

ПРОГРАММА МАРКЕТ-МЕЙКИНГА «ОФЗ СNY»

Раздел I. Термины и определения

Программа – Программа маркет-мейкинга «ОФЗ СNY» по поддержанию цен или спроса Инструмента, реализуемая в Режиме торгов «Режим основных торгов Т+» Секции фондового рынка Биржи с целью повышения ликвидности по группе ценных бумаг.

Инструмент(-ы) – выпуск(-и) ценных бумаг, указанный(-ые) в Приложении №1 к настоящей Программе.

Договор – Договор об оказании услуг Маркет-мейкера, форма которого предусмотрена в Приложении № 1 к Правилам оказания услуг Маркет-мейкера в Секции фондового рынка ПАО Московская Биржа (далее – Биржа).

Маркет-мейкер – Участник торгов, заключивший с Биржей Договор об оказании услуг Маркет-мейкера.

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

Минимальный допустимый объем подаваемых заявок Маркет-мейкера (далее - МДО).

Достаточный объем (далее - ДО) – суммарный объем сделок Маркет-мейкера, заключенных по любому из Инструментов на основании заявок Маркет-мейкера в течение Торгового дня (Торговой сессии), при достижении которого Маркет-мейкер освобождается от указанных в Таблице к настоящей Программе обязательств в отношении этого Инструмента в данный Торговый день.

Максимальная цена заявки на покупку – наивысшая допустимая цена заявки Маркет-мейкера на покупку по Инструменту в рамках исполнения обязательств по поддержанию спроса.

Период поддержания котировок – период времени, в течение которого Маркет-мейкер обязан поддерживать цену или спрос по Инструменту(-ам) в соответствии с условиями Программы.

Предельный спред двусторонней котировки – определенная в процентах разница максимальной цены Заявки Маркет-мейкера на продажу, при которой суммарное количество ценных бумаг в этих заявках, рассчитанное нарастающим итогом в порядке возрастания цены, составляет величину, не меньшую МДО, и минимальной цены Заявки Маркет-мейкера на покупку, при которой суммарное количество ценных бумаг в этих заявках, рассчитанное нарастающим итогом в порядке убывания цены, составляет величину, не меньшую МДО.

Термины, не определенные в настоящей Программе, используются в значениях, установленных Правилами оказания услуг Маркет-мейкера в Секции фондового рынка ПАО Московская Биржа.

Раздел II. Параметры и условия выполнения обязательств Маркет-мейкера

2.1 Заключение Договора об оказании услуг Маркет-мейкера осуществляется путем присоединения к Правилам оказания услуг Маркет-мейкера в Секции фондового рынка ПАО Московская Биржа, определяющим условия Договора.

2.2 Маркет-мейкер, присоединившийся к настоящей Программе, обязан в соответствии с заключенным Договором выполнять обязательства, направленные на поддержание цен или спроса Инструмента в соответствии с требованиями, предъявляемыми к Предельному спреду двухсторонней котировки или Максимальной цене заявки(-ок) на покупку, Минимально допустимому объему (МДО) и Периоду поддержания котировок, в Режиме торгов «Режим основных торгов Т+» Секции фондового Биржи с расчетами в российских рублях в течение Основной торговой сессии.¹

2.3 По каждому из Инструментов устанавливаются значения параметров исполнения обязательств Маркет-мейкера, приведенные в Приложении №1 к настоящей Программе.

2.4 Маркет-мейкер считается исполнившим в течение Торгового дня обязательства, указанные в пункте 2.3 настоящей Программы, только в случае если Маркет-мейкер выполнил обязательства в данный Торговый день по не менее, чем 1 (одному) Инструменту от общего количества Инструментов, включенных в Программу, при условии выполнения им в отношении Инструмента или каждого из этих Инструментов хотя бы одного из следующих условий:

- соблюдение в течение периода, указанного в столбце 9 Приложения №1 к настоящей Программе, параметров обязательств, указанных в столбцах 5 и 7 или 6 и 7;
- достижение объема торгов, указанных в столбце 8 Приложения №1 к настоящей Программе. При этом требования к минимальному объему сделок Маркет-мейкера отсутствуют.

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

2.5 Маркет-мейкер, выполняющий обязательства по настоящей Программе, должен соответствовать одновременно следующим требованиям:

- отсутствие факта подачи в арбитражный суд заявления о признании его несостоятельным (банкротом);
- отсутствие в ЕГРЮЛ записи о недостоверности содержащихся в ЕГРЮЛ сведений о нем.

2.6 В случае возникновения обстоятельств, повлекших несоответствие Маркет-мейкера требованиям, указанным в пункте 2.5 настоящей Программы, Маркет-мейкер обязан незамедлительно информировать Биржу о возникновении таких обстоятельств путём направления Бирже соответствующего уведомления в бумажной форме или посредством направления электронного документа в соответствии с правилами электронного документооборота Биржи.

2.7 Несоответствие Маркет-мейкера требованиям пункта 2.5 настоящей Программы и (или) нарушение Маркет-мейкером требований пункта 2.6 настоящей Программы являются основанием для немедленного прекращения Договора.

¹ Временной интервал Основной торговой сессии: с 10:00:00 до 18:49:59.

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, в отношении каждого Инструмента рассчитывается по следующей формуле:

$$F = F_{fix} + 1,5 * \sum R_i V_i$$

где:

F - размер вознаграждения Маркет-мейкера в отношении каждого Инструмента;

F_{fix} - 100,00 руб. (Сто рублей 00 копеек);

R_i - 0,00015;

V_i – объем сделок в рублях РФ, определяемый как объем всех сделок по Инструменту на дату i , совершенных Маркет-мейкером по заявкам, поданным для выполнения обязательств по Программе в течение Отчетного периода, за который рассчитывается вознаграждение Маркет-мейкера.

3.2 Размер вознаграждения Маркет-мейкера (F) за выполнение им в течение Отчетного периода условий, предусмотренных настоящей Программой, в отношении каждого Инструмента не может превышать 1 500 000,00 рублей (Один миллион пятьсот тысяч рублей 00 копеек).

Раздел IV. Условия подключения Идентификаторов к Программе

4.1 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.

4.2 Указание Краткого кода клиента (ККК) является необходимым условием для подачи Заявок Маркет-мейкера за счет клиента Участника торгов по поручению такого клиента и на основании договора, заключенного между таким клиентом и Участником торгов, осуществляющим обязательства Маркет-мейкера по Программе.

4.3 Если Маркет-мейкер исключил Идентификатор из Программы или отменил регистрацию клиента с таким Идентификатором из торгов, и данный Идентификатор являлся единственным, по которому Маркет-мейкер осуществлял обязательства по Программе, то действие Договора, в части обязательств по Программе, прекращается с даты исключения такого Идентификатора.

№	Торговый код Инструмента	Краткое наименование Инструмента	Дата погашения	Предельный спред двусторонней котировки, %	Максимальная цена заявки на покупку	МДО, шт.	ДО, шт.	Период поддержания котировок, мин.	Минимальный объём сделок Маркет-мейкера за торговый день, руб ² .
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
1	RU000A10DQB6	ОФЗ CNY-ПД 2029	28.02.2029	2,00	200	50	350	345	0
2	RU000A10DQA8	ОФЗ CNY-ПД 2033	01.06.2033	2,50	200	50	350	345	0

² Требования к минимальному объему сделок Маркет-мейкера отсутствуют