ЗАКРЫТОЕ АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО
«Фондовая биржа ММВБ»
(ЗАО «ФБ ММВБ»)

Большой Кисловский пер., 13,
Москва, Россия, 125009
Тел. (495) 363-32-32, факс (495) 234-48-40
E-mail: fbinfo@micex.ru; www.micex.ru
ОКПО 71341319, ОГРН 1037789012414
ИНН/КПП 7703507076/775001001

04.12.2012 № 31-14/2217

На № _____ от _____

Руководителю фондового подразделения
Участника торгов ЗАО «ФБ ММВБ»

Информируем Вас о том, что в с п. 2.1.13 Правил проведения торгов по ценным бумагам в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ», утвержденных Советом директоров ЗАО «ФБ ММВБ» 26 октября 2012 г. (Протокол № 8), Распоряжением ЗАО «ФБ ММВБ» определено, что с 05 декабря 2012 года:

1. По ценным бумагам, эмитентом или Генеральным агентом по которым является Банк России (за исключением облигации федерального займа выпуска № 48001RMFS от 17.11.2004), допускается подача лимитных (конкурентных) заявок с указанием цены, рассчитанной на основе показателя доходности.
2. Установить порядок расчета доходности для заявок, подаваемых в соответствии с п.1 настоящего Распоряжения:

$$P + A = \sum_{j=1}^{n} \frac{C_j}{(1 + \frac{Y}{100})^{\frac{t_j}{365}}} + \sum_{j=1}^{m} \frac{N_j}{(1 + \frac{Y}{100})^{\frac{t_j}{365}}}$$

P - цена облигации;
A - накопленный купонный доход;
Y - эффективная доходность к погашению;
ti - число дней до выплаты i-го купона;
Ci - величина i-го купона;
n - количество купонов;
tj - срок до j-й выплаты номинальной стоимости;
Nj - размер j-й выплаты номинальной стоимости облигации;
m - количество платежей по основной сумме долга.

$$A = \frac{Ci}{T} * (T1 - t1)$$

Ci - величина текущего купона;
T - срок до погашения облигации;
Ti - длительность купонного периода в днях;
t1 - число дней до выплаты ближайшего купона.

$$Ci = \frac{ri}{100} * \frac{N}{365} * Ti$$

N - номинальная стоимость облигации/непогашенная часть номинальной стоимости облигации;
ri - размер купонной ставки;
Ti - длительность купонного периода в днях.

С уважением,

Заместитель
Генерального директора А.В.Кузнецова