

Программа маркет-мейкинга выходного дня

Раздел I. Термины и определения

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

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

Пассивная сделка - сделка Маркет-мейкера, в реквизитах которой номер заявки Маркет-мейкера меньше номера Встречной заявки;

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

Программа – Программа маркет-мейкинга выходного дня.

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

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

Раздел II. Параметры и условия выполнения обязательств Маркет-мейкера

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

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

2.3. Маркет-мейкер считается исполнившим в течение Торгового дня обязательства, указанные в пункте 2.2. настоящей Программы, только в случае если Маркет-мейкер выполнил обязательства в данном Торговом дне по не менее 1% Инструментам от общего количества Инструментов, включенных в Программу, при условии выполнения им в отношении каждого из этих Инструмента(-ов) одновременно во всех временных интервалах, указанных в столбце 3 Таблицы и для которых установлены все значения параметров исполнения обязательств Маркет-мейкера, хотя бы одного из следующих условий:

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

- выполнение обязательств, указанных в столбце 6 Таблицы.

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

2.4. Минимально допустимое количество Торговых дней Отчетного периода, в течение которых Маркет-мейкер должен исполнять обязательства согласно пункту 2.3. настоящей Программы, определяется как 1% от количества Торговых дней Отчетного периода. В случае нарушения данного условия в определенном Отчетном периоде, услуги Маркет-мейкера по настоящей Программе в таком Отчетном периоде считаются не оказанными.

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

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

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

$$F = \sum_n \sum_k \sum_i (1000 + FIX_i^k * K_i + MIN[0,0001 * V_i^k * R_i; 6000]),$$

где

F – размер вознаграждения Маркет-мейкера за Отчетный период;

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

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

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

$FIX_i^k = \left\{ MIN \left[\frac{1600}{N}; 400 \right] \right\}$ руб., где

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

K_i – коэффициент ликвидности i -го Инструмента, определяемый из Таблицы Приложения 1;

V_i^k - Объем пассивных сделок, заключенных Маркет-мейкером по i -ому Инструменту в k -й Торговый день с использование n -ого Идентификатора на основании заявок с объемом не менее Минимального размера заявки, установленного для соответствующего временного интервала Торгового дня. При расчете совокупного объема пассивных сделок для целей расчета вознаграждения Маркет-мейкера не учитываются сделки, совершенные на основании заявок Маркет-мейкера и Встречных заявок, поданных за счет одного и того же Маркет-мейкера или Клиента

R_i – коэффициент ликвидности i -го Инструмента, определяемый из Таблицы Приложения 1.

Раздел IV. Условия подключения Идентификаторов к Программе

4.1. К Программе допускаются Идентификаторы, по которым в течение 3 календарных месяцев, предшествующих дате подачи Уведомления о присоединении к Программе, Биржей зафиксирован среднедневной объем торгов (ADTV) всеми акциями и депозитарными расписками в размере 300 млн рублей. Биржей могут быть допущены к Программе 3 Идентификатора без

выше указанного требования по размеру ADTV. В случае выбытия из Программы Идентификатора, допущенного без учета требования к ADTV, на его место Биржей может быть допущен другой Идентификатор без учета требования к ADTV.

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

4.3. Общее количество Идентификаторов, допущенных в Программу, может быть не более 10 (десяти). От одного Участника торгов в Программу может быть допущено не более 3 (трех) Идентификаторов. Биржа принимает решение о допуске нового Идентификатора в Программу на основании Уведомлений, которые рассматриваются в порядке их поступления на Биржу.

Таблица параметров исполнения обязательств Маркет-мейкера

№	Торговый код Инструмента	Временной интервал Торгового дня	Объем двусторонней котировки*, шт.	Спрэд двусторонней котировки, %	Достаточный объем*, шт.	Период поддержания котировок**, мин.	Минимальный размер заявки*, шт.	Кэф-нт Ki	Кэф-нт Ri
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
1	AFKS	10:00:00-18:59:59	50 000	0,75	50 000 000	400	5 000	1	1
2	AFLT	10:00:00-18:59:59	10 000	0,50	10 000 000	400	1 000	1	1
3	ALRS	10:00:00-18:59:59	10 000	0,50	10 000 000	400	1 000	1	1
4	ASTR	10:00:00-18:59:59	400	0,70	400 000	400	40	1	1
5	BSPB	10:00:00-18:59:59	2 000	0,90	2 000 000	400	200	1	1
6	CBOM	10:00:00-18:59:59	30 000	1,80	30 000 000	400	3 000	1	1
7	CHMF	10:00:00-18:59:59	500	0,50	500 000	400	50	1	1
8	ELMT	10:00:00-18:59:59	2 000 000	1,20	2 000 000 000	400	200 000	1	1
9	ENPG	10:00:00-18:59:59	800	1,30	800 000	400	80	1	1
10	FEES	10:00:00-18:59:59	4 000 000	1,40	4 000 000 000	400	400 000	1	1
11	FLOT	10:00:00-18:59:59	3 700	0,90	3 700 000	400	370	1	1
12	GAZP	10:00:00-18:59:59	9 000	0,30	9 000 000	400	900	1	1
13	GMKN	10:00:00-18:59:59	7 500	0,45	7 500 000	400	750	1	1
14	HEAD	10:00:00-18:59:59	200	0,70	200 000	400	20	1	1
15	HYDR	10:00:00-18:59:59	540 000	1,10	540 000 000	400	54 000	1	1
16	IRAO	10:00:00-18:59:59	70 000	0,40	70 000 000	400	7 000	1	1
17	LEAS	10:00:00-18:59:59	300	1,40	300 000	400	30	1	1
18	LKOH	10:00:00-18:59:59	200	0,30	200 000	400	20	1	1
19	MAGN	10:00:00-18:59:59	9 000	0,5	9 000 000	400	900	1	1
20	MGNT	10:00:00-18:59:59	200	0,60	200 000	400	20	1	1
21	MOEX	10:00:00-18:59:59	3 500	0,30	3 500 000	400	350	1	1
22	MSNG	10:00:00-18:59:59	110 000	2,30	110 000 000	400	11 000	1	1
23	MTLR	10:00:00-18:59:59	3 000	0,50	3 000 000	400	300	1	1
24	MTLRP	10:00:00-18:59:59	3 000	1,50	3 000 000	400	300	1	1
25	MTSS	10:00:00-18:59:59	3 500	0,60	3 500 000	400	350	1	1
26	NLMK	10:00:00-18:59:59	5 500	0,60	5 500 000	400	550	1	1
27	NVTK	10:00:00-18:59:59	600	0,40	600 000	400	60	1	1
28	PHOR	10:00:00-18:59:59	100	0,80	100 000	400	10	1	1
29	PIKK	10:00:00-18:59:59	750	1,30	750 000	400	75	1	1
30	PLZL	10:00:00-18:59:59	100	0,50	100 000	400	10	1	1
31	POSI	10:00:00-18:59:59	200	0,80	200 000	400	20	1	1
32	ROSN	10:00:00-18:59:59	1 000	0,25	1 000 000	400	100	1	1
33	RTKM	10:00:00-18:59:59	5 000	1,10	5 000 000	400	500	1	1
34	RUAL	10:00:00-18:59:59	13 000	0,70	13 000 000	400	1 300	1	1
35	SBER	10:00:00-18:59:59	6 000	0,20	6 000 000	400	600	1	1
36	SBERP	10:00:00-18:59:59	3 000	0,30	3 000 000	400	300	1	1
37	SELG	10:00:00-18:59:59	5 000	1,40	5 000 000	400	500	1	1
38	SGZH	10:00:00-18:59:59	150 000	1,10	150 000 000	400	15 000	1	1
39	SMLT	10:00:00-18:59:59	300	0,80	300 000	400	30	1	1
40	SNGS	10:00:00-18:59:59	40 000	0,80	40 000 000	400	4 000	1	1
41	SNGSP	10:00:00-18:59:59	15 000	0,30	15 000 000	400	1 500	1	1
42	SPBE	10:00:00-18:59:59	2 500	0,80	2 500 000	400	250	1	1
43	SVCB	10:00:00-18:59:59	30 000	1,20	30 000 000	400	3 000	1	1
44	T	10:00:00-18:59:59	600	0,20	600 000	400	60	1	1
45	TATN	10:00:00-18:59:59	900	0,40	900 000	400	90	1	1
46	TATNP	10:00:00-18:59:59	500	0,50	500 000	400	50	1	1
47	TRNFP	10:00:00-18:59:59	500	0,60	500 000	400	50	1	1
48	UGLD	10:00:00-18:59:59	470 000	0,80	470 000 000	400	47 000	1	1
49	UPRO	10:00:00-18:59:59	285 000	1,10	285 000 000	400	28 500	1	1
50	VKCO	10:00:00-18:59:59	1 300	0,70	1 300 000	400	130	1	1
51	VTBR	10:00:00-18:59:59	4 800	0,30	4 800 000	400	480	1	1
52	X5	10:00:00-18:59:59	200	0,80	200 000	400	20	1	1
53	YDEX	10:00:00-18:59:59	300	0,50	300 000	400	30	1	1

*С даты вступления в силу нового значения количества акций после завершения эмитентом процедуры дробления или консолидации ценной бумаги Объем двусторонней котировки, Достаточный объем и Минимальный размер заявки увеличиваются или уменьшаются, соответственно, в М раз, где М – реализованный коэффициент дробления или консолидации.

** В случае изменения расписания проведения торгов Период поддержания двусторонних котировок пропорционально корректируется в соответствии с таким изменением.