствующем режиме торгов.