

Центральный Банк
Российской Федерации (Банк России)
ЗАРЕГИСТРИРОВАНО

Дата 27 мар 2014

00-1186

УТВЕРЖДЕНЫ

Советом директоров

ЗАО «ФБ ММВБ»

«28» апреля 2014 г. Протокол № 25

Председатель Совета директоров

А.В. Шеметов



ПРАВИЛА

проведения торгов по ценным бумагам

в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»

Раздел 1 Общие положения

Подраздел 1.1. Термины и определения

Подраздел 1.2. Общие положения

Подраздел 1.3. Расписание предоставления услуг

Подраздел 1.4. Допуск к участию в торгах. Торговые идентификаторы.

Подраздел 1.5. Маклер

Подраздел 1.6. Маркет-мейкеры

Подраздел 1.7. Шаг цены и шаг Ставки РЕПО

Подраздел 1.8. Стандартный лот

Подраздел 1.9. Правила предотвращения, выявления и пресечения случаев неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком, а также меры по предотвращению дестабилизации рынка

Подраздел 1.10. Индексы

Подраздел 1.11. Уплата комиссионного вознаграждения

Подраздел 1.12. Порядок приостановления, прекращения и возобновления торгов

Подраздел 1.13. Контроль за соблюдением Участниками торгов Правил проведения торгов и использованием биржевой информации

Подраздел 1.14. Ответственность за нарушение правил совершения операций на Бирже и использования биржевой информации

Подраздел 1.15. Подведение итогов торгов. Биржевая информация

Подраздел 1.16. Порядок разрешения споров.

Раздел 2 Сектор рынка Основной рынок

Подраздел 2.1. Заявки

Подраздел 2.2. Условия принятия заявки к регистрации

Подраздел 2.3. Особенности проведения торгов по облигациям

Подраздел 2.4. Особенности проведения торгов по ценным бумагам, за исключением облигаций

Подраздел 2.5. Порядок взаимодействия с клиринговой организацией. Порядок исполнения сделок

Подраздел 2.6. Заключение сделок в Режиме основных торгов

Подраздел 2.7. Заключение сделок в Режиме торгов «Неполные лоты»

Подраздел 2.8. Режим переговорных сделок

Подраздел 2.9. Порядок заключения сделок РЕПО

Подраздел 2.10. Заключение сделок РЕПО на условиях нецентрализованного клиринга

Подраздел 2.11. Торги по акциям и облигациям, допущенным к размещению

Подраздел 2.12. Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» и «Размещение: Адресные заявки»

Подраздел 2.13. Проведение торгов по приобретению акций и выкупу облигаций

Подраздел 2.14. Порядок проведения торгов по обмену ценных бумаг

Подраздел 2.15. Режим торгов крупными пакетами ценных бумаг

Подраздел 2.16. Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Облигации Д – Режим основных торгов» и «Облигации Д – РПС»

Подраздел 2.17. Порядок заключения сделок с ценными бумагами, предназначенными для квалифицированных инвесторов

Подраздел 2.18. Порядок заключения сделок в Режиме торгов «РИИ2 – РПС»

Подраздел 2.19. Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Акции Д - Режим основных торгов» и «Акции Д – РПС»

Подраздел 2.20. Заключение сделок РЕПО с Центральным контрагентом

Подраздел 2.21. Порядок проведения торгов в Режиме торгов «РПС с ЦК»

Подраздел 2.22. Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Режим основных торгов Т+»

Подраздел 2.23. Порядок проведения торгов в Режиме торгов «Исполнение обязательств по Сделкам Т+: РПС»

Подраздел 2.24. Порядок проведения торгов в Режиме торгов «Исполнение обязательств по Сделкам Т+: РЕПО»

Подраздел 2.25. Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Исполнение обязательств по срочным контрактам»

Раздел 3. Сектор рынка Standard

Подраздел 3.1. Общие положения

Подраздел 3.2. Виды Заявок

Подраздел 3.3. Требования к содержанию Заявок

Подраздел 3.4. Объявление и удаление Заявок

Подраздел 3.5. Заключение Сделок

Подраздел 3.6. Особенности заключения сделок в результате исполнения Срочных контрактов

Подраздел 3.7. Исполнение (прекращение) сделок

Подраздел 3.8. Отчеты о сделках с ценными бумагами

Раздел 4. Сектор рынка Classica

Подраздел 4.1. Заявки в Секторе рынка Classica

Подраздел 4.2. Требования к содержанию Заявки

Подраздел 4.3. Объявление и удаление Заявок в Секторе рынка Classica

Подраздел 4.4. Заключение сделок в Секторе рынка Classica

Подраздел 4.5. Заключение сделок путем переговоров

Подраздел 4.6. Заключение сделок электронным способом

Подраздел 4.7. Порядок сверки сделок

Подраздел 4.8. Обеспечение исполнения обязательств по сделкам в Секторе рынка Classica

Подраздел 4.9. Порядок исполнения сделок в Секторе рынка Classica

Подраздел 4.10. Особые условия перерегистрации ценных бумаг

Подраздел 4.11. Отчеты о сделках с ценными бумагами

ПРИЛОЖЕНИЕ №1

Порядок приостановки и возобновления торгов при наступлении ситуаций, определенных законами 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 уплате возмещения

ПРИЛОЖЕНИЕ №5

Форма уведомления Участника торгов об отказе от возмещения по сделке с ценными бумагами

ПРИЛОЖЕНИЕ №6

Форма уведомления Участника торгов о необходимости внесения компенсационного взноса

ПРИЛОЖЕНИЕ №6А

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

ПРИЛОЖЕНИЕ №7

Форма сводного реестра заявок

ПРИЛОЖЕНИЕ №7А

Форма сводного реестра заявок (Аукцион РЕПО)

ПРИЛОЖЕНИЕ №8

Форма сводного реестра заявок (Тип № 2)

ПРИЛОЖЕНИЕ №9

Форматы электронных документов

ПРИЛОЖЕНИЕ №10

Форма уведомления об ошибке

ПРИЛОЖЕНИЕ №10А

Форма запроса на активацию идентификатора после исправления ошибки программного обеспечения

ПРИЛОЖЕНИЕ №11

Формы заявок, подаваемые Участниками торгов в Систему торгов

ПРИЛОЖЕНИЕ №12

Процедура урегулирования взаимных требований по сделкам

ПРИЛОЖЕНИЕ №13

Методика расчета текущих цен ценных бумаг

ПРИЛОЖЕНИЕ №14

Порядок использования АСП и порядок проведения технической экспертизы

ПРИЛОЖЕНИЕ №15

Порядок письменного оформления сделок, заключенных в Секторе рынка Classica

ПРИЛОЖЕНИЕ №16

Условия сделок, заключаемых с Центральным контрагентом в Секторе рынка Standard

ПРИЛОЖЕНИЕ №17

Условия сделок РЕПО, заключаемых с Центральным контрагентом в Секторе рынка Standard

ПРИЛОЖЕНИЕ №18

Методика определения цен закрытия ценных бумаг

Раздел 1 Общие положения

Подраздел 1.1. Термины и определения

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

1.1.1.1. Аналог собственноручной подписи / АСП - реквизит заявки или иного электронного сообщения, направляемого в Систему торгов ЗАО «Фондовая биржа ММВБ», позволяющий однозначно идентифицировать Участника торгов, направившего заявку или иное электронное сообщение, и подтверждающий целостность и неизменность заявок или иных электронных сообщений за счет использования специализированных программно-технических средств и организационных мероприятий. Порядок использования АСП и порядок проведения технической экспертизы предусмотрены в Приложении № 14 к настоящим Правилам.

1.1.1.2. Биржа, ФБ ММВБ - Закрытое акционерное общество «Фондовая биржа ММВБ».

1.1.1.3. Биржевая информация – цифровые данные и иные сведения неконфиденциального характера о ходе и итогах торгов на ФБ ММВБ, раскрываемые (предоставляемые) в режиме реального времени, с задержкой или в виде итогов торгов, обработанные и систематизированные с помощью программно-технических средств и оборудования ФБ ММВБ, содержащиеся в базах данных ФБ ММВБ.

1.1.1.4. Аукцион - форма проведения торгов, которая может использоваться как при размещении, так и при обращении ценных бумаг для целей определения оптимальной цены. 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 с учетом особенностей, установленных настоящими Правилами.

1.1.1.5. Внутридневная сделка РЕПО - сделка РЕПО, Даты исполнения первой и второй части которой приходятся на один расчетный день (срок сделки РЕПО считается равным нулю).

1.1.1.6. Встречная заявка – заявка противоположной направленности, поданная в соответствующем Секторе рынка/Режиме торгов, при условии совпадения следующих указанных параметров:

- наименование ценной бумаги;
- вид заявки (адресные/безадресные);
- цена в одной и той же валюте;
- код расчетов/условия перерегистрации ценных бумаг;
- иные параметры, предусмотренные настоящими Правилами.

Для отдельных Режимов торгов и/или Секторов рынка может быть определена возможность установления в качестве встречной заявки к безадресной заявке - адресной заявки.

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

1.1.1.8. 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 в Секторе рынка Основной рынок и настоящими Правилами.

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

1.1.1.10. Дата исполнения - дата, в которую в соответствии с условиями заключенной сделки с ценными бумагами и настоящими Правилами участники торгов ФБ

ММВБ и/или клиринговая организация обязаны исполнить свои обязательства по сделке (по первой или по второй части сделки РЕПО) в порядке, определенном внутренними документами клиринговой организации и/или настоящими Правилами.

1.1.1.11. Дата прекращения исполнения – дата, начиная с которой не допускается исполнение в натуре обязательств по сделке с ценными бумагами:

- первый расчетный день после Даты исполнения сделки с ценными бумагами с кодом расчетов T0, K0, Yn, X0 или Z0, а также Даты исполнения соответствующей части сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Y0/Yn, Y1/Yn;

- второй расчетный день после Даты исполнения сделки с ценными бумагами с кодом расчетов B0-B30, за исключением сделок, заключаемых при размещении ценных бумаг или сделок, заключаемых с использованием порядка (способов) объявления (подачи заявок) и заключения сделок, определенного(ых) в Подразделах 2.11.-2.13 и 2.18 настоящих Правил;

- первый расчетный день после Даты исполнения сделки с ценными бумагами с кодом расчетов B0-B30 для сделок, заключаемых при размещении ценных бумаг или сделок, заключаемых с использованием порядка (способов) объявления (подачи заявок) и заключения сделок, определенного(ых) в Подразделах 2.11.-2.13 и 2.18 настоящих Правил;

- первый расчетный день после Даты исполнения первой части сделки РЕПО, заключенной с кодом расчетов Rb, X0 или Z0;

- второй расчетный день после Даты исполнения первой части сделки РЕПО, заключенной с кодом расчетов S0-S2 и не являющейся внутридневной (за исключением сделки РЕПО, заключенной в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» или «РЕПО с Банком России: фикс.ставка»;

- первый расчетный день после Даты исполнения первой части внутридневной сделки РЕПО, заключенной с кодом расчетов S0-S2, и сделки РЕПО, заключенной в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» или «РЕПО с Банком России: фикс.ставка»;

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

- второй расчетный день после Даты исполнения второй части сделки РЕПО, не являющейся внутридневной и заключенной с кодом расчетов Z0, X0, Rb или S0-S2 и сделки РЕПО, заключенной в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» или «РЕПО с Банком России: фикс.ставка»;

- первый расчетный день после Даты исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг или Даты исполнения первой части сделки РЕПО или Даты исполнения второй части сделки РЕПО в Секторе рынка Standard.

1.1.1.12. Двусторонняя котировка – одна или совокупность нескольких заявок, поданных во исполнение обязательств Маркет-мейкера на покупку ценных бумаг, и одна или совокупность нескольких заявок, поданных во исполнение обязательств Маркет-мейкера на продажу ценных бумаг, поданные Маркет-мейкером от своего имени и за свой счет, либо от своего имени по поручению и за счет клиента, с ценовыми условиями, при которых величина спреда двусторонней котировки меньше или равна величине предельного спреда, рассчитанных в соответствии с Подразделом 1.6. «Маркет-мейкеры» настоящих Правил, и суммарный объем которых (заявок на покупку и заявок на продажу, соответственно) не меньше минимально допустимого объема (далее - МДО).

1.1.1.13. Дискретный аукцион – форма проведения торгов в Режиме основных торгов и/или в ходе торгов в Режиме торгов «Режим основных торгов Т+» в порядке, предусмотренном в Подразделах 2.6. «Заключение сделок в Режиме основных торгов», 2.22. «Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Режим основных торгов Т+» настоящих Правил. Цена Дискретного аукциона по ценной бумаге используется, в том числе, для установления предельных границ колебания цены ценной бумаги,

предусмотренных в Подразделе 1.9. «Правила предотвращения, выявления и пресечения случаев неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком, а также меры по предотвращению дестабилизации рынка» настоящих Правил.

1.1.1.14. Дополнительная торговая сессия – торги, проводимые на Бирже после окончания Основной торговой сессии текущего дня.

1.1.1.15. Допустимая встречная заявка – допустимой встречной заявкой по отношению к какой-либо заявке является встречная заявка, удовлетворяющая условиям, определенным в Подразделе 2.1. «Заявки» или Подразделе 3.4. Раздела 3 «Сектор рынка Standard» или в Подразделе 4.3. Раздела 4 «Сектор рынка Classica» настоящих Правил.

1.1.1.16. Заявитель - лицо, поименованное в качестве такового в Правилах листинга в ЗАО «ФБ ММВБ», утвержденными Советом директоров ФБ ММВБ и зарегистрированными Центральным банком Российской Федерации (далее – Правила листинга). В случае продажи пакета акций (депозитарных расписок на акции) Заявителем может являться владелец такого пакета акций (депозитарных расписок на акции), а также Участник торгов, уполномоченный владельцем такого пакета подавать заявки на продажу в рамках продажи пакета акций (депозитарных расписок на акции).

1.1.1.17. Заявка – подписанное АСП Участника торгов и передаваемое в Систему торгов ФБ ММВБ электронное сообщение, содержащее предложение (предложения) участника торгов на заключение сделки (сделок) с ценными бумагами (оферту/оферты) и (или) уведомление (уведомления) участника торгов о принятии такого предложения (предложений) на условиях, содержащихся в заявке и/или настоящих Правилах и/или Торговом соглашении ЗАО «ФБ ММВБ».

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

1.1.1.19. Клиринговая организация - организация, имеющая лицензию на осуществление клиринговой деятельности на рынке ценных бумаг и заключившая с ФБ ММВБ соответствующий договор. Клиринговые организации, которые могут осуществлять клиринг заключенных на Бирже сделок – Акционерный Коммерческий Банк «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество), Небанковская кредитная организация закрытое акционерное общество «Национальный расчетный депозитарий». Решение об определении клиринговой(ых) организации(й), которая(ые) будет(ут) осуществлять клиринг по заключенным на Бирже сделкам в отдельном Режиме торгов/Секторе рынка, а также по отдельным видам сделок, принимается Биржей. В случае принятия решения об изменении клиринговой организации, осуществляющей клиринг по заключенным на Бирже сделкам в отдельном Режиме торгов/Секторе рынка, а также по отдельным видам сделок, участники торгов ФБ ММВБ уведомляются в срок не позднее 20 дней до вступления в силу такого решения.

1.1.1.20. Код расчетов - код, определяющий условия принятия заявки к исполнению, а также порядок и условия исполнения сделки, предусмотренные внутренними документами Клиринговой организации. Перечень допустимых кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается Биржей. По решению Биржи могут быть изменены коды расчетов, предусмотренные для отдельных видов заявок в соответствии с Подразделом 2.1. «Заявки» настоящих Правил. Для заключения сделок в Секторе рынка Основной рынок могут использоваться следующие коды расчетов:

- Код расчетов Т0 – код расчетов, используемый при заключении сделки с ценными бумагами с участием центрального контрагента (далее – на условиях централизованного клиринга) и без участия центрального контрагента (далее – на условиях нецентрализованного клиринга), обязательства по которой подлежат исполнению в Клиринговой организации по итогам торгов, и определяющий, что при подаче заявки проводится Процедура контроля обеспечения (если иной порядок не

предусмотрен настоящими Правилами), а Датой исполнения сделки с ценными бумагами является Дата заключения сделки.

- Код расчетов K0 – код расчетов, используемый при заключении сделки с ценными бумагами на условиях централизованного клиринга, обязательства по которой подлежат исполнению в Клиринговой организации по итогам торгов, и определяющий, что при заключении сделки проводится Процедура контроля обеспечения, а 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) на условиях нецентрализованного клиринга, обязательства по которым подлежат исполнению в Клиринговой организации в ходе торгов (для сделок РЕПО в ходе торгов проводится исполнение их первых частей), и определяющий, что при подаче заявки проводится Процедура контроля обеспечения, Датой исполнения сделки с ценными бумагами или первой части сделки РЕПО является Дата заключения сделки, а Датой исполнения второй части сделки РЕПО является дата, определяемая как $T + k$, где T – Дата исполнения первой части сделки РЕПО, а k – Срок сделки РЕПО (k – не может быть равен 0).

- Код расчетов X0 – код расчетов, используемый при заключении сделки с ценными бумагами на условиях нецентрализованного клиринга, обязательства по которым подлежат исполнению в Клиринговой организации в ходе торгов во время, определяемое Клиринговой организацией, и определяющий, что при подаче заявки проводится Процедура контроля обеспечения, а Датой исполнения сделки с ценными бумагами является Дата заключения сделки.

- Коды расчетов от B0 до B30 (далее - B0-B30) – коды расчетов, используемые при заключении сделок с ценными бумагами на условиях нецентрализованного клиринга, обязательства по которым подлежат исполнению в Клиринговой организации, и определяющие, что при подаче заявки проводится Процедура контроля обеспечения только в части обязательств по уплате комиссионного и иных видов вознаграждения (если иной порядок контроля обеспечения не предусмотрен настоящими Правилами), 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 0 до 30).

- Коды расчетов S0, S1, S2 (далее - S0-S2) – коды расчетов, используемые при заключении сделок РЕПО на условиях нецентрализованного клиринга, обязательства по которым подлежат исполнению в Клиринговой организации, и определяющие, что при подаче заявки проводится Процедура контроля обеспечения только в части обязательств по уплате комиссионного и иных видов вознаграждения, 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 Датой исполнения второй части сделки РЕПО является дата, определяемая как $T+x+k$, где $T+x$ – Дата исполнения первой части сделки РЕПО, а k – Срок сделки РЕПО.

- Код расчетов Rb – код расчетов, используемый при заключении сделки РЕПО на условиях нецентрализованного клиринга, обязательства по которым подлежат исполнению в Клиринговой организации, и определяющий, что при подаче заявки проводится Процедура контроля обеспечения, Датой исполнения первой части сделки РЕПО является Дата заключения сделки, а Датой исполнения второй части сделки РЕПО является дата, определяемая как $T+k$, где T - дата заключения сделки РЕПО, а k – Срок сделки РЕПО.

- Код расчетов Yn - код расчетов, используемый при заключении Сделки T+, обязательства по которой подлежат исполнению в Клиринговой организации во время, определенное Клиринговой организацией, и определяющий, что при подаче заявки

проводится Процедура контроля обеспечения. Датой исполнения сделки с ценными бумагами является дата, определяемая как $T+n$ (для сделок, заключенных в ходе дополнительной торговой сессии в Секторе Рынка Основной рынок Дата исполнения определяется как $T+n$), где T – фактическая дата заключения сделки, а n – число расчетных дней, значение которого определяется последней цифрой кода расчетов по сделке.

- Код расчетов $Y0/Yn$ - код расчетов, используемый при заключении Сделки $T+$, обязательства по которой подлежат исполнению в Клиринговой организации во время, определенное Клиринговой организацией, и определяющий, что при подаче заявки проводится Процедура контроля обеспечения. Датой исполнения первой части сделки РЕПО является дата заключения сделки РЕПО, а Датой исполнения второй части сделки РЕПО является дата, определяемая как $T+n$, где T - дата исполнения первой части сделки РЕПО, а n – число расчетных дней, значение которого определяется последней цифрой кода расчетов по сделке.

- Код расчетов $T0/Yn$ - код расчетов, используемый при заключении Сделки $T+$, обязательства по которой подлежат исполнению в Клиринговой организации во время, определенное Клиринговой организацией, и определяющий, что при подаче заявки проводится Процедура контроля обеспечения. Датой исполнения первой части сделки РЕПО является дата заключения сделки РЕПО, а Датой исполнения второй части сделки РЕПО является дата, определяемая как $T+n$, где T - дата исполнения первой части сделки РЕПО, а n – число расчетных дней, значение которого определяется последней цифрой кода расчетов по сделке.

- Код расчетов $Y1/Yn$ - код расчетов, используемый при заключении Сделки $T+$, обязательства по которой подлежат исполнению в Клиринговой организации во время, определенное Клиринговой организацией, и определяющий, что при подаче заявки проводится Процедура контроля обеспечения. Датой исполнения первой части сделки РЕПО является дата, определяемая как $T+x$, где T - дата заключения сделки РЕПО, x равен одному расчетному дню, а Датой исполнения второй части сделки РЕПО является дата, определяемая как $T+x+n$, где $T+x$ - дата исполнения первой части сделки РЕПО, а n – число расчетных дней, значение которого определяется последней цифрой кода расчетов по сделке.

В случаях несовпадения торгового дня Биржи с расчетным днем Клиринговой организации и/или операционным днем национальной платежной системы (платежной системы Банка России), решением Биржи может быть изменен срок и порядок исполнения сделок/частей сделок по отдельным кодам расчетов.

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

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

1.1.1.23. Код раздела регистра учета позиций – код раздела регистра учета позиций в соответствии с Правилами клиринга Клиринговой организации.

1.1.1.24. Код торговых счетов - буквенно-цифровой код, присваиваемый клиентам участника торгов ФБ ММВБ, в соответствии с Правилами допуска к участию в торгах Закрытого акционерного общества «Фондовая биржа ММВБ», в целях совершения сделок в Секторе рынка Classica.

1.1.1.25. Компенсационный взнос – сумма денежных средств или количество ценных бумаг, подлежащие уплате (поставке), в качестве частичного предварительного исполнения обязательств по второй части этой сделки РЕПО, в размере, определяемом в

соответствии с настоящими Правилами, одним участником торгов ФБ ММВБ другому участнику торгов ФБ ММВБ, являющемуся его контрагентом по сделке РЕПО в Секторе рынка Основной рынок, условиями которой предусмотрено внесение компенсационных взносов.

1.1.1.26. 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.

1.1.1.27. Кросс-курс иностранной валюты (кросс-курс) – соотношение между двумя валютами, определяемое на основе официальных курсов иностранных валют по отношению к рублю, устанавливаемых Банком России, используемый для целей расчета величины дохода, уменьшающего Сумму РЕПО по сделкам РЕПО, расчеты по которым осуществляются в валюте, отличной от валюты, в которой номинирована ценная бумага, являющаяся объектом такой сделки РЕПО. Кросс-курс определяется в следующем порядке:

$$CR_i = \frac{Q_{r.tr} * R_{nomrur}}{R_{tr.rur}}, \text{ где}$$

CR_i - кросс-курс валюты номинала по отношению к валюте расчетов по сделке;

$Q_{r.tr}$ - количество единиц валюты расчетов по сделке для целей определения официального курса иностранной валюты по отношению к рублю Банком России;

R_{nomrur} - официальный курс валюты, в которой номинирована ценная бумага, по отношению к рублю на дату расчета кросс-курса, руб;

$R_{tr.rur}$ - официальный курс валюты расчетов по отношению к рублю на дату расчета кросс-курса, руб.

1.1.1.28. 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 Подразделом 1.9. «Правила предотвращения, выявления и пресечения случаев неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком, а также меры по предотвращению дестабилизации рынка» настоящих Правил и контроля осуществляемого в соответствии с Порядком организации мониторинга организованных торгов, а также контроля за участниками торгов и иными лицами ЗАО «ФБ ММВБ»).

1.1.1.29. Маркет-мейкер - участник торгов ФБ ММВБ, заключивший с Биржей договор о поддержании цен, спроса, предложения и (или) объема торгов ценными бумагами в соответствии с требованиями Подраздела 1.6. «Маркет-мейкеры» настоящих Правил.

1.1.1.30. Максимальное предельное значение дисконта – условие сделки РЕПО, которое может устанавливаться контрагентами при ее заключении в Секторе рынка Основной рынок.

1.1.1.31. Минимальное предельное значение дисконта – условие сделки РЕПО, которое может устанавливаться контрагентами при ее заключении в Секторе рынка Основной рынок.

1.1.1.32. Начальное значение дисконта (далее также - начальный дисконт) – обязательное условие сделки РЕПО, значение которого определяется в Системе торгов ФБ

ММВБ при ее заключении в Секторе рынка Основной рынок. 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.

1.1.1.33. Нетиповая сделка – сделка, заключенная в предторговый период, или в ходе Дискретного аукциона, или в ходе торгового периода Режим основных торгов или в ходе торгов в Режиме торгов «Режим основных торгов Т+», цена, объем или иные условия которой соответствуют установленным Биржей параметрам.

1.1.1.34. Объем сделки (заявки) – произведение цены (в валюте сделки (заявки)) на количество ценных бумаг (расчетное количество ценных бумаг) в заключенной сделке (поданной заявке) (в том числе и по сделкам РЕПО в Секторе рынка Standard и Секторе рынка Classica) или объем денежных средств, указанных в заявке (для заявок, поданных с указанием объема денежных средств). Для сделки (заявки) РЕПО в Секторе рынка Основной рынок - Сумма РЕПО на Дату исполнения первой части.

1.1.1.35. Основная торговая сессия – торги, проводимые на Бирже в период времени, установленный в Подразделе 1.3. настоящих Правил.

1.1.1.36. Очередь заявок (далее - очередь) – упорядоченная последовательность зарегистрированных в Системе торгов неисполненных заявок и/или частично исполненных заявок. 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. Формирование очереди начинается в момент начала торгов. В очередь не включаются заявки, адресованные конкретному участнику торгов Биржи. Все заявки, стоящие в очереди, считаются активными заявками.

1.1.1.37. Переменное возмещение – способ обеспечения исполнения обязательств по сделкам, заключенным участниками торгов ФБ ММВБ в Секторе рынка Основной рынок в соответствии с настоящими Правилами и учитываемым в соответствии с Правилами клиринга. Переменное возмещение является денежным обязательством участника торгов ФБ ММВБ по уплате в случае неисполнения обязательств по сделкам участнику торгов ФБ ММВБ – контрагенту по сделке с ценными бумагами денежных средств. Размер денежного обязательства определяется в соответствии с Подразделом 1.13. «Контроль за соблюдением Участниками торгов Правил проведения торгов и использованием Биржевой информации» 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 Биржей.

1.1.1.38. Правила электронного документооборота (далее - Правила ЭДО) – Правила электронного документооборота, утвержденные уполномоченным органом ОАО Московская биржа, в соответствии с которыми ФБ ММВБ является Организатором подсистемы Системы электронного документооборота ОАО Московская Биржа.

1.1.1.39. Правила допуска к участию в торгах Закрытого акционерного общества «Фондовая биржа ММВБ» (далее - Правила допуска) – внутренний документ ФБ ММВБ, который регламентирует требования к участникам торгов, требования к способам и периодичности идентификации участников торгов, порядок отнесения участников торгов ФБ ММВБ к определенным категориям, их права и обязанности, порядок допуска, приостановления и прекращения допуска к участию в торгах, порядок регистрации участников торгов и их клиентов, а также меры дисциплинарного воздействия, применяемые к участникам торгов при нарушении ими правил, установленных Биржей.

1.1.1.40. 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. В случаях предусмотренных настоящими Правилами, условия заключения отдельных видов сделок могут устанавливаться в Правилах клиринга.

1.1.1.41. Прайм-брокер - участник торгов ФБ ММВБ, который допущен к участию в торгах в качестве Прайм-брокера в соответствии с Правилами допуска.

1.1.1.42. 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 ФБ ММВБ в соответствии с ограничениями, предусмотренными в Подразделе 2.2. «Условия принятия заявки к регистрации» и в Подразделе 1.9. «Правила предотвращения, выявления и пресечения случаев неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком, а также меры по предотвращению дестабилизации рынка» настоящих Правил.

1.1.1.43. Рабочий день - день, в том числе, если такой день является выходным или нерабочим праздничным днем, в который Биржа предоставляет возможность заключения Сделок с ценными бумагами.

1.1.1.44. Распоряжение об отзыве заявки – подписанное АСП Участника торгов электронное сообщение, передаваемое в Систему торгов ФБ ММВБ с целью отзыва заявки(ок), содержащее информацию, предусмотренную настоящими Правилами.

1.1.1.45. Расчетная цена для целей определения отклонений цен – цена ценной бумаги, определяемая в ходе Дискретного аукциона (далее - цена дискретного аукциона), либо устанавливаемая Биржей, и используемая для установления предельных границ колебания цены ценной бумаги.

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

1.1.1.47. Расчетный период - период от начала Основной торговой сессии до начала приостановки Торгов, осуществленной Биржей в целях проведения дневной клиринговой сессии (дневной Расчетный период), либо период от окончания приостановки Торгов, осуществленной Биржей в целях проведения дневной клиринговой сессии, до начала приостановки Торгов, осуществленной Биржей в целях проведения вечерней клиринговой сессии (вечерний Расчетный период).

1.1.1.48. Сделка с ценными бумагами – (далее также – сделка, сделка купли-продажи ценных бумаг, сделка РЕПО, сделка в российских рублях, сделка в иностранной валюте) – сделка, заключенная на торгах Биржи в соответствии с настоящими Правилами.

1.1.1.49. Сделка T+ – Сделка с ценными бумагами, заключенная на условиях централизованного клиринга. Порядок определения, учета и исполнения обязательств по Сделкам T+, а также порядок расчета, учета, исполнения обязательств по обеспечению таких сделок устанавливаются Правилами клиринга и иными внутренними документами Клиринговой организации.

1.1.1.50. Система торгов - совокупность программно-технических средств, представляющая собой объединение подсистем программно-технического комплекса(ов) технического(их) центра(ов), предназначенных для заключения сделок с ценными бумагами на ФБ ММВБ.

1.1.1.51. Список ценных бумаг – совокупность ценных бумаг, указание которой допускается в адресной заявке РЕПО вместо наименования (торгового кода) ценной бумаги. Списки ценных бумаг утверждаются Биржей и имеют уникальные наименования (уникальные коды).

1.1.1.52. Средневзвешенная цена – цена одной ценной бумаги определенного эмитента, вида, категории (типа), определяемая как результат от деления общего объема всех сделок купли-продажи с указанной ценной бумагой, заключенных на основании безадресных заявок в соответствующем Режиме торгов/Секторе рынка в течение данного

торгового дня, на общее количество ценных бумаг, являющихся предметом этих сделок. При этом цены сделок, заключенных в иностранной валюте, пересчитываются в российские рубли по курсу Банка России на дату их заключения.

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

1.1.1.54. Срок сделки РЕПО - число календарных дней, определяемое при заключении сделки РЕПО. Срок сделки РЕПО исчисляется с Даты исполнения первой части сделки РЕПО в Секторе рынка Основной рынок.

1.1.1.55. Ставка РЕПО – положительная, отрицательная или равная нулю величина, выраженная в процентах годовых, указываемая участником торгов ФБ ММВБ в заявке РЕПО, используемая в Секторе рынка Основной рынок для расчета цены второй части сделки РЕПО или Стоимости обратного выкупа .

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

1.1.1.57. Сумма РЕПО – условие сделки РЕПО, значение которого определяется в Системе торгов при ее заключении в Секторе рынка Основной рынок. Значение суммы РЕПО либо указывается контрагентами в заявке на заключение сделки РЕПО, либо рассчитывается в Системе торгов на основе значений других реквизитов заявки на заключение сделки РЕПО.

1.1.1.58. Технический центр – Открытое акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС», Общество с ограниченной ответственностью «МБ Технологии» и Некоммерческое партнерство развития финансового рынка РТС, обеспечивающие технический доступ в Систему торгов участникам торгов ФБ ММВБ в соответствующих Секторах рынков.

1.1.1.59. Текущая средневзвешенная цена – средневзвешенная цена, рассчитанная на определенный момент времени на основании безадресных заявок в соответствующем Режиме торгов/Секторе рынка.

1.1.1.60. Текущее значение дисконта (далее также – 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) в Секторе рынка Основной рынок.

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

1.1.1.62. Торговая сессия - Основная торговая сессия или Дополнительная торговая сессия.

1.1.1.63. Торговый день - определенный в Подразделе 1.3 «Расписание предоставления услуг» настоящих Правил период времени, в который Биржей проводятся Торги в соответствующем Секторе рынка.

1.1.1.64. Условия перерегистрации ценных бумаг – условия перерегистрации

ценных бумаг, указываемые в Заявках в Секторе рынка Standard в случаях и порядке, предусмотренных Разделом 3 «Сектор рынка Standard» настоящих Правил, и в Секторе рынка Classica в случаях и порядке, предусмотренных Разделом 4 «Сектор рынка Classica» настоящих Правил.

1.1.1.65. Участник торгов - юридическое лицо, допущенное к участию в торгах в соответствии с требованиями Правил допуска, и имеющее право объявлять (подавать) заявки и совершать (заключать) сделки с ценными бумагами на Бирже.

1.1.1.66. Участник торгов - кредитная организация или Участник торгов КО - Участник торгов, имеющий лицензию на осуществление банковских операций.

1.1.1.67. Участник торгов – уполномоченный банк или Участник торгов УБ - Участник торгов, имеющий право на основании лицензий Банка России осуществлять банковские операции со средствами в иностранной валюте.

1.1.1.68. Фиксированное возмещение - способ обеспечения исполнения обязательств по сделке, заключенной Участниками торгов в Секторе рынка Основной рынок в соответствии с настоящими Правилами. Фиксированное возмещение учитывается в соответствии с Правилами клиринга и является денежным обязательством Участника торгов по уплате в случае неисполнения обязательств по сделкам Участнику торгов – контрагенту по сделке с ценными бумагами денежных средств. Размер данного денежного обязательства (ставка фиксированного возмещения) устанавливается при подаче заявки Участником торгов, а денежная сумма, составляющая такое обязательство по сделке, заключенной на основании данной заявки, рассчитывается в соответствии с Подразделом 1.13. «Контроль за соблюдением Участниками торгов Правил проведения торгов и использованием Биржевой информации» настоящих Правил и удерживается в порядке, предусмотренном Правилами клиринга. Предельные значения и точность указания ставки фиксированного возмещения в заявках устанавливается Биржей. Перечень Режимов торгов, при заключении сделок в которых фиксированное возмещение устанавливается, утверждается Биржей.

1.1.1.69. Цена возмещения – цена ценной бумаги, определяемая в Системе торгов для ценных бумаг, по сделкам в Секторе рынка Основной рынок с которыми определяется переменное возмещение. Цена возмещения рассчитывается каждый Рабочий 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, в ходе торгового периода Режим основных торгов (за исключением нетиповых сделок и сделок в иностранной валюте), в ходе торгов в Режиме торгов «Облигации Д – Режим основных торгов», в ходе торгов в Режиме торгов «Акции Д – Режим основных торгов», в ходе торгов в Режиме торгов «Квал.Инвесторы – Режим основных торгов», в ходе торгов в Режиме торгов «Режим основных торгов Т+» на общее количество ценных бумаг, являющихся предметом этих сделок за данный Рабочий день. В случае невозможности определить цену возмещения по ценной бумаге в данный торговый день ценой возмещения текущего Рабочего дня считается последняя рассчитанная в Системе торгов цена возмещения.

1.1.1.70. Цена предторгового периода – единая цена, по которой заключаются сделки в предторговом периоде Режим основных торгов, определяемая в порядке, предусмотренном в Подразделах 2.6. «Заключение сделок в Режиме основных торгов», 2.22. «Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Режим основных торгов Т+» настоящих Правил.

1.1.1.71. Цена послеторгового периода – единая цена, по которой заключаются сделки в послеторговом периоде Режим основных торгов, определяемая в порядке, предусмотренном в Подразделах 2.6. «Заключение сделок в Режиме основных торгов», 2.22. «Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Режим основных торгов Т+» настоящих Правил.

1.1.1.72. Ценовая нестабильность ценной бумаги – заключение с ценной

бумагой десяти и более сделок в ходе торгового периода Режим 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 торгового периода Режим основных торгов с ценной бумагой заключено не менее 10 сделок и их совокупный объем составил не менее 300 тысяч рублей.

1.1.1.73. Центральный контрагент – Клиринговая организация, выступающая стороной по всем сделкам, заключаемым на условиях централизованного клиринга в предназначенных для заключения таких сделок Режимах торгов и/или Секторах рынка с использованием установленных для заключения таких сделок кодов расчетов/условий перерегистрации ценных бумаг. Организация, которая может выступать в качестве Центрального контрагента в отдельных Режимах торгов/Секторах рынков – Акционерный Коммерческий Банк «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество). Решение об определении организации, которая будет выступать в качестве Центрального контрагента в отдельных Режимах торгов/Секторах рынка, принимается Биржей. В случае принятия решения об изменении организации, выступающей стороной по сделке, заключаемой на условиях централизованного клиринга, Участники торгов уведомляются в срок не позднее 20 дней до вступления в силу такого решения.

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

1.1.1.75. Шаг дисконта – минимально возможная разница между значениями дисконта, указанными в заявках на заключение сделок РЕПО в Секторе рынка Основной рынок.

1.1.1.76. Шаг ставки РЕПО – минимально возможная разница между Ставками РЕПО, указанными в заявках одной направленности (привлечение денежных средств или размещение денежных средств) на заключение сделок РЕПО в Секторе рынка Основной рынок.

1.1.1.77. DBQ-лот – количество ценных бумаг, кратным которому должно быть количество ценных бумаг, являющихся предметом сделки в Секторе рынка Classica.

1.1.2. Термины, специально не определенные в настоящих Правилах, используются в значениях, установленных иными внутренними документами ФБ ММВБ, Правилами клиринга, а также законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

Подраздел 1.2. Общие положения

1.2.1. Настоящие Правила являются частью правил организованных торгов на рынке ценных бумаг и приняты в соответствии с Уставом Биржи, другими внутренними документами Биржи, законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

1.2.2. Настоящие Правила устанавливают правила заключения (совершения) и сверки сделок, правила регистрации сделок, порядок исполнения сделок, правила предотвращения, выявления и пресечения случаев неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком, меры по предотвращению дестабилизации рынка, 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).

1.2.3. Биржа организует проведение торгов по ценным бумагам, регистрирует сделки с ценными бумагами и осуществляет контроль за операциями, осуществляемыми на организованных торгах.

1.2.4. Торги на Бирже проводятся в соответствии с расписанием, предусмотренным в Подразделе 1.3. «Расписание предоставления услуг» настоящих

Правил.

1.2.5. Торги на Бирже проводятся в следующих Секторах рынка:

- Сектор рынка Основной рынок;
- Сектор рынка Standard;
- Сектор рынка Classica.

Особенности проведения торгов в Секторе рынка Основной рынок установлены Разделом 2 «Сектор рынка Основной рынок» настоящих Правил. Особенности проведения торгов в Секторе рынка Standard установлены Разделом 3 «Сектор рынка Standard» настоящих Правил. Особенности проведения торгов в Секторе рынка Classica установлены Разделом 4 «Сектор рынка Classica» настоящих Правил.

1.2.6. Торги по ценным бумагам в Секторе рынка Основной рынок могут проводиться в следующих Режимах торгов:

1.2.6.1. В ходе Основной торговой сессии на условиях нецентрализованного клиринга:

- Режим торгов «Размещение: Аукцион»;
- Режим торгов «Выкуп: Аукцион».

1.2.6.2. В ходе Основной торговой сессии и Дополнительной торговой сессии на условиях нецентрализованного клиринга:

- Режим переговорных сделок (РПС);
- Режим торгов «Облигации Д - РПС»;
- Режим торгов «Акции Д - РПС»;
- Режим торгов «Квал. Инвесторы - РПС»;
- Режим торгов «Квал. Инвесторы - РЕПО»;
- Режим торгов «Квал. Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)»;
- Режим торгов «РИИ2 - РПС»;
- Режим торгов «Аукцион РЕПО»;
- Режим торгов «РЕПО с акциями»;
- Режим торгов «РЕПО с акциями (в ин. валюте)»;
- Режим торгов «РЕПО с облигациями»;
- Режим торгов «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)»;
- Режим торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО»;
- Режим торгов «РЕПО с Банком России: фикс. ставка»;
- Режим торгов «Размещение: Адресные заявки»;
- Режим торгов «Выкуп: Адресные заявки»;

1.2.6.3. В ходе Основной торговой сессии и Дополнительной торговой сессии на условиях централизованного клиринга:

- Режим основных торгов;
- Режим торгов «Квал. Инвесторы - Режим основных торгов»;
- Режим торгов «Неполные лоты»;
- Режим торгов «Облигации Д - Режим основных торгов»;
- Режим торгов «Акции Д - Режим основных торгов»;
- Режим торгов крупными пакетами ценных бумаг;
- Режим торгов «Облигации Д - РПС»;
- Режим торгов «Акции Д - РПС»;
- Режим торгов «Квал. Инвесторы - РПС»;
- Режим переговорных сделок (РПС);
- Режим торгов «РИИ2 - РПС»;
- Режим торгов «Режим основных торгов Т+»
- Режим торгов «РЕПО с ЦК - Безадресные заявки»;
- Режим торгов «РЕПО с ЦК - Адресные заявки»;

- Режим торгов «Квал.Инвесторы – РЕПО с ЦК»;
- Режим торгов «РПС с ЦК»;
- Режим торгов «Квал.Инвесторы - Режим основных торгов Т+»
- Режим торгов «Квал.Инвесторы – РПС с ЦК».

1.2.6.4. В ходе Основной торговой сессии на условиях централизованного клиринга:

- Режим торгов «Исполнение обязательств по срочным контрактам»;
- Режим торгов «Исполнение обязательств по Сделкам Т+: РПС».
- Режим торгов «Исполнение обязательств по Сделкам Т+: РЕПО».

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

Решением Биржи по ценной бумаге может быть ограничена возможность заключения сделок в определенном Секторе рынка, а также может быть ограничен перечень допустимых Режимов торгов.

Решением Биржи может быть ограничен перечень ценных бумаг и/или категорий (типов) ценных бумаг, допущенных для заключения сделок в ходе Основной торговой сессии и/или Дополнительной торговой сессии.

Биржа определяет категории (типы) ценных бумаг, сделки с которыми могут заключаться на условиях централизованного клиринга. Перечень ценных бумаг, сделки с которыми могут заключаться на условиях централизованного клиринга в отдельных Секторах рынка и/или Режимов торгов, утверждается Биржей с учетом особенностей обращения каждой ценной бумаги.

Биржа определяет Перечень ценных бумаг, с которыми допускается заключение Сделок Т+. Перечень ценных бумаг, с которыми допускается заключение Сделок Т+ в отдельных Секторах рынка и/или Режимов торгов, а также изменения в такой перечень, утверждаются Биржей с учетом особенностей обращения каждой ценной бумаги, после получения соответствующего согласия от Центрального контрагента.

1.2.8. Время начала и окончания торгов по ценным бумагам при проведении Основной торговой сессии и Дополнительной торговой сессии в отдельных Секторах рынка и/или Режимов торгов, включая время начала каждого периода и время окончания каждого из периодов (порядок определения времени), из которых состоят отдельные Режимы торгов, устанавливается Биржей. Допускается установление Биржей 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.

1.2.9. Биржей может быть установлен перечень допустимых кодов расчетов по ценной бумаге в отдельном Режиме торгов (периоде), для определенного типа заявки, как в ходе Основной торговой сессии, так и в ходе Дополнительной торговой сессии.

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

1.2.10.1. Сделки на Бирже заключаются на условиях нецентрализованного и централизованного клиринга. Сделки с ценными бумагами заключаются в Системе торгов на основании объявленных (поданных) Участниками торгов заявок, сделки на условиях централизованного клиринга могут заключаться без подачи заявок в случаях, предусмотренных в Подразделах 2.23. - 2.25. Соответствие встречных заявок устанавливается в Системе торгов в порядке, предусмотренном в Подразделе 2.1. «Заявки», Подразделе 2.2. «Условия принятия заявки к регистрации», а также в Разделе 3 «Сектор рынка Standard» и Разделе 4 «Сектор рынка Classica» настоящих Правил. Заключение сделок в Системе торгов в порядке, предусмотренном настоящими Правилами, является заключением сделок путем обмена документами посредством электронной связи.

1.2.10.2. Сделка считается заключенной в момент определения в Системе

торгов двух допустимых встречных заявок, путем внесения информации о сделке в реестр сделок (регистрация сделки в Системе торгов), за исключением случаев, предусмотренных настоящими Правилами. При этом в Системе торгов автоматически фиксируется время регистрации каждой сделки в реестре сделок и ей присваивается уникальный идентификационный номер, включающий в себя номер сделки и направленность сделки.

1.2.10.3. Порядок (способы) совершения сделок при размещении и обращении ценных бумаг предусмотрен в Подразделах 2.1.-2.4. и 2.6.-2.25, а также в Разделе 3 «Сектор рынка Standard» и Разделе 4 «Сектор рынка Classica» настоящих Правил.

При наличии технической возможности проведения продажи пакета акций (депозитарных расписок на акции), в т.ч. на основании заключенного с Биржей договора, Биржей могут дополнительно устанавливаться условия обращения акций (депозитарных расписок на акции) с использованием порядка (способов) объявления (подачи заявок) и заключения сделок, определенного(ых) в Подразделах 2.6.–2.8., 2.11.-2.13. и 2.18.-2.19. настоящих Правил, а также порядок прекращения обращения акции (депозитарной расписки на акцию) на указанных условиях.

При обращении ценных бумаг, не являющихся акциями, Биржей могут дополнительно устанавливаться условия обращения ценной бумаги, не являющихся акциями, с использованием порядка (способов) объявления (подачи заявок) и заключения сделок, определенного(ых) в Подразделах 2.11.-2.13 и 2.18 настоящих Правил, а также порядок прекращения обращения такой ценной бумаги на указанных условиях.

1.2.10.4. Биржа обеспечивает Участникам торгов одной категории равные условия по заключению сделок с ценными бумагами в Системе торгов.

1.2.10.5. Условия, на которых заключаются сделки купли - продажи ценных бумаг, предусмотренные настоящими Правилами, не могут быть изменены Участниками торгов после их регистрации в Системе торгов (за исключением сделок купли-продажи ценных бумаг, заключенных в Секторе рынка Classica). В случаях, предусмотренных Правилами клиринга, Клиринговая организация вправе изменять предусмотренные Правилами клиринга отдельные условия заключенных сделок, обязательства по которым не исполнены на дату внесения таких изменений.

1.2.11. Заключение и исполнение сделок на условиях централизованного клиринга осуществляется с учетом следующих особенностей:

1.2.11.1. Сделки на условиях централизованного клиринга заключаются между Участниками торгов и Центральным контрагентом.

1.2.11.2. При подаче Участником торгов заявки на заключение сделок на условиях централизованного клиринга такая заявка проходит Процедуры контроля обеспечения, предусмотренные Правилами клиринга, что подтверждается отчетом, полученным от Клиринговой организации, и регистрируется в Системе торгов. Центральный контрагент обязан заключить сделку на условиях не хуже, чем указаны в такой заявке, при наличии допустимой(ых) встречной(ых) заявки(ок) другого(их) Участника(ов) торгов с учетом особенностей заключения сделок в соответствующем Режиме торгов.

1.2.11.3. В случае если заявки на заключение сделки подаются в одном из Режимов торгов, указанных в п.1.2.6.3. настоящего Подраздела, и с кодом расчетов T0 или K0 или Yn или Y0/Yn или T0/Yn или Y1/Yn, или в Секторе рынка Standard, то является ли такая заявка адресной или безадресной определяется, как если бы сделки на основании данных заявок заключались напрямую между Участниками торгов, а не с Центральным контрагентом.

1.2.11.4. После регистрации в Системе торгов заявка в ходе торгов проверяется Системой торгов на наличие в очереди допустимых встречных заявок.

1.2.11.5. При наличии в очереди заявки, являющейся допустимой встречной в соответствии с п. 2.1.14. настоящих Правил по отношению к ранее зарегистрированной в

Системе торгов заявке на заключение сделок с ценными бумагами на условиях централизованного клиринга, Центральный контрагент по каждой из двух допустимых встречных заявок заключает сделки с одинаковыми номерами (далее – парные или связные сделки) с Участниками торгов, подавшими эти заявки, на следующих условиях:

- цена (Ставка РЕПО) каждой из сделок определяется как цена (Ставка РЕПО) допустимой встречной заявки, стоящей первой в очереди заявок;
- объем (Сумма РЕПО) каждой из сделок определяется как минимальный из двух: объема (Суммы РЕПО) вновь зарегистрированной заявки или объема (Суммы РЕПО) допустимой встречной заявки, стоящей первой в очереди заявок, с учетом особенностей установленных п. 2.1.19. настоящих Правил.

Особенности заключения сделок с кодом расчетов К0 определены в Подразделе 2.5. «Порядок взаимодействия с клиринговой организацией. Порядок исполнения сделок» настоящих Правил.

Особенности заключения сделок с кодами расчетов Y1/Yn, Y0/Yn и T0/Yn определены в Подразделах 2.20. «Заключение сделок РЕПО с Центральным контрагентом» настоящих Правил, 2.24. Порядок проведения торгов в Режиме торгов «Исполнение обязательств по Сделкам T+: РЕПО».

Особенности заключения сделок с кодами расчетов Yn определены в Подразделах 2.7. Заключение сделок в Режиме торгов «Неполные лоты», 2.17. Порядок заключения сделок с ценными бумагами, предназначенными для квалифицированных инвесторов, 2.19. Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Акции Д - Режим основных торгов» и «Акции Д – РПС», 2.21. Порядок проведения торгов в Режиме торгов «РПС с ЦК», 2.22. Порядок проведения торгов в Режиме торгов «Режим основных торгов T+» настоящих Правил и 2.23. Порядок проведения торгов в Режиме торгов «Исполнение обязательств по Сделкам T+: РПС».

1.2.11.6. При отсутствии в очереди допустимых встречных заявок зарегистрированная заявка ставится в очередь до поступления заявок, являющихся допустимыми встречными, или удаляется из Системы торгов в зависимости от вида заявки и указанного признака. Размер заявки не влияет на ее приоритет.

1.2.11.7. В момент определения заявки, являющейся допустимой встречной заявкой в соответствии с п. 2.1.14. настоящих Правил к поданной заявке, осуществляются действия в соответствии с п. 1.2.11.5. настоящих Правил.

1.2.11.8. Информация о наличии допустимых встречных заявок, об условиях заключения парных сделок, определяемых в соответствии с п. 1.2.11.5. настоящих Правил, о наличии или отсутствии в очереди неисполненных заявок, а также об отзыве Участником торгов заявки становится доступной Центральному контрагенту посредством Системы торгов ФБ ММВБ.

1.2.11.9. Порядок и особенности заключения сделок в Секторе рынка Standard определены в Разделе 3 настоящих Правил.

1.2.11.10. В Режиме торгов, в которых заключаются Сделки T+, могут принимать участие только Участники торгов, удовлетворяющие критериям, позволяющим заключать Сделки T+, предусмотренным Правилами клиринга, при этом Правилами клиринга устанавливаются требования, соблюдение которых позволяет Участникам торгов заключать Сделки T+ с допуском к клирингу с частичным обеспечением.

1.2.12. В ходе Дополнительной торговой сессии, а также в ходе Основной торговой сессии в период между 19:00 и до окончания Основной торговой сессии, не допускается заключение сделок на условиях исполнения обязательств по заключаемым сделкам в текущий день.

1.2.13. В торгах по ценным бумагам могут принимать участие только Участники торгов. В случаях, предусмотренных Правилами клиринга, Клиринговая организация, выполняющая функции Центрального контрагента, может подавать заявки, встречные к заявкам Участников торгов, и заключать сделки в соответствии с порядком,

установленном Правилами клиринга.

1.2.14. Участники торгов имеют право заключать сделки:

- от своего имени и за свой счет;
- от своего имени 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.

По ценным бумагам, предназначенным для квалифицированных инвесторов, заявки на покупку направляются в Систему торгов Участниками торгов:

- от своего имени и за свой счет;
- от своего имени и за счет своих клиентов – квалифицированных инвесторов;
- от своего имени и за счет средств квалифицированных инвесторов, находящихся в доверительном управлении.

Сделки в Режиме торгов «Исполнение обязательств по сделкам Т+: РПС» и «Исполнение обязательств по сделкам Т+: РЕПО» заключаются от имени и за счет Участника торгов.

В Секторе рынка Classica возможна подача заявок от имени и за счет клиента. Если после заключения сделки от имени и за счет клиента подписание договора от его имени окажется невозможным, заключивший сделку Участник торгов обязан по требованию контрагента подписать данный договор от своего имени. Если такая сделка предусматривала расчеты в иностранной валюте, а Участник торгов, подписывающий договор от своего имени, в соответствии с законодательством Российской Федерации о валютном регулировании и валютном контроле не вправе осуществлять такие расчеты, договор заключается на условиях расчетов в российских рублях. При подаче заявок от имени и за счет клиента также используется АСП Участника торгов и указание на код клиента (код торговых счетов) от имени и за счет которого выступал Участник торгов.

Правилами клиринга могут быть установлены ограничения на заключение Участниками торгов, являющимися Участниками клиринга, Сделок Т+ за свой счет, за счет своих клиентов и/или за счет средств, находящихся в доверительном управлении, в зависимости от выполнения Участником торгов требований, установленных Правилами клиринга.

1.2.15. В случаях, установленных законодательством Российской Федерации и/или эмиссионными документами, для отдельной ценной бумаги или категории (типа) ценных бумаг Биржей может быть установлено ограничение на возможность заключения сделок определенными категориями Участников торгов и/или за счет определенных категорий клиентов Участников торгов, а также заключения Участниками торгов сделок за счет своих клиентов и/или за счет средств, находящихся в доверительном управлении.

1.2.16. В торгах внутренними ценными бумагами в Режиме торгов «РЕПО с акциями (в ин. валюте)», «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)» и «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)» могут принимать участие только Участники торгов УБ от своего имени и за свой счет.

1.2.17. Участники торгов обязаны исполнять свои обязательства по сделкам с ценными бумагами, а также способствовать исполнению сделок, заключенных от имени и за счет клиента, в соответствии с требованиями, определенными в настоящих Правилах, в порядке, установленном в Правилах клиринга.

1.2.18. Участники торгов обязаны соответствовать требованиям, установленным внутренними документами Биржи, законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

1.2.19. Участники торгов могут участвовать в торгах с рабочих мест, находящихся в торговых залах Технического(их) центра(ов), а также с удаленных рабочих

мест, находящихся вне торговых залов Технического(их) центра(ов).

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

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

- буквенно-цифровой код Участника торгов (далее - код Участника торгов).
- буквенно-цифровой код Участника торгов в Системе торгов (далее - идентификатор Участника торгов).
- буквенно-цифровой код Участника торгов в Системе торгов (далее – Торговый идентификатор).

1.2.20.2. Код Участника торгов и идентификатор Участника торгов отражаются в реестре заявок и реестре сделок, формируемых ФБ ММВБ по окончании каждого торгового дня. Торговые идентификаторы используются при подаче заявок, а также в качестве АСП Участника торгов в Секторе рынка Основной рынок.

1.2.20.3. Подача Участником торгов заявки с указанием любого из присвоенных Участнику торгов в соответствии с Правилами допуска Торгового идентификатора 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.

1.2.20.4. Код клиента, присваиваемый клиенту Участника торгов в соответствии с Правилами допуска, отражается в реестре заявок и реестре сделок, формируемых ФБ ММВБ по окончании каждого торгового дня. Краткий код клиента или код торговых счетов, присваиваемые клиенту Участника торгов в соответствии с Правилами допуска, используется при подаче Участником торгов заявок на заключение сделок в Системе торгов.

1.2.21. Объявление (подача в Систему торгов) заявок на ФБ ММВБ проводится по ценным бумагам, допущенным к торгам на ФБ ММВБ в соответствии с Правилами листинга. Заключение сделок на основании поданных заявок на ФБ ММВБ проводится по ценным бумагам, допущенным к торгам на ФБ ММВБ в соответствии с Правилами листинга, по которым наступила дата начала торгов. Объявление (подача в Систему торгов) заявок на совершение сделок РЕПО и заключение сделок на основании поданных заявок на ФБ ММВБ, помимо вышеуказанных случаев, может также проводиться по ценным бумагам, не допущенным к торгам на ФБ ММВБ в соответствии с Правилами листинга, но включенным Биржей в Список ценных бумаг, с которыми на торгах могут заключаться только сделки РЕПО. Решением Биржи может быть определена возможность объявления (подачи в Систему торгов) заявок с указанием реквизита «Дата активации» по ценным бумагам, по которым не наступила дата начала торгов в случае, если активация таких заявок происходит не ранее даты начала торгов по ценным бумагам. Внесение сведений (изменение сведений) в Системе торгов о допущенных к торгам на Бирже ценных бумагах (в том числе ценных бумагах, с которыми на торгах могут заключаться только сделки РЕПО), а также об условиях проведения торгов по ним, может осуществляться на основании:

- решения Биржи, в котором определены реквизиты (параметры) допущенной к размещению или обращению ценной бумаги, либо ценной бумаги, с которой на торгах могут заключаться только сделки РЕПО;
- решения 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;

- решения Биржи, в котором определены особенности проведения торгов с ценными бумагами, с которыми на торгах могут заключаться только сделки РЕПО;
- иных документов, являющихся основанием для принятия решения в соответствии с Правилами листинга и настоящими Правилами.

1.2.22. В случае исполнения обязательств по сделке с акциями после даты составления списка лиц, имеющих право на участие в общем собрании акционеров, и до даты проведения общего собрания акционеров, у Продавца по такой сделке отсутствует обязанность выдать Покупателю доверенность на голосование или голосовать на общем собрании акционеров в соответствии с указаниями Покупателя, если только иное не предусмотрено в отдельном соглашении, заключенном между контрагентами по такой сделке.

1.2.23. Настоящие Правила, а также изменения и дополнения в Правила утверждаются Советом директоров ФБ ММВБ и вступают в силу после регистрации их Центральным банком Российской Федерации в установленную Биржей дату.

1.2.24. Текст утвержденных Советом директоров ФБ ММВБ и зарегистрированных Центральным банком Российской Федерации Правил (изменений и дополнений в них) раскрывается через представительство ФБ ММВБ в сети Интернет. 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 5 (пять) дней до даты вступления в силу Правил (изменений и дополнений в них), если иной срок не определен федеральным законом. 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.

Подраздел 1.3. Расписание предоставления услуг

1.3.1. Торги на Бирже проводятся ежедневно, кроме установленных в соответствии с законодательством Российской Федерации выходных и нерабочих праздничных дней. Биржа вправе принять решение об отмене проведения Торгов в установленный в соответствии с законодательством Российской Федерации рабочий день и (или) о проведении Торгов в установленный в соответствии с законодательством Российской Федерации выходной или нерабочий праздничный день.

1.3.2. Торговый день состоит из Основной торговой сессии текущего Рабочего дня и Дополнительной торговой сессии предыдущего Рабочего дня.

1.3.3. Время начала Основной торговой сессии в Секторе рынка Основной рынок: 9:00 (по моск.вр.); время окончания Основной торговой сессии в Секторе рынка Основной рынок: 20:00 (по моск. вр.).

Время начала Дополнительной торговой сессии в Секторе рынка Основной рынок (в случае ее проведения): 20:00 (по моск.вр.), но не ранее времени окончания Основной торговой сессии в Секторе рынка Основной рынок; время окончания Дополнительной торговой сессии в Секторе рынка Основной рынок (в случае ее проведения): 24:00 (по моск. вр.).

1.3.4. Время начала Основной торговой сессии в Секторе рынка Standard: 10:00 (по моск.вр.). Время окончания Основной торговой сессии в Секторе рынка Standard: 18:45 (по моск.вр.).

Время начала Дополнительной торговой сессии в Секторе рынка Standard: 19:00 (по

моск.вр.), но не ранее времени окончания Основной торговой сессии в Секторе рынка Standard. Время окончания Дополнительной торговой сессии в Секторе рынка Standard: 23:50 (по моск.вр.).

1.3.5. Время начала Основной торговой сессии в Секторе рынка Classica: 10:00 (моск.вр.). Время окончания Основной торговой сессии в Секторе рынка Classica: 18.45 (моск.вр.).

1.3.6. Возможность проведения торгов в рамках Дополнительной торговой сессии устанавливается Биржей.

1.3.7. Биржа приостанавливает торги по ценной бумаге (ценным бумагам) и возобновляет их в случаях, предусмотренных законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

1.3.8. Подведение итогов торгов (торговых сессий), подготовка отчетных документов по итогам торгов (торговых сессий), в порядке, установленном в Подразделе 1.15. настоящих Правил, и направление их Участникам торгов осуществляется в следующие сроки:

- выписка из реестра сделок, заключенных Участником торгов в течение Основной торговой сессии – в течение одного часа с момента окончания Основной сессии текущего Торгового дня;

- выписка из реестра сделок, заключенных Участником торгов в течение Дополнительной торговой сессии текущего Торгового дня – в течение одного часа с момента окончания основной торговой сессии следующего Торгового дня;

- выписка из реестра заявок, поданных Участником торгов в течение Основной торговой сессии и Дополнительной торговой сессии текущего торгового дня – до окончания следующего Торгового дня (предоставляется по письменному запросу Участника торгов);

- отчетные документы, предусмотренные п. 1.15.4. настоящих Правил, за исключением вышеуказанных выписок из реестра сделок и выписок из реестра заявок - до наступления времени начала торгов следующего Торгового дня.

1.3.9. В случаях, предусмотренных в Подразделе 1.12. «Порядок приостановления, прекращения и возобновления торгов» настоящих Правил и 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 ФБ ММВБ и/или через представительство ФБ ММВБ в сети Интернет и/или иным доступным способом.

1.3.10. 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 Подразделе 1.12. «Порядок приостановления, прекращения и возобновления торгов» настоящих Правил и в Приложении № 1 к настоящим Правилам), если иной срок уведомления не определен Биржей.

1.3.11. В случае если Биржа планирует проводить торги в выходные и/или праздничные дни, Биржа уведомляет Участников торгов о проведении торгов в такие дни, а также раскрывает информацию об этом на своем сайте в сети Интернет не позднее, чем за 3 (три) месяца до соответствующего Торгового дня.

Подраздел 1.4. Допуск к участию в торгах. Торговые идентификаторы.

1.4.1. К заключению сделок на Бирже допускаются Участники торгов. В целях совершения Участником торгов действий в Системе торгов, Биржей, в соответствии с Правилами допуска, с учетом требований законов и иных нормативных правовых актов Российской Федерации, а также иных внутренних документов Биржи, Участнику торгов присваиваются Торговые идентификаторы.

1.4.2. Участник торгов несет ответственность за все действия, совершаемые на Бирже с помощью Торговых идентификаторов. Биржа не несет ответственности за последствия ошибочных или несанкционированных действий Участников торгов или третьих лиц в случае незаконного/несанкционированного доступа и/или использования ими Торгового идентификатора

1.4.3. В целях обеспечения бесперебойного функционирования Системы торгов Биржа вправе приостановить возможность подачи, изменения и отзыва заявок с использованием отдельного Торгового идентификатора Участника торгов. Приостановка допускается в торговый день, в течение которого на протяжении установленного Биржей периода времени превышалось:

- установленное Биржей среднее допустимое количество действий в секунду, выполняемых в Системе торгов с использованием соответствующего Торгового идентификатора Участника торгов, или
- установленное Биржей среднее допустимое количество сообщений об ошибке в секунду, формируемых в Системе торгов вследствие ошибочных действий, выполняемых с использованием соответствующего Торгового идентификатора Участника торгов.

При этом для целей настоящего пункта Правил под действием, выполняемым с использованием соответствующего Торгового идентификатора Участника торгов в Системе торгов, понимается: объявление (подача) заявки, отзыв заявки или изменение заявки.

Возможность подачи, изменения и отзыва заявок с использованием вышеуказанного отдельного Торгового идентификатора Участника торгов приостанавливается до получения информации об исправлении ошибок программного обеспечения, используемого Участником торгов (форма предусмотрена в Приложении № 10А к настоящим Правилам, формат электронного документа в Приложении № 9 к настоящим Правилам), а при повторном достижении критериев в течение данного торгового дня – до окончания данного торгового дня.

В случае приостановки возможности объявления (подачи), изменения и отзыва заявок, активные заявки, ранее поданные с использованием соответствующего Торгового идентификатора Участника торгов, могут быть сняты в порядке, предусмотренном в п. 1.5.10. настоящих Правил.

1.4.4. Действие пункта 1.4.3 не распространяется на подачу, изменение и отзыв заявок в Секторе рынка Standard и Секторе рынка Classica. Особенности подачи, изменения и отзыва заявок в Секторе рынка Standard и Секторе рынка Classica устанавливаются в Разделах 3 и 4 настоящих Правил, соответственно.

Подраздел 1.5. Маклер

1.5.1. 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.

1.5.2. Маклер назначается из числа работников Биржи.

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

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

1.5.5. Маклер имеет право:

- требовать неукоснительного исполнения Участниками торгов настоящих Правил;
- делать официальные объявления и сообщения по вопросам, связанным с порядком

проведения торгов;

- в случаях, предусмотренных Правилами допуска и иными внутренними документами ФБ ММВБ, исполнять решения об аннулировании Торгового идентификатора;

- исполнять решения о прекращении/приостановке допуска Участника торгов к участию в торгах в случаях, предусмотренных Правилами допуска и иными внутренними документами ФБ ММВБ

- исполнять решения о приостановке допуска Участника торгов к Системе торгов, о прекращении/приостановлении и возобновлении торгов в случаях и порядке, предусмотренных в Подразделе 1.12. «Порядок приостановления, прекращения и возобновления торгов» и п. 2 Приложения № 1 к настоящим Правилам.

1.5.6. Маклер осуществляет подготовку и подписание от имени Биржи отчетных документов, подтверждающих факт регистрации заявок и сделок в Системе торгов, а также иных документов по итогам торгов в соответствии с настоящими Правилами, если иное не определено Биржей.

1.5.7. 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 осуществления доступа в Систему торгов. Для этого Участник торгов должен направить в адрес ФБ ММВБ запрос (сообщение) о снятии поданных им активных (неудовлетворенных) заявок. Запрос (сообщение) передается только руководителем Участника торгов, контролером Участника торгов или курирующим вопросы осуществления операций на фондовом рынке сотрудником Участника торгов, указанным в Регистрационной карточке, телефонограммой либо посредством направления факсимильного сообщения и должен содержать следующие реквизиты:

а) Фамилия, Имя, Отчество и контактный телефон;

б) Идентификатор Участника торгов и Торговый идентификатор;

в) Номера активных (неудовлетворенных) заявок, поданных Участником торгов, которые необходимо снять, с указанием реквизитов заявок в соответствии с Подразделом 2.1. «Заявки» и/или Подразделом 3.3 Раздела 3 «Сектор рынка Standard» и/или Подразделом 4.2 Раздела 4 «Сектор рынка Classica» настоящих Правил или указание на то, что нужно снять все активные (неудовлетворенные) заявки, поданные Участником торгов, находящиеся в Системе торгов;

г) дата и время передачи телефонограммы (факсимильного сообщения), а также номер телефона Участника торгов, с которого она (оно) передается.

Биржа может предпринять достаточные с точки зрения Биржи действия для проверки правомочности отправки такой(го) телефонограммы(факсимильного сообщения).

В случае если реквизиты запроса корректны, а номера активных (неудовлетворенных) заявок, указанных в запросе (сообщении) Участника торгов, совпадают с находящимися в Системе торгов номерами активных (неудовлетворенных) заявок, поданных Участником, Маклер при наличии технической возможности осуществляет снятие заявок в соответствии с запросом(сообщением). В случае отсутствия данной возможности Маклер телефонограммой или средствами факсимильной связи уведомляет Участника торгов, направившего такой запрос, о невозможности снятия заявок.

В случае если номера активных (неудовлетворенных) заявок не совпадают с находящимися в Системе торгов, поданными Участником торгов, и/или реквизиты запроса (сообщения) некорректны – такой запрос отклоняется, о чем Маклер сообщает Участнику торгов телефонограммой или средствами факсимильной связи.

ФБ ММВБ не несет ответственности за убытки, которые могут возникнуть у

Участника торгов при исполнении его запроса (сообщения) о снятии активных (неудовлетворенных) заявок или при неисполнении этого запроса в случае, если номера активных (неудовлетворенных) заявок не совпадают с находящимися в Системе торгов, поданными Участником торгов, и/или реквизиты запроса (сообщения) некорректны.

1.5.8. Маклер обязан:

- исполнять решения Биржи;
- информировать уполномоченное лицо Биржи в случаях, установленных Биржей, о возникновении обстоятельств, которые могут являться основанием для приостановления торгов;
- 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 Биржи, связанные с порядком проведения торгов.

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

1.5.10. В случае приостановки возможности объявления (подачи), изменения и отзыва заявок с использованием отдельного Торгового идентификатора в соответствии с п. 1.4.3. настоящих Правил Маклер имеет право по требованию Участника торгов снимать неудовлетворенные заявки, поданные с использованием отдельного Торгового идентификатора. Для этого Участник торгов должен направить в адрес ФБ ММВБ запрос (сообщение) по форме, предусмотренной в п. 1.5.7. настоящих Правил, содержащий(ее) указание на то, что нужно снять все активные (неудовлетворенные) заявки, находящиеся в Системе торгов, поданные с использованием отдельного Торгового идентификатора, при этом указания номеров активных (неудовлетворенных) заявок, поданных Участником торгов не требуется.

В случае если реквизиты запроса корректны, Маклер при наличии технической возможности осуществляет снятие заявок в соответствии с запросом (сообщением). В случае отсутствия данной возможности Маклер телефонограммой или средствами факсимильной связи уведомляет Участника торгов, направившего такой запрос, о невозможности снятия заявок.

ФБ ММВБ не несет ответственности за убытки, которые могут возникнуть у Участника торгов при исполнении его запроса (сообщения) о снятии активных (неудовлетворенных) заявок или при неисполнении этого запроса в случае, если реквизиты запроса (сообщения) некорректны.

Подраздел 1.6. Маркет-мейкеры

1.6.1. Маркет-мейкерами могут быть Участники торгов, заключившие с Биржей договор, , предусматривающий добровольное принятие ими установленных в настоящем Подразделе Правил дополнительных обязательств подавать безадресные заявки на совершение сделки от своего имени и за свой счет либо от своего имени и за счет клиента при наличии соответствующих поручений клиента, содержащие указание о том, что они поданы при исполнении обязательств Маркет-мейкера без раскрытия соответствующей информации остальным участникам торгов (далее – заявка Маркет-мейкера) в установленных решением Биржи Секторах рынка (в периодах Режимов торгов соответствующего Сектора рынка).

1.6.2. Участник торгов начинает осуществлять функции Маркет-мейкера по

ценной бумаге после заключения соответствующего договора о выполнении функций Маркет-мейкера в порядке, определенном в Правилах допуска.

1.6.3. В целях поддержания цен ценных бумаг Маркет-мейкер в течение срока действия соглашения/договора о выполнении функций Маркет-мейкера принимает на себя обязательства подавать и одновременно поддерживать в Системе торгов двустороннюю котировку соответствующих ценных бумаг. Требования к величине спреда двусторонней котировки и/или предельного спреда, минимальному объему подаваемых заявок Маркет-мейкера (далее – объем двусторонней котировки), периоду времени, в течение которого Маркет-мейкер обязан подавать соответствующие заявки Маркет-мейкера (далее – период поддержания котировок), а также иные требования к обязательствам Маркет-мейкера устанавливаются Биржей.

Биржей могут быть установлены иные требования к условиям исполнения обязательств Маркет-мейкером, в том числе - период времени, в течение которого Маркет-мейкер вправе не исполнять обязательства, предусмотренные в настоящем Подразделе Правил (далее - котировальный перерыв, КПП).

1.6.4. В целях поддержания спроса или предложения на ценные бумаги Маркет-мейкер в течение срока действия соглашения/договора о выполнении функций Маркет-мейкера принимает на себя обязательства подавать только заявки Маркет-мейкера на покупку или только заявки Маркет-мейкера на продажу соответствующих ценных бумаг. Требования к порядку определения максимальной цены предложения на покупку или минимальной цены предложения на продажу по подаваемым заявкам Маркет-мейкера, минимальному объему заявок Маркет-мейкера, периоду времени, в течение которого Маркет-мейкер обязан подавать соответствующие заявки Маркет-мейкера, а также иные требования к обязательствам Маркет-мейкера устанавливаются Биржей.

1.6.5. Поддержание цены, спроса, предложения или объема, складывающихся на торгах, на которых заключаются сделки РЕПО, осуществляется Маркет-мейкером путем подачи и одновременного поддержания заявок Маркет-мейкера на заключение сделок РЕПО, по которым Маркет-мейкер является покупателем по первой части сделки РЕПО и заявок Маркет-мейкера, по которым Маркет-мейкер является продавцом первой части сделки РЕПО, с одинаковым сроком исполнения, но имеющие разную ставку РЕПО (далее - двусторонние котировки РЕПО).

Требования к максимальной разнице между ставкой РЕПО, содержащейся в заявке Маркет-мейкера на заключение сделки РЕПО, по которому Маркет-мейкер является покупателем по первой части сделки РЕПО, и ставкой РЕПО, содержащейся в заявке Маркет-мейкера на заключение сделки РЕПО, по которому Маркет-мейкер является продавцом по первой части сделки РЕПО (далее - спред двусторонней котировки РЕПО), требования к минимальному объему подаваемых заявок Маркет-мейкера, а также к периоду времени, в течение которого Маркет-мейкер обязан поддерживать двусторонние котировки РЕПО, порядок расчета спреда двусторонней котировки РЕПО и порядок определения максимального спреда двусторонней котировки РЕПО устанавливаются Биржей.

Биржей может быть установлен суммарный объем сделок РЕПО Маркет-мейкера, совершенных с каждой ценной бумагой в течение одного торгового дня (торговой сессии) в рамках исполнения обязательств, предусмотренных настоящим пунктом, по достижении которого Маркет-мейкер вправе подавать заявки Маркет-мейкера на заключение сделок РЕПО только одной направленности (Маркет-мейкер является покупателем по первой части сделки РЕПО или Маркет-мейкер является продавцом по первой части сделки РЕПО) в объеме не меньше минимального объема подаваемых заявок Маркет-мейкера или освобождается от указанных обязательств.

Между Биржей и Маркет-мейкером допускается заключение договора о выполнении обязательств Маркет-мейкера, в соответствии с условиями которого Маркет-мейкер вправе подавать заявки на заключение сделок РЕПО только одной направленности

(Маркет-мейкер является покупателем по первой части сделки РЕПО или Маркет-мейкер является продавцом по первой части сделки РЕПО). При этом Биржа устанавливает требования к минимальной или максимальной ставке РЕПО, минимальному объему подаваемых заявок Маркет-мейкера, а также к периоду времени, в течение которого Маркет-мейкер обязан подавать соответствующие заявки.

1.6.6. Биржей может быть установлен суммарный объем сделок Маркет-мейкера, совершенных с каждой ценной бумагой в течение одного торгового дня (торговой сессии) в рамках исполнения обязательств, предусмотренных п. 1.6.3. настоящих 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, ДО). При этом (если иное не предусмотрено решением Биржи) проверяется выполнение следующего условия:

- В случае выставления Маркет-мейкером только заявки Маркет-мейкера на покупку (продажу) отклонение цены в указанных заявках от текущей цены ценной бумаги не должно превышать половины величины предельного спреда, установленного для данной ценной бумаги. При этом цены заявок Маркет-мейкера на покупку (продажу) должны быть меньше (больше) текущей цены ценной бумаги.

1.6.7. При необходимости осуществления дополнительных мер, направленных на поддержание ликвидности на рынке отдельной ценной бумаги, Биржа вправе принять решение об ограничении видов заявок, которые вправе подавать в Систему торгов в соответствии с п. 2.1.6. настоящих Правил Участники торгов, не являющиеся Маркет-мейкерами, только лимитными заявками без сохранения в котировках и рыночными заявками.

1.6.8. Величины спреда двусторонней котировки и предельного спреда, рассчитывается в соответствии со следующими формулами:

- при установлении спреда двусторонней котировки и предельного спреда в процентах:

$$Спрэд = \frac{(C_{продажа} - C_{покупка})}{C_{покупка}} * 100\%,$$

- при установлении спреда двусторонней котировки и предельного спреда в денежных единицах:

$$Спрэд = C_{продажа} - C_{покупка}$$

где:

$C_{спред}$ – спред двусторонней котировки или предельный спред;

$C_{продажа}$ - лучшая (наименьшая) цена в заявках Маркет-мейкера на продажу – при определении спреда двусторонней котировки, или максимальная цена в заявках 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, - при определении предельного спреда;

$C_{покупка}$ - лучшая (наибольшая) цена в заявках Маркет-мейкера на покупку – при определении спреда двусторонней котировки, или минимальная цена в заявках 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, - при определении предельного спреда.

1.6.9. Биржа осуществляет ежедневный контроль за деятельностью Маркет-мейкеров в ходе соответствующей торговой сессии, который осуществляется по следующим показателям (если применимо):

- спред двусторонней котировки;
- объем двусторонней котировки;
- максимальный объем сделок, заключенных на основании двусторонних котировок, по достижении которого Маркет-мейкер освобождается от обязанности по поддержанию двусторонних котировок или обязан принять обязательства по выставлению только заявок на покупку или только заявок на продажу;
- период времени, в течение которого Маркет-мейкер подавал и (или) не подавал заявки Маркет-мейкера в рамках исполнения своих обязательств;
- иным показателям, установленным договором.

1.6.10. Биржа не реже одного раза в год осуществляет проверку деятельности Маркет-мейкеров по всем совершенным ими на торгах Биржи сделкам, в том числе и в связи с выполнением им обязательств Маркет-мейкера.

1.6.11. Решением Биржи может быть предусмотрено, что в целях поддержания Участником торгов цен на ценные бумаги в связи с размещением и обращением ценных бумаг в соответствии с договором, заключенным между Участником и эмитентом ценных бумаг (далее – Договор с эмитентом), Участники торгов могут подавать безадресные заявки на совершение сделки от своего имени и за свой счет либо от своего имени и за счет клиента при наличии соответствующих поручений клиента, содержащие указание о том, что они подана во исполнение обязательств по Договору с эмитентом без раскрытия соответствующей информации остальным участникам торгов (далее – заявка «Поддержание цен») в установленных таким решением Биржи Секторах рынка (в периодах Режимов торгов соответствующего Сектора рынка).

Подраздел 1.7. Шаг цены и шаг Ставки РЕПО

1.7.1. Для всех заявок (за исключением лимитных и рыночных заявок РЕПО (ЦК)) устанавливается шаг цены, под которым понимается минимально возможная разница между ценами, указанными в заявках одной направленности (покупка или продажа).

1.7.2. Величина шага цены для облигаций устанавливается равной 0,01 (ноль целых одна сотая) процента от номинальной стоимости облигации. Для остальных ценных бумаг величина шага цены устанавливается равной 0,01 (ноль целых одна сотая) рубля.

1.7.3. Иной шаг цены для отдельных ценных бумаг или категорий (типов) ценных бумаг в отдельных Режимов торгов может быть установлен решением Биржи.

1.7.4. Для заявок РЕПО (ЦК) устанавливается шаг Ставки РЕПО, под которым понимается минимально возможная разница между Ставками РЕПО, указанными в заявках одной направленности (привлечение денежных средств или размещение денежных средств).

1.7.5. Величина шага Ставки РЕПО в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки» устанавливается равной 0,01 (ноль целых одна сотая) процента годовых.

1.7.6. Иной шаг Ставки РЕПО для отдельных ценных бумаг или категорий (типов) ценных бумаг в отдельных Режимов торгов может быть установлен решением Биржи.

Подраздел 1.8. Стандартный лот

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

1.8.2. Размер стандартного лота устанавливается равным 1 (одной) ценной бумаге.

1.8.3. Иной размер стандартного лота для отдельных ценных бумаг или категорий (типов) ценных бумаг в отдельных режимах торгов может быть установлен решением Биржи.

Подраздел 1.9. Правила предотвращения, выявления и пресечения случаев неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком, а также меры по предотвращению дестабилизации рынка

1.9.1. В целях предотвращения, выявления и пресечения случаев неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком при организации торгов ценными бумагами на Бирже действует следующая система мер:

1.9.1.1. Биржа в соответствии с законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации осуществляет разработку, утверждение и контроль исполнения внутренних документов, определяющих:

- перечень инсайдерской информации Биржи;
- порядок передачи Бирже списков инсайдеров;
- порядок доступа к инсайдерской информации, правила охраны её конфиденциальности и требования по использованию указанной информации ЗАО «ФБ ММВБ» при осуществлении профессиональной деятельности по организации торговли на рынке ценных бумаг;
- порядок контроля за соблюдением мер, направленных на предотвращение неправомерного использования сведений, составляющих инсайдерскую информацию, и меры ответственности работников Биржи за действия, повлекшие неправомерное использование сведений, относящихся к инсайдерской информации Биржи; порядок и сроки раскрытия инсайдерской информации Биржи (за исключением инсайдерской информации Биржи, не подлежащей раскрытию в соответствии с законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации);
- порядок раскрытия по требованию инсайдера информации о совершенных им операциях с ценными бумагами, которые обращаются на торгах Биржи.

1.9.1.2. Биржа осуществляет контроль за заявками, поданными на Бирже, и сделками с ценными бумагами, заключенными на Бирже, а также за Участниками торгов, с использованием системы контроля, отвечающей требованиям законов и иных нормативных правовых актов Российской Федерации, которая предусматривает осуществление мониторинга торгов, в том числе путем мониторинга торгов с целью выявления нестандартных заявок (сделок) в соответствии с положениями Порядка организации мониторинга организованных торгов, а также контроля за участниками торгов и иными лицами ЗАО «ФБ ММВБ» и проверку их на предмет совершения действий, имеющих признаки неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынками.

1.9.1.3. 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;
- расчетная цена для целей определения отклонений цен;
- минимальный и/или максимальный объем заявки;
- перечень допустимых кодов расчетов;
- ограничение количества ценных бумаг, выраженного в лотах и указываемого в заявке.

Указанные ограничения устанавливаются решением Биржи, при этом может

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

1.9.1.4. Биржа осуществляет непрерывное предоставление в Центральный банк Российской Федерации сведений о ходе торгов ценными бумагами на Бирже, включая сведения о выставляемых Участниками торгов заявках и совершаемых ими сделках, а также иные сведения, установленные законодательством Российской Федерации о ценных бумагах.

1.9.1.5. 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.

1.9.2. 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 Биржи может быть определено, что при торгах данной акцией Участник торгов вправе подавать в Систему торгов только адресные заявки РПС и/или заявки на заключение сделок РЕПО.

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 Биржи.

Перечень акций, при торгах которыми действует указанное ограничение, устанавливается Биржей 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 Биржи).

1.9.3. В целях предотвращения дестабилизации рынка ценных бумаг, манипулирования рынком и использования методов недобросовестной торговли (нарушения требований об обязательных действиях в случае возникновения конфликта интересов, случаев неправомерного использования инсайдерской информации) устанавливается, что нарушением настоящих Правил могут быть признаны следующие действия Участников торгов, необусловленные объективными событиями, влияющими на рынок ценных бумаг, в ходе торгов:

1.9.3.1. 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 послеторгового аукциона;
- цены аукциона закрытия
- цены закрытия;
- текущей цены;
- средневзвешенной цены (текущей средневзвешенной цены);
- рыночной цены, рассчитываемой в порядке, установленном законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации;
- значения индексов, рассчитываемых Биржей.

1.9.3.2. Совершение сделки в ходе торгового периода, 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.

1.9.3.3. Совершение сделки на основании адресной заявки РПС, цена которой отличается от текущей средневзвешенной цены ценной бумаги более чем на 20%.

1.9.4. При совершении Участником торгов действий, указанных в п. 1.9.3. настоящих 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 за счет клиента).

Участник торгов обязан в течение 5-ти рабочих дней с момента получения данного запроса представить на Биржу письменное объяснение своих действий.

1.9.5. В случае предоставления Участником торгов неудовлетворительных объяснений совершения им действий, подпадающих под условия п. 1.9.3. настоящих Правил, или неполучения от Участника торгов объяснений в установленный срок, или при наличии оснований квалифицировать в соответствии с п. 1.9.3. настоящих Правил действия Участника торгов как нарушение настоящих Правил, Биржа имеет право применить к Участнику торгов меры ответственности, установленные в соответствии с п. 1.14.8. настоящих Правил, и/или обратиться в Центральный банк Российской Федерации.

Подраздел 1.10. Индексы

1.10.1. Биржа рассчитывает в соответствии с установленными Биржей методиками (правилами) следующие индексы:

- Фондовый индекс, используемый в целях приостановления торгов;
- иные индексы.

1.10.2. Методики (правила) расчета индексов (фондового индекса) утверждаются Биржей и подлежат согласованию с Открытым акционерным обществом «Московская Биржа ММВБ-РТС», в случае, если последнее является правообладателем товарных знаков, используемых в наименованиях фондовых индексов. Методики (правила) расчета Фондового индекса, а также методики (правила) расчета иных индексов могут разрабатываться при участии пользовательских комитетов при Дирекции Закрытого акционерного общества «Фондовая биржа ММВБ», осуществляющих свою деятельность в соответствии с положениями, утверждаемыми Биржей.

1.10.3. Фондовый индекс рассчитывается в соответствии с требованиями, предъявляемыми к фондовым индексам законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации, устанавливающими требования к деятельности по организации торговли на рынке ценных бумаг. Методика (правила) расчета Фондового индекса определяется документом, утверждаемым Биржей и подлежащим регистрации в Центральном банке Российской Федерации.

1.10.4. Фондовым индексом, используемым в целях приостановки торгов, является «Индекс ММВБ».

Подраздел 1.11. Уплата комиссионного вознаграждения

1.11.1. Участник торгов обязан уплачивать комиссионное и иные виды вознаграждения по сделкам с ценными бумагами, заключенным на Бирже в российских рублях и в иностранной валюте, (далее – комиссионное вознаграждение) в российских рублях в размере, установленном Советом директоров ФБ ММВБ.

1.11.2. 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 Режимов торгов, либо для всех Участников торгов одной категории на Бирже, либо для всех Участников торгов на Бирже,

заключивших соглашение/договор о выполнении функций Маркет-мейкера.

1.11.3. По сделкам, заключенным в Основную торговую сессию, комиссионное вознаграждение удерживается в день заключения сделки или на следующий расчетный день в порядке, определенном в Правилах клиринга.

1.11.4. По сделкам, заключенным в Дополнительную торговую сессию, Участник торгов обязан уплатить Бирже комиссионное вознаграждение на следующий расчетный день после заключения сделки, которое удерживается в порядке, определенном в Правилах клиринга.

1.11.5. Комиссионное вознаграждение по сделкам с ценными бумагами, заключенным на Бирже в иностранной валюте, определяется по курсу Банка России, установленному на дату совершения соответствующих сделок.

1.11.6. Размер комиссионного вознаграждения и его калькуляция раскрывается через представительство ФБ ММВБ в сети Интернет в порядке, предусмотренном во внутренних документах ФБ ММВБ, законах и иных нормативных правовых актах Российской Федерации.

1.11.7. В случае невозможности произвести удержание комиссионного вознаграждения в порядке, определенном в п. 1.11.3.-1.11.5. настоящих Правил, комиссионное вознаграждение удерживается в порядке, определенном в Правилах клиринга.

1.11.8. Неустойка, начисленная в связи с неисполнением обязательств по уплате комиссионного вознаграждения по сделкам, заключенным в Секторе рынка Основной рынок, в пользу Биржи, удерживается с Участников торгов, начиная со второго расчетного дня после даты неуплаты в порядке, определенном в Правилах клиринга.

1.11.9. 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.

Подраздел 1.12. Порядок приостановления, прекращения и возобновления торгов

1.12.1. Под приостановлением торгов в рамках настоящего подраздела понимается приостановка торгов в ходе их проведения, а также отсрочка начала проведения торгов.

1.12.2. Настоящий подраздел Правил регулирует порядок приостановления, прекращения и возобновления торгов в случае возникновения обстоятельств, нарушающих или могущих нарушить нормальный порядок проведения торгов, к которым, в частности, относятся: технические сбои в работе средств проведения торгов (включая сбои в работе программного обеспечения); попытки несанкционированного доступа к средствам проведения торгов; сбои в работе систем связи, электроснабжения; обстоятельства непреодолимой силы; невозможность надлежащего функционирования Клиринговой организации и/или иных организаций, деятельность которых влияет на возможность проведения торгов.

1.12.3. Приостановление торгов возможно:

- в связи с фактической невозможностью проведения торгов;
- по решению Биржи.

Торги могут быть приостановлены полностью или частично.

1.12.4. Сроки раскрытия информации о приостановлении торгов:

1.12.4.1. В случае если торги были приостановлены в результате технического сбоя в работе средств проведения торгов, Биржа обязана раскрыть информацию об этом не позднее чем через 15 (пятнадцать) минут после обнаружения технического сбоя.

1.12.4.2. В случае если торги были приостановлены по решению Биржи,

Биржа раскрывает информацию об этом незамедлительно после принятия решения о приостановлении.

1.12.5. После прекращения обстоятельств, послуживших основанием для приостановления торгов, торги подлежат возобновлению. В случае приостановления торгов, вызванного техническим сбоем в работе средств проведения торгов, Биржа раскрывает информацию о времени возобновления торгов и предоставляет Участникам торгов возможность отозвать активные заявки посредством средств проведения торгов не менее чем за 15 (пятнадцать) минут до возобновления торгов.

В случае невозможности отзыва активных заявок посредством средств проведения торгов, Участник торгов может предоставить Бирже заявление на снятие активных заявок с использованием телефонной или факсимильной связи. Биржа после получения такого заявления снимает (при наличии такой возможности) активные заявки данного Участника торгов. При рассмотрении споров Биржа и Участник торгов вправе использовать запись телефонных переговоров в качестве доказательства факта направления Участником торгов указанного заявления на снятие активных заявок.

1.12.6. В случае если обстоятельства, повлекшие приостановку торгов, не прекращаются, Биржа вправе прекратить торги в данный торговый день.

1.12.7. Информация обо всех случаях приостановления, прекращения и возобновления торгов раскрывается через представительство Биржи в сети Интернет. Информация о возникновении технического сбоя также доводится до сведения Участников торгов (при наличии такой возможности) иным доступным способом.

1.12.8. Если в течение текущего торгового дня приостановленные торги были возобновлены менее чем за один час до окончания основной торговой сессии, Биржа вправе продлить основную торговую сессию после истечения времени, предусмотренного настоящими Правилами торгов для ее проведения. Информация о продлении основной торговой сессии раскрывается через представительство Биржи в сети Интернет.

Подраздел 1.13. Контроль за соблюдением Участниками торгов Правил проведения торгов и использованием Биржевой информации

1.13.1. Биржа осуществляет контроль за соблюдением Участниками торгов настоящих Правил, в том числе за операциями, осуществляемыми на организованных торгах в порядке, предусмотренном Подразделом 2.5. «Порядок взаимодействия с клиринговой организацией. Порядок исполнения сделок», Подразделом 4.9. «Порядок исполнения сделок в Секторе рынка Classica» настоящих Правил и Правилами клиринга.

1.13.2. По сделкам, заключаемым в соответствии с Подразделами 2.8.- 2.10., 2.12.-2.19 настоящих Правил, решением Биржи может предусматриваться уплата фиксированного возмещения и/или переменного возмещения.

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

1.13.3.1. При неисполнении Участником торгов обязательства по поставке ценных бумаг по сделке с кодом расчетов B0-B30 данный Участник торгов:

- обязан уплатить в порядке, установленном в Правилах клиринга, 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 Дату исполнения сделки или в следующий расчетный день после Даты исполнения) и ценой за одну ценную бумагу, указанной в сделке;

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

1.13.3.2. При неисполнении Участником торгов обязательства по

уплате денежных средств по сделке с кодом расчетов В0-В30 данный Участник торгов:

- обязан уплатить в порядке, установленном в Правилах клиринга, 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 Дату исполнения сделки или в следующий расчетный день после Даты исполнения);

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

1.13.3.3. При неисполнении Участником торгов обязательств (по уплате денежных средств или по поставке ценных бумаг) по сделке с кодом расчетов В0-В30 данный Участник торгов обязан уплатить 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, на объем данной сделки.

1.13.3.4. При неисполнении Участником торгов обязательства по поставке ценных бумаг по второй части сделки РЕПО, по сделке, заключенной на условиях нецентрализованного клиринга, данный Участник торгов:

- обязан уплатить в порядке, установленном в Правилах клиринга, 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 Дату исполнения второй части сделки РЕПО или в следующий расчетный день после Даты исполнения второй части сделки РЕПО) и ценой второй части сделки РЕПО;

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

1.13.3.5. При неисполнении Участником торгов обязательства по уплате денежных средств по второй части сделки РЕПО, по сделке, заключенной на условиях нецентрализованного клиринга, данный Участник торгов:

- обязан уплатить в порядке, установленном в Правилах клиринга, 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 Дату исполнения второй части сделки РЕПО или в следующий расчетный день после Даты исполнения второй части сделки РЕПО);

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

1.13.3.6. При неисполнении Участником торгов обязательств (по уплате денежных средств или по поставке ценных бумаг) по первой или второй части сделки РЕПО, по сделке, заключенной на условиях нецентрализованного клиринга,

данный Участник торгов обязан уплатить 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.

1.13.3.7. Переменное и фиксированное возмещение по сделке, заключенной на условиях нецентрализованного клиринга в иностранной валюте, удерживается в российских рублях по курсу Банка России на Дату прекращения исполнения соответствующих сделок в порядке, установленном в Правилах клиринга.

1.13.3.8. Участник торгов имеет право отказаться от получения переменного и фиксированного возмещения по сделке, заключенной на условиях нецентрализованного клиринга, обеспечив поступление на Биржу письменного уведомления по форме, предусмотренной в Приложении № 5 к настоящим Правилам, до даты уплаты переменного и фиксированного возмещения в соответствии с Правилами клиринга.

1.13.3.9. В случае если оба контрагента по сделке, заключенной на условиях нецентрализованного клиринга, не исполнили свои обязательства по данной сделке, то они не имеют взаимных обязательств по уплате фиксированного и переменного возмещения друг другу по данной сделке.

1.13.4. Уплата фиксированного возмещения или фиксированного и переменного возмещения контрагентом по сделке, 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 контрагентом, 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.

1.13.5. В случае неисполнения одним из контрагентов сделки/части сделки РЕПО (за исключением Сделки Т+), обязательства по которой исполняются путем подачи Отчета на исполнение, по которой Правилами торгов не предусмотрено заполнения реквизита заявки/сделки «фиксированное возмещение», а также по ценным бумагам, по которым не рассчитывается переменное возмещение урегулирование взаимных требований контрагентов, заключивших такую сделку, происходит в соответствии с требованиями Приложения №12 к настоящим Правилам.

1.13.6. При неисполнении Участником торгов (далее – Недобросовестная сторона), сделки/части сделки РЕПО (за исключением Сделки Т+, сделки РЕПО, заключенной в Режимх торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», а также сделки купли-продажи, заключенной в Режимх торгов «Размещение: Адресные заявки» и «Выкуп: Адресные заявки») и/или сделки купли-продажи (за исключением Сделки Т+), если такая возможность определена решением Биржи, другой Участник торгов, заключивший данную сделку (далее – Добросовестная сторона) в течение 14 (четырнадцати) дней после Даты исполнения такой сделки не позднее 13:00 любого рабочего торгового дня может направить Недобросовестной стороне требование о досрочном исполнении сделок, заключенных между ними. Такое требование о досрочном исполнении сделок направляется в соответствии с порядком, изложенном в Правилах клиринга Клиринговой организации, осуществляющей клиринг в Режимх торгов, в которых заключены такие сделки. При этом, если иное не определено решением Биржи, требование о досрочном исполнении

сделок может направляться в отношении следующих сделок, по которым на момент направления требования не наступила Дата исполнения (первоначальная сделка/часть сделки РЕПО, которая не была исполнена надлежащим образом, также может быть включена в требование, если по ней (по такой части сделки РЕПО) не наступила Дата прекращения исполнения):

- всех сделок РЕПО и сделок купли-продажи, либо
- всех сделок РЕПО (только если надлежащим образом не была исполнена сделка РЕПО), либо
- всех сделок купли-продажи (только если надлежащим образом не была исполнена сделка купли-продажи).

Включенные в требование о досрочном исполнении сделки купли-продажи и вторые части сделок РЕПО должны быть исполнены контрагентами до окончания торгов в рамках основной торговой сессии в дату подачи такого требования (Датой исполнения таких сделок (вторых частей сделок РЕПО) является дата подачи требования о досрочном исполнении). Если иное не определено решением Биржи, обязательства по включенным в требование о досрочном исполнении первым частям сделок РЕПО прекращаются без исполнения.

В требование о досрочном исполнении сделок не могут быть включены Сделки Т+, сделки РЕПО, заключенные в Режимах торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», сделки купли-продажи, заключенные в Режимах торгов «Размещение: Адресные заявки» и «Выкуп: Адресные заявки», а также сделки, заключенные, начиная с Даты прекращения исполнения не исполненной надлежащим образом первоначальной сделки.

Решением Биржи могут быть определены дополнительные особенности подачи требования о досрочном исполнении сделок.

1.13.7. При неисполнении Участником торгов своих обязательств по заключенным на Бирже сделкам к Участнику торгов могут быть применены виды ответственности, предусмотренные в Подразделе 1.14 «Ответственность за нарушение правил совершения операций на Бирже и использования Биржевой информации» настоящих Правил.

1.13.8. Неисполнение первой части сделки РЕПО, заключенной на условиях нецентрализованного клиринга, не является неисполнением обязательств по такой сделке РЕПО в случае, если до Даты исполнения такой сделки (включая Дату исполнения) Биржей была получена от Клиринговой организации информация об отказе контрагентов по данной сделке РЕПО от исполнения обязательств по первой части такой сделки РЕПО по обоюдному согласию.

1.13.9. В случае предоставления Клиенту Биржевой информации, Участник торгов обязан предупреждать Клиента в письменной форме (под роспись об ознакомлении), что Клиент может использовать Биржевую информацию исключительно в целях участия в торгах (принятия решения о выставлении/невыващении заявки, объявления (подачи) заявок Участнику торгов для заключения сделок с ценными бумагами на Бирже, ведения в системах бэк-офиса учета заключенных за счет Клиента сделок), а также о мерах ответственности за нарушения при использовании Биржевой информации, предусмотренных п. 1.14.5. настоящих Правил.

1.13.10. Биржа или лицо, действующее от имени Биржи, вправе осуществлять действия по проверке корректности использования Участником торгов Биржевой информации, предоставленной ему Биржей (далее – информационный аудит).

1.13.11. Информационный аудит проводится с предварительным уведомлением Участника торгов в порядке, исключающим создание каких-либо препятствий в осуществлении им своей профессиональной деятельности.

1.13.12. Условия и процедура проведения информационного аудита определены в «Порядке использования Биржевой информации, предоставляемой ОАО

Московская Биржа», утвержденном ОАО Московская Биржа, которое обладает правами на использование Биржевой информации в соответствии с договором, заключенным с Биржей. «Порядок использования Биржевой информации, предоставляемой ОАО Московская Биржа», раскрывается на официальном сайте ОАО Московская Биржа в сети Интернет.

Подраздел 1.14. Ответственность за нарушение правил совершения операций на Бирже и использования Биржевой информации

1.14.1. За нарушение правил совершения операций на Бирже Участник торгов несет ответственность, предусмотренную настоящими Правилами и законодательством Российской Федерации.

1.14.2. Установленные виды и размеры ответственности за нарушение настоящих Правил применяются по решению Биржи.

1.14.3. В случае нарушения Участником торгов правил совершения операций на Бирже Участнику торгов может быть объявлено официальное предупреждение.

1.14.4. В случае распространения и/или предоставления Участником торгов Биржевой информации третьим лицам, не являющимся Клиентами, неисполнения обязанности, предусмотренной п. 1.14.5. настоящих Правил, а также использования Участником торгов Биржевой информации с нарушением порядка, изложенного в п. 1.15.11. настоящих Правил, к Участнику торгов может быть применена одна из следующих мер ответственности:

- Предупреждение о нарушении в письменном виде;
- Штраф в размере 250 000 (Двести пятьдесят тысяч) рублей;
- Приостановление допуска к участию в торгах на срок до одного года;
- Прекращение допуска к участию в торгах.

1.14.5. В случае использования Клиентом Биржевой информации в целях, отличных от целей участия в торгах (принятия решения о выставлении/невывыставлении заявки, объявления (подачи) заявок Участнику торгов для заключения сделок с ценными бумагами на Бирже, ведения в системах бэк-офиса учета заключенных за счет Клиента сделок), Участник торгов обязан применить к Клиенту одну из следующих мер ответственности:

- Предупреждение о нарушении использования Биржевой информации в письменном виде;
- Приостановление предоставления Клиенту Биржевой информации до устранения допущенных Клиентом нарушений в отношении использования Биржевой информации;
- Прекращение предоставления Клиенту Биржевой информации.

1.14.6. Биржа раскрывает через представительство ФБ ММВБ в сети «ИНТЕРНЕТ» информацию о неисполнении Участником торгов обязательств по заключенной сделке всем заинтересованным лицам.

1.14.7. При неисполнении Маркет-мейкером обязательств, предусмотренных п. 1.6.3.-1.6.4. настоящих Правил, к ним может быть применен один из следующих видов ответственности:

- вынесение официального предупреждения Участнику торгов, заключившему с Биржей соглашение/договор о выполнении функций Маркет-мейкера;
- лишение Участника торгов статуса Маркет-мейкера (с расторжением в одностороннем порядке соответствующего соглашения/договора).

1.14.8. При совершении Участником торгов действий, указанных в п. 1.9.5 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;
- приостановление допуска к участию в торгах на Бирже на срок до 3 месяцев;
- прекращение допуска к участию в торгах на Бирже.

1.14.9. При неисполнении Участником торгов сделки с ценными бумагами, в том числе, в Дату исполнения, к данному Участнику торгов может применяться один из следующих видов ответственности:

- официальное предупреждение;
- наложение штрафа в размере 0,05% (ноль целых пяти сотых процента) от суммы неисполненного обязательства. Штраф уплачивается Бирже;
- приостановление допуска к участию в торгах в отдельных Режимах торгов/Секторах рынка или к заключению сделок с отдельными кодами расчетов;
- приостановление допуска к участию в торгах на Бирже на срок до 3 месяцев;
- прекращение допуска к участию в торгах на Бирже.

1.14.10. При неуплате Участником торгов компенсационного взноса в размере и порядке, определенном в соответствии с настоящими Правилами, на данного Участника торгов по решению Биржи может быть наложен штраф в размере 0,05% (ноль целых пяти сотых процента) от текущей суммы РЕПО по соответствующей сделке.

1.14.11. Решением Биржи может быть предусмотрена уплата Участниками торгов неустойки (штрафа) за ненадлежащее выполнение обязанности по обеспечению наличия денежных средств (ценных бумаг) в количестве, достаточном для заключения сделки по заявке в момент проведения процедуры контроля ее обеспечения, установленной в соответствии с п. 2.12.12. и 2.13.25 настоящих Правил. При этом размер неустойки (штрафа), определяемый решением Биржи, не может быть более 3% от объема, необеспеченной надлежащим образом Участником торгов заявки. Неустойка (штраф) подлежит уплате в пользу Биржи.

1.14.12. В случае неуплаты Участником торгов в установленные сроки и в установленных размерах штрафов Бирже, к данному Участнику торгов может применяться один из следующих видов ответственности:

- приостановление допуска к участию в торгах на Бирже на срок до торгового дня, следующего за днем получения Биржей подтверждения об уплате штрафа;
- прекращение допуска к участию в торгах на Бирже.

1.14.13. За неуплату в установленные сроки в установленных размерах комиссионного вознаграждения, к Участнику торгов может применяться один из следующих видов ответственности:

- уплата Бирже неустойки в размере 2% от суммы подлежащего уплате комиссионного вознаграждения за каждый день просрочки (в Секторе рынка Основной рынок);
- приостановление допуска к участию в торгах на Бирже на срок до торгового дня, следующего за днем получения Биржей подтверждения об уплате комиссионного вознаграждения;
- прекращение допуска к участию в торгах на Бирже.

1.14.14. Удержание с Участника торгов неустойки, предусмотренной в п.п. 1.14.11. и 1.14.13. настоящих Правил, осуществляется в порядке, предусмотренном в Правилах клиринга.

1.14.15. В случаях, не предусмотренных в п. 1.14.14. Правил, штраф, взыскиваемый Биржей с Участника торгов, должен быть уплачен в течение 5 банковских дней со дня получения Участником торгов от Биржи уведомления о наложении штрафа, если иной порядок уплаты штрафа не установлен решением Биржи.

- Подлежащие взысканию ФБ ММВБ штрафы по сделкам, заключенным в иностранной валюте, уплачиваются в российских рублях по курсу Банка России, установленному на дату принятия Биржей решения о наложении штрафа.

1.14.16. Неисполнение Участниками торгов – контрагентами обязательств по сделке с кодами расчетов В0-В30, Уп или обязательств по первой и/или второй части сделки РЕПО в связи с приостановлением/прекращением торгов по ценной бумаге на Бирже, в том числе, в связи с конвертацией, объединением выпусков или досрочным погашением 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 приостановление/прекращение торгов по ценной бумаге повлекло невозможность исполнения обязательств по заключенной сделке в порядке, установленном настоящими Правилами и Правилами клиринга.

1.14.17. За нарушение требований в отношении порядка разрешения споров, а также правил поведения сторон при разрешении споров в соответствии с Подразделом 1.16. «Порядок разрешения споров» настоящих Правил к Участнику торгов может быть применен один из следующих видов ответственности:

- вынесение официального предупреждения Участнику торгов;
- приостановление допуска к участию в торгах на Бирже на срок, установленный решением Биржи;
- прекращение допуска участию в торгах на Бирже.

Подраздел 1.15. Подведение итогов торгов. Биржевая информация

1.15.1. Не позднее одного часа с момента окончания торгов (торговых сессий) Биржа проводит сверку сделок, заключенных на Бирже, с данными по заключенным сделкам, переданными в ходе торгов (торговых сессий) из Системы торгов Биржи в Клиринговую организацию в соответствии с внутренними документами ФБ ММВБ и Правилами клиринга.

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

1.15.1.2. При выявлении по результатам сверки сделок, не соответствующих требованиям настоящих Правил, Биржа вправе принять решение об отмене результатов торгов (торговых сессий) (частично или полностью).

1.15.2. Раскрытие Участникам торгов текущей информации о торгах (торговых сессиях), а также информации об итогах торгов (торговых сессий) (в том числе отчетных документов об итогах торгов (торговых сессий)) осуществляется в соответствии с требованиями внутренних документов Биржи, законов и иных нормативных правовых актов Российской Федерации.

Требования к содержанию отчетных документов, предусмотрены в Приложениях № 2, № 3, № 3А, № 4, № 6, № 6А, № 7, № 7А, и № 8 к настоящим Правилам. Формы данных документов могут быть дополнены отдельными расчетными, в том числе о размере предоставленной возвратной премии, если такая предусмотрена условиями обслуживания, и/или информационными показателями. При этом Участникам торгов предоставляется только информация, не относящаяся к инсайдерской информации и/или служебной информации и/или коммерческой тайне в соответствии с внутренними документами Биржи.

Раскрытие информации, содержащейся в реестре заявок и реестре сделок, не относящейся к инсайдерской информации и/или 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.

По письменному запросу Участника торгов Биржа может предоставить информацию о наименовании контрагента по парной сделке, заключенной Центральным контрагентом, при условии получения от контрагента письменного согласия на предоставление такой информации. В отдельных случаях, в целях защиты прав и законных интересов инвесторов, Биржа вправе предоставить информацию о наименовании контрагента без получения письменного согласия контрагента по парной сделке.

Запрос Участника торгов должен содержать информацию о номерах сделок, по которым запрашивается информация о контрагенте по парной сделке, а также мотивированное обоснование необходимости предоставления такой информации.

1.15.3. Биржа в соответствии с требованиями законов и иных нормативных правовых актов Российской Федерации формирует и предоставляет каждому из Участников торгов информацию в срок и объеме, определенными законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации и настоящими Правилами.

1.15.4. В Секторе рынка Основной рынок после окончания торгов, и/или торговой сессии, и/или торгов в отдельном Режиме торгов, и/или окончания отдельных периодов соответствующих Режимов торгов и/или в процессе проведения торгов в соответствующих Режимов торгов в Системе торгов формируются следующие отчетные документы каждому Участнику торгов:

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

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

1.15.4.3. Выписка по обязательствам Участника торгов по уплате возмещения (форма предусмотрена в Приложении № 4 к настоящим Правилам, формат электронного документа в Приложении № 9 к настоящим Правилам).

1.15.4.4. Уведомление о необходимости внесения компенсационных взносов, в случае возникновения соответствующих обязательств (форма предусмотрена в Приложении № 6 к настоящим Правилам, формат электронного документа в Приложении № 9 к настоящим Правилам).

1.15.4.5. В дополнение к отчетным документам, указанным в п.п. 1.15.4.1. – 1.15.4.4. настоящего пункта Правил, в Системе торгов формируются следующие отчетные документы:

- В случае изменения Суммы РЕПО в соответствии с п. 2.9.6.3. настоящих Правил Биржа направляет Участникам торгов Уведомление об изменении расчетных параметров сделки РЕПО (форма предусмотрена в Приложении № 6А 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, или в дату, установленную Биржей.

- По окончании периода сбора заявок в Режимов 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 № 7 к настоящим Правилам, формат электронного документа в Приложении № 9 к настоящим Правилам). В случае проведения Аукциона по заявлению Банка России в Режимов 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), а по окончании периода сбора заявок, установленного в соответствии с п.п. 2.12.6. и. 2.13.16. настоящих Правил Эмитенту и/или Участнику торгов, выступающему по поручению Эмитента, направляется Сводный реестр заявок (Тип №2) (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 № 7А 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 № 7А к настоящим Правилам, формат электронного документа в Приложении № 9 к настоящим Правилам).

- Выписка из реестра полученных адресных заявок (выписка из реестра заявок, содержащая информацию о полученных Участником торгов адресных заявках), 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).

1.15.5. Отчетные документы, указанные в пункте 1.15.4. настоящих Правил, направляются в форме электронных документов в соответствии с Правилами ЭДО, за исключением Сводного реестра заявок, Сводного реестра заявок (Тип №2) 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 1.15.4 настоящих Правил, является их формирование и направление в форме электронных документов в соответствии с Правилами ЭДО.

Выписка по обязательствам Участника торгов по уплате возмещения направляется сторонам по сделке до момента уплаты в порядке, установленном в Правилах клиринга, возмещения Участником торгов Участнику торгов – контрагенту по сделке, либо до момента прекращения допуска к участию в торгах Участника торгов.

1.15.6. Участнику торгов отчетные документы, указанные в пункте 1.15.4. настоящих Правил, могут быть выданы в бумажной форме на основании письменного запроса. Для получения отчетных документов, указанных в пункте 1.15.4 настоящих Правил, в бумажной форме Участник торгов обязан предоставить на Биржу список лиц, уполномоченных от его имени получать отчетные документы (по форме, предусмотренной в Правилах допуска).

1.15.7. В случае обнаружения ошибок в ранее отправленных Участнику торгов отчетных документах (в форме электронных документов), указанных в пункте 1.15.4. настоящих Правил, Участнику торгов отправляется электронный документ «Уведомление об ошибке» (по форме, предусмотренной в Приложении № 10 к настоящим Правилам).

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

1.15.9. В соответствии с требованиями законов и иных нормативных правовых актов Российской Федерации осуществляет ведение реестра заявок, поданных Участниками торгов (далее – реестр заявок). Реестр заявок, поданных в Секторе рынка Основной рынок, за каждый день, в который проводятся торги, формируется в электронной форме после окончания торгов. Реестр заявок содержит следующие

сведения:

- идентификационный номер заявки;
- вид заявки (в соответствии с п. 2.1.6 настоящих Правил)(в соответствии с п. 2.1.8. настоящих Правил вид заявки указывает на то, что заявка адресована конкретному Участнику торгов либо всем Участникам торгов);
- указание на то, что заявка подана во исполнение обязательств Маркет-мейкера, если заявка подана во исполнение указанных обязательств;
- указание на то, что заявка подана во исполнение обязательств по Договору с эмитентом;
- номер совокупной заявки РЕПО (ЦК) (для лимитных заявок РЕПО (ЦК), зарегистрированных посредством подачи совокупной заявки РЕПО (ЦК));
- приоритет подбора ценных бумаг (в случае указания в заявке);
- направленность заявки;
- наименование ценной бумаги либо наименование (код) Списка ценных бумаг;
- цена одной ценной бумаги, при условии ее указания, или цена первой части сделки РЕПО, при условии ее расчета;
- цена-ограничитель, при условии ее указания (для заявок КП);
- количество ценных бумаг (в случае указания в заявке);
- видимое количество ценных бумаг;
- ставка РЕПО (для адресных заявок РЕПО (акции), адресных заявок РЕПО (облигации), лимитных заявок РЕПО (ЦК), рыночных заявок РЕПО (ЦК) и адресных заявок РЕПО (ЦК));
- сумма РЕПО, включая НКД (при условии его расчета по ценной бумаге) или не включая НКД;
- начальное значение дисконта (для заявок на заключение сделок РЕПО на условиях нецентрализованного клиринга) либо дисконт (для заявок на заключение Сделок Т+ в Режимх торгов «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки», «РЕПО с ЦК – Адресные заявки»);
- срок сделки РЕПО (для заявок на заключение сделок РЕПО на условиях нецентрализованного клиринга);
- максимальное предельное значение дисконта (для заявок на заключение сделок РЕПО на условиях нецентрализованного клиринга);
- минимальное предельное значение дисконта (для заявок на заключение сделок РЕПО на условиях нецентрализованного клиринга);
- ставка фиксированного возмещения (в случае указания в заявке);
- код Участника торгов, подавшего заявку;
- код клиента Участника торгов, за счет которого подана заявка и код клиента (клиентов) брокера (управляющего), являющегося клиентом Участника торгов, за счет которого подана заявка;
- код Участника торгов, которому адресована заявка (для заявок, адресованных конкретному Участнику торгов) либо код Участника торгов, заявка которого может быть признана допустимой встречной (в случае подачи адресной заявки на заключение сделки на условиях централизованного клиринга);
- 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 Режимх торгов «Размещение: Адресные заявки», «Выкуп: Адресные заявки», для заявок на заключение сделок РЕПО);
- дата и время отмены заявки;

- дата и/или время активации заявки (для заявок в Режимы торгов «Размещение: Аукцион», «Размещение: Адресные заявки», «Выкуп: Аукцион», «Выкуп: Адресные заявки», «Исполнение обязательств по срочным контрактам»);

- реквизит заявки «Частичное обеспечение/отступное» (для заявок в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки», в случае указания в заявке);

- код расчетов (тип расчетов);

- идентификатор Участника торгов;

- Торговый идентификатор (АСП Участника торгов);

- ссылка.

Указанием на то, что заявка подана во исполнение обязательств Маркет-мейкера, если заявка подана во исполнение указанных обязательств, является указание Участником торгов в заявке дополнительного признака «Заявка маркет-мейкера».

Указанием на то, что заявка подана во исполнение обязательств по Договору с эмитентом, является указание Участником торгов в заявке дополнительного признака «Поддержание цен».

1.15.10. В соответствии с требованиями законов и иных нормативных правовых актов Российской Федерации Биржа осуществляет ведение реестра сделок, совершенных Участниками торгов (далее – реестр сделок). Реестр сделок, заключенных в Секторе рынка Основной рынок, за каждый день, в который проводятся торги, формируется в электронной форме после окончания торгов. Реестр сделок 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. 2.1.6. настоящих Правил), (в соответствии с п. 2.1.8. настоящих Правил вид заявки указывает на то, что заявка адресована конкретному Участнику торгов либо всем Участникам торгов);

- указание на то, что сделка совершена на основании заявки, поданной во исполнение обязательств Маркет-мейкера, если сделка совершена на основании такой заявки;

- коды Участников торгов, совершивших сделку (подавших заявки, по которым была заключена сделка), либо код Участника торгов, совершившего сделку, и указание на то, что сделка заключена с Центральным контрагентом, в случае заключения сделки с Центральным контрагентом;

- коды клиентов Участников торгов на Бирже, за счет которых заключена сделка, и код клиента (клиентов) брокера (управляющего), являющегося клиентом Участника торгов, за счет которого подана заявка;

- 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, при условии ее расчета);

- сумма сделки (объем сделки);

- сумма РЕПО, включая НКД (при условии его расчета по ценной бумаге) или не включая НКД;

- начальное значение дисконта (для сделок РЕПО, заключенных на условиях нецентрализованного клиринга) либо дисконт (для Сделок Т+, заключенных в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки», «РЕПО с ЦК – Адресные заявки»);

- срок сделки РЕПО (для сделок РЕПО, заключенных на условиях нецентрализованного клиринга);

- максимальное предельное значение дисконта (для сделок РЕПО, заключенных на

условиях нецентрализованного клиринга);

- минимальное предельное значение дисконта (для сделок РЕПО, заключенных на условиях нецентрализованного клиринга);

- количество ценных бумаг;

- накопленный купонный доход (для сделок с облигациями);

- ставка РЕПО (для сделок РЕПО);

- ставка фиксированного возмещения (при наличии);

- номера заявок, на основании которых заключена сделка на условиях нецентрализованного клиринга;

- величина комиссионного вознаграждения Биржи, уплаченного по сделке;

- код расчетов (тип расчетов);

- ссылка.

Указанием на то, что сделка совершена на основании заявки, поданной во исполнение обязательств Маркет-мейкера, если сделка совершена на основании такой заявки, является указание Участником торгов в заявке дополнительного признака «Заявка Маркет-мейкера».

Указанием на то, что сделка заключена с Центральным контрагентом является заключение сделки в Режиме основных торгов, Режиме торгов «Квал.Инвесторы - Режим основных торгов», Режиме торгов «Неполные лоты», Режиме торгов «Облигации Д - Режим основных торгов», Режиме торгов «Акции Д – Режим основных торгов», Режиме торгов крупными пакетами ценных бумаг, Режиме торгов «Режим основных торгов Т+» либо, в случае заключения сделки в иных режимах торгов, указание кода Центрального контрагента.

1.15.11. Биржа является обладателем всей информации, связанной с ходом и итогами торгов (торговых сессий) на Бирже. Участники торгов используют предоставленную Биржей Биржевую информацию для целей участия в торгах (принятия решения о выставлении/невывыставлении заявок, объявления (подачи) заявок и совершения (заключения) сделок с ценными бумагами, ведения в системах бэк-офиса учета сделок, сверки, расчетов, необходимых для обеспечения участия в торгах) на Бирже. Для использования Участниками торгов Биржевой информации в системах автоматического принятия решения о выставлении/невывыставлении заявок, объявления (подачи) заявок и совершения (заключения) сделок с ценными бумагами) на Бирже, в т.ч. с использованием торговых алгоритмов, а также для использования Биржевой информации в системах риск-менеджмента требуется заключение договора с ОАО Московская Биржа. Любое иное использование Биржевой информации возможно только при условии заключения договора с ОАО Московская Биржа и в соответствии с положениями «Порядка использования Биржевой информации, предоставляемой ОАО Московская Биржа».

В случае распространения и/или предоставления Участником торгов и/или его Клиентом Биржевой информации или использования этой информации для расчета производных показателей (цифровые данные, в том числе индексы и индикаторы, рассчитанные на основе Биржевой информации) с целью их дальнейшего распространения, или в иных случаях, не предусмотренных настоящими Правилами, без заключения договора с ОАО Московская Биржа, Участник торгов несет ответственность, предусмотренную п. 1.14.4. Подраздела 1.14. «Ответственность за нарушение правил совершения операций на Бирже и использования Биржевой информации» настоящих Правил.

Не является нарушением настоящих Правил предоставление Участником торгов своему Клиенту Биржевой информации в объеме, необходимом целей участия в торгах, приведенных в пункте 1.13.9., а также Биржевой информации об итогах торгов в отношении сделок, совершенных в интересах этого Клиента. Использование Участниками торгов Биржевой информации в иных целях, не связанных с участием в торгах на Бирже, в том числе для расчета производных показателей (цифровые данные, в том числе индексы

и индикаторы, рассчитанные на основе Биржевой информации), с целью их дальнейшего распространения или в иных целях, не предусмотренных настоящими Правилами, не допускается без заключения договора с ОАО Московская Биржа.

Упомянутое в настоящем пункте требование обязательного заключения с ОАО Московская Биржа договора на использование Биржевой информации в целях, не связанных с участием в торгах на Бирже, не применяется в отношении Участников торгов категории «А», если такое использование Биржевой информации осуществляется ими в рамках функций, возложенных на таких Участников торгов законодательством Российской Федерации.

1.15.12. Состав раскрываемой Биржей Участникам торгов информации, связанной с ходом и итогами торгов на Бирже, предусмотрен требованиями законов и иных нормативных правовых актов Российской Федерации, иных нормативных правовых актов Российской Федерации и внутренними документами Биржи.

1.15.13. В отчетных документах, направляемых Участникам торгов по итогам торгов ценными бумагами, расчет параметров сделок РЕПО по которым осуществляется в соответствии с п.п. 2.9.7.10. п. 2.9.7. настоящих Правил, в информационных целях отражается информация о цене первой и/или второй части сделки РЕПО и/или объеме сделки РЕПО, расчет которых осуществляется в соответствии со следующим порядком:

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 за вычетом суммы НКД на Дату исполнения первой части сделки РЕПО (для бумаг номинированных в валюте, отличной от валюты, в которой заключена сделка РЕПО, рассчитывается исходя из курса валюты, установленного Банком России на дату заключения сделки);

Q – Количество ценных бумаг;

НКД рассчитывается каждый день информационно, исходя из курса иностранной валюты на текущую дату.

При этом перерасчет цены первой части сделки РЕПО с учетом изменения текущего курса иностранной валюты до даты исполнения первой части включительно не производится.

Цена второй части сделки РЕПО рассчитывается каждый день вплоть до Даты прекращения исполнения сделки РЕПО по следующей формуле:

$$P_2 = S_2 / Q, \text{ где}$$

P_2 – Цена за одну ценную бумагу по второй части сделки РЕПО;

S_2 – Стоимость обратного выкупа за вычетом суммы НКД.

НКД рассчитывается каждый день информационно, исходя из курса иностранной валюты на текущую дату;

Q – Количество ценных бумаг.

Точность расчета по ценной бумаге расчетных цен первой и второй частей сделок РЕПО совпадает со значениями, установленными для данных ценных бумаг в других режимах заключения сделок РЕПО.

Дополнительно к расчету цен 1 и 2 части сделки РЕПО осуществляется технологический расчет объема:

$$V = P * Q, \text{ где}$$

V – объем;

P – рассчитанная цена;

Q – Количество ценных бумаг.

Для сделок РЕПО, заключенных в Режимах торгов «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки», «РЕПО с ЦК – Адресные заявки», цены первой и второй частей сделки РЕПО не

являются условиями сделки РЕПО и рассчитываются в информационных целях по следующим формулам:

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

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 (при условии его расчета для данной ценной бумаги).

$$P_2 = S_2 / Q, \text{ где}$$

P_2 - Цена за одну ценную бумагу по второй части сделки РЕПО;

S_2 - Стоимость обратного выкупа за вычетом суммы НКД.

Q - Количество ценных бумаг.

Для сделок РЕПО, заключенных в Режимов торгов «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки», «РЕПО с ЦК – Адресные заявки» также производится технологический расчет объема, как Сумма РЕПО за вычетом суммы НКД.

$$V = S - N$$

V - объем;

S - Сумма РЕПО

N - НКД

1.15.14. Биржа формирует и ведет Реестр Заявок, объявленных в Секторе рынка Standard и в Секторе рынка Classica, в соответствии со следующим порядком:

1.15.14.1. Заявки, подаваемые Участниками торгов, подлежат регистрации в Реестре Заявок немедленно (с учетом п. 3.4.12. настоящих Правил), за исключением случаев, предусмотренных п. 1.15.14.2., 3.4.6. и 3.4.14.2. – 3.4.14.3., 4.3.7.2 – 4.3.7.3. настоящих Правил. Заявки, поданные в Секторе рынка Standard, регистрируются в Реестре Заявок немедленно по получении Биржей подтверждения Клиринговой организации возможности объявления таких Заявок.

1.15.14.2. Заявка не регистрируется в Реестре Заявок в случае, если Заявка подана с нарушением требований, установленных законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации и настоящими Правилами.

1.15.14.3. Реестр Заявок содержит:

- 1) идентификационный номер Заявки;
- 2) код Участника торгов, подавшего Заявку, включая код (коды, если Заявка подана по поручению или в интересах нескольких Клиентов) Клиента (Клиентов), по поручению или в интересах которого (которых) объявлена Заявка;
- 3) указание на то, что Заявка подана во исполнение обязательств Маркет-мейкера, если такая Заявка подана во исполнение указанных обязательств, или указание на то, что заявка подана во исполнение обязательств по Договору с эмитентом;
- 4) код Участника торгов, которому адресована Заявка (указывается, если Заявка является адресной);
- 5) направление сделки, подлежащей совершению на основании Заявки;
- 6) вид Заявки, в том числе адресная или безадресная;
- 7) код ценных бумаг;

- 8) номинальную стоимость одной ценной бумаги (если имеется);
- 9) цену одной ценной бумаги (для Заявки на продажу (покупку) ценных бумаг) или цену одной ценной бумаги по Первой части репо (для Заявки репо);
- 10) количество ценных бумаг, в отношении которого подана Заявка (в случае если Заявка исполнена частично, указывается количество ценных бумаг, составляющее неисполненную часть Заявки);
- 11) валюту сделки;
- 12) сумму сделки (для Заявки на продажу (покупку) ценных бумаг) или сумму Первой части репо (для Заявки репо);
- 13) валюту платежа;
- 14) дату и время регистрации Заявки в Реестре Заявок;
- 15) дату и время исполнения (полного/частичного) или удаления (отзыва) Заявки;
- 16) результат объявления Заявки (исполнена полностью, исполнена частично, удалена (отозвана)).

В случае если в соответствии с настоящими Правилами Заявка содержит более одной оферты на совершение сделки с ценными бумагами, сведения, указанные в п.п. 5, 7, 8, 9, 10, 12 настоящего пункта, указываются в отношении каждой оферты, содержащейся в Заявке.

1.15.14.4. Реестр Заявок содержит также следующие сведения в отношении Заявок репо:

- дату исполнения Первой части репо или, если Сделка репо заключается на условиях исполнения Первой части в день заключения этой сделки, указание на это обстоятельство;
- дату исполнения Второй части репо;
- ставку репо;
- указание на то, что установлена обязанность Покупателя по сделке репо передать Продавцу по сделке репо доход по ценным бумагам, в отношении которых заключена Сделка репо.

1.15.14.5. Реестр Заявок может содержать иные сведения, помимо предусмотренных п. 1.15.14.3 – 1.15.14.4 настоящих Правил.

1.15.15. Формирование Реестра сделок, заключенных на Торгах в Секторе рынка Standard и Секторе рынка Classica, осуществляется в соответствии с п. 1.15.15.1 – 1.15.15.2 настоящих Правил.

1.15.15.1. Биржа регистрирует сделки, заключенные на Торгах в Секторе рынка Standard и Секторе рынка Classica в Реестре сделок (далее – Реестр сделок) по мере их заключения.

1.15.15.2. Реестр сделок содержит:

- стандартные условия заключения и исполнения сделки (за исключением цены, категорий (типов), серий ценных бумаг);
- идентификационный номер сделки
- идентификационные номера Заявок, на основании которых совершена сделка;
- дату и время регистрации сделки;
- указание на то, что сделка совершена на основании Заявки, поданной во исполнение обязательств Маркет-мейкера, если такая сделка совершена на основании такой Заявки;
- коды Участников торгов, заключивших сделку, а в случае, если сделка заключена с

Клиринговой организацией, - код Участника торгов и код Клиринговой организации, включая коды Клиентов Участников торгов, по поручениям или в интересах которых заключена сделка, а в случае, если сделка заключена Участником торгов с Клиринговой организацией, - код Клиента и код Клиринговой организации;

- код ценных бумаг, являющихся предметом сделки, наименование эмитента (название паевого инвестиционного фонда и наименование его управляющей компании, индивидуальное обозначение, идентифицирующее ипотечные сертификаты участия, и наименование управляющего ипотечным покрытием), вид, категорию (тип), серию ценной бумаги, являющейся предметом сделки, а для депозитарных расписок дополнительно указываются: вид представляемых ценных бумаг; наименование эмитента представляемых ценных бумаг; соотношение одной депозитарной расписки и количества представляемых ценных бумаг, право собственности на которые удостоверяется одной депозитарной распиской данного выпуска;

- указание на то, что сделка заключена на основании адресной либо безадресной Заявки;

- номинальную стоимость одной ценной бумаги (если имеется);
- цену одной ценной бумаги;
- количество ценных бумаг;
- валюту сделки;
- сумму сделки; при этом сумма сделки округляется по правилам математического округления до второго десятичного знака, но не менее 0,01;
- валюту платежа;
- Условия перерегистрации ценных бумаг (кроме Сделок репо).

Сведения о Сделке репо указываются в Реестре сделок посредством внесения в этот Реестр отдельно сведений о Первой части репо и о Второй части репо с присвоением им единого идентификационного номера сделки.

Реестр сделок содержит также в отношении Сделок репо указание на то, что установлена обязанность Покупателя по сделке репо передать Продавцу по сделке репо доход по ценным бумагам, в отношении которых заключена Сделка репо.

При заключении сделок в отношении купонных облигаций сумма сделки включает в себя накопленный купонный доход на день перерегистрации этих облигаций. Порядок расчета накопленного купонного дохода устанавливается в соответствии с документами эмитента.

1.15.15.3. Реестр сделок может содержать иные сведения, помимо предусмотренных п. 1.15.15.2 настоящих Правил.

1.15.15.4. Формирование и предоставление Отчетов о сделках с ценными бумагами в Секторе рынка Standard и в Секторе рынка Classica осуществляются в порядке, предусмотренном Разделами 3 и 4 настоящих Правил.

Подраздел 1.16. Порядок разрешения споров.

1.16.1. 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 Открытом акционерном обществе «Московская Биржа ММВБ-РТС» (далее – Арбитражная комиссия при ОАО Московская Биржа) в соответствии с документами, определяющими ее правовой статус и порядок разрешения споров, действующих на момент подачи искового заявления (для сделок, заключенных в Секторе рынка Основной рынок) или Третейском суде НАУФОР в соответствии с его Регламентом, действующим на момент подачи искового заявления (для

сделок, заключенных в Секторе рынка Standard и Секторе рынка Classica, а также споров и разногласий между Участником торгов и любой из компаний, входящих в Группу «Московская Биржа») (далее – Третейские суды).

1.16.2. Решения Третейских судов признаются сторонами окончательными и обязательными для исполнения. Неисполненное добровольно решение Третейского суда подлежит принудительному исполнению в соответствии с законодательством Российской Федерации или законодательством иной страны места принудительного исполнения и международными соглашениями.

1.16.3. 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.

1.16.4. Участники торгов обязаны воздерживаться от действий, направленных на необоснованное затягивание процедуры рассмотрения спора в Третейском суде.

1.16.5. Участники торгов в случае передачи спора на разрешение в Третейский суд 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.

Участники торгов обязаны в максимально короткие сроки исполнять определения и решения, вынесенные Третейским судом. Участники торгов обязаны воздерживаться от совершения действий, направленных на необоснованное затягивание процедуры исполнения вынесенных решений и/или определений Третейского суда.

Раздел 2 Сектор рынка Основной рынок

Подраздел 2.1. Заявки

2.1.1. Заявки на заключение сделок подаются в электронном виде.

2.1.2. Виды заявок, а также требования к их содержанию определяются настоящим Подразделом Правил.

Подача заявок в Систему торгов осуществляется посредством электронных сообщений, содержащих АСП Участника торгов (Торговый идентификатор).

Присвоение и использование Торговых идентификаторов осуществляется в порядке, предусмотренном Правилами допуска.

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

2.1.4. Цены в заявках на заключение сделок с облигациями указываются в процентах от непогашенной на момент заключения сделки номинальной стоимости (если иное не установлено Биржей). Цены в заявках на заключение сделок с иными ценными бумагами указываются в российских рублях. По решению Биржи для отдельных ценных бумаг или в отдельном Режиме торгов цены могут указываться в иностранной валюте. Перечень ценных бумаг, сделки с которыми исполняются в иностранной валюте (сделки в иностранной валюте), или Режимов торгов, где заключаются сделки в иностранной валюте, устанавливается Биржей.

2.1.5. На торгах по ценным бумагам Участник торгов вправе подавать в Систему торгов все виды заявок, указанных в настоящем Подразделе Правил, с учетом особенностей, определенных в Подразделах 1.2., 2.3. и 2.4. настоящих Правил. Для отдельной ценной бумаги или категории (типа) ценных бумаг Биржей может быть установлен ограниченный перечень разрешенных видов заявок. Такое ограничение может

быть установлено как для отдельного(ых) Режима(ов) торгов, так и для всех Режимов торгов, для которых данные виды заявок являются разрешенными.

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

- лимитные заявки (с сохранением в котировках и без сохранения в котировках);
- 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;
- адресные заявки РПС;
- адресные заявки РЕПО (акции);
- адресные заявки РЕПО (облигации);
- адресные заявки РЕПО (корзина);
- 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»;
- заявки на заключение сделок в Режиме торгов крупными пакетами ценных бумаг (далее - заявки КП);
- лимитные заявки (АЗ);
- рыночные заявки (АЗ);
- заявки по цене аукциона закрытия;
- лимитные заявки РЕПО (ЦК);
- рыночные заявки РЕПО (ЦК);
- адресные заявки РЕПО (ЦК);
- совокупные заявки РЕПО (ЦК);
- заявки ИСК.

2.1.7. Подача в Систему торгов:

- лимитной заявки;
- 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);
- адресной заявки РЕПО (корзина);
- заявки КП;
- лимитной заявки (АЗ);
- рыночной заявки (АЗ);
- заявки по цене аукциона закрытия
- лимитной заявки РЕПО (ЦК);
- рыночной заявки РЕПО (ЦК);
- адресной заявки РЕПО (ЦК);
- совокупной заявки РЕПО (ЦК);
- заявки ИСК

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

2.1.8. Заявки, адресованные (информация о которых раскрывается) всем Участникам торгов, в том числе в случае, когда в соответствии с настоящими Правилами сделки на основании заявок заключаются с Центральным контрагентом, признаются безадресными. Все иные заявки признаются адресными.

2.1.9. Безадресные заявки могут быть анонимными и неанонимными. Адресные заявки могут быть только неанонимными. В случае если информация, позволяющая идентифицировать Участника торгов, подавшего безадресную заявку, не раскрывается в ходе торгов и/или по итогам торгов всем Участникам торгов, такая заявка признается анонимной. В случае если указанная информация раскрывается в ходе торгов и по итогам торгов всем Участникам торгов, заявка признается неанонимной.

2.1.10. Лимитная заявка, рыночная заявка, заявка послеторгового периода, заявка КП, лимитная заявка (АЗ), рыночная заявка (АЗ), заявка по цене аукциона закрытия, лимитная заявка РЕПО (ЦК), рыночная заявка РЕПО (ЦК) могут быть адресованы только всем Участникам торгов. Заявка ИСК может быть адресована только всем участникам торгов, принимающим участие в торгах в ходе Режимы торгов «Исполнение обязательств по срочным контрактам».

2.1.11. 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 (корзина), адресная заявка РЕПО (облигации), адресная заявка РЕПО (ЦК) может быть адресована только конкретным Участникам торгов.

2.1.12. Безадресная заявка на заключение сделок в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» и безадресная заявка на заключение сделок в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» может быть адресована только всем Участникам торгов.

2.1.13. Для отдельных видов заявок по отдельным ценным бумагам Биржей может быть предусмотрена возможность подачи заявок с указанием цены, рассчитанной на основе показателя доходности, и порядок расчета доходности. Для отдельных видов заявок возможна подача в Систему торгов заявки с указанием дополнительных признаков, уточняющих особенности заключения сделок, в соответствии с п. 2.1.14. настоящих Правил. Для таких заявок предусматривается возможность указания признаков по типу исполнения заявки:

по остатку:

- «Поставить в очередь»;
- «Снять остаток»;
- «Полностью или отклонить»;

по цене:

- «По одной цене»;
- «По разным ценам»;

При подаче заявки по типу исполнения заявки - по цене - возможно указание дополнительного подтипа «По средневзвешенной цене», при этом цена заявки автоматически устанавливается равной текущей средневзвешенной. Указание в заявке соответствующего признака по типу исполнения означает следующее:

2.1.13.1. Лимитные заявки, лимитные заявки (АЗ) и лимитные заявки РЕПО (ЦК) с признаком «Поставить в очередь» являются заявками с сохранением в котировках. Лимитные заявки, лимитные заявки (АЗ) и лимитные заявки РЕПО (ЦК) с признаками «Снять остаток» или «Полностью или отклонить» являются заявками без сохранения в котировках.

При использовании признака «Поставить в очередь» заявка ставится в очередь, заключение сделок происходит при наличии допустимых встречных заявок.

При использовании признака «Снять остаток» после заключения сделок неудовлетворенный остаток снимается.

Если заявка имеет признак «Полностью или отклонить», то заявка снимается при отсутствии допустимых встречных заявок, удовлетворяющих ее полностью.

2.1.13.2. При использовании признака «По одной цене» сделка заключается по цене первой допустимой встречной заявки, при условии, что она не хуже указанной в заявке цены, а неудовлетворенный остаток ставится в очередь по цене последней совершенной сделки по данной заявке. В случае, если в момент ввода заявки отсутствовали встречные заявки, заявка с признаком «По одной цене» ставится в очередь как заявка с указанием признака «Поставить в очередь».

При использовании признака «По разным ценам» сделка заключается по цене допустимых встречных заявок.

Возможно указание одновременно двух признаков «Полностью или отклонить» и «По одной цене», в этом случае заявка удовлетворяется по одной цене на весь объем или отклоняется Системой торгов.

2.1.14. В зависимости от вида заявки при ее подаче в Систему торгов указываются следующие реквизиты:

2.1.14.1. В лимитной заявке:

- вид заявки (лимитная заявка);
- 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 (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п. 1.1.1.20. настоящих Правил);
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиента (в том числе, эмитента ценных бумаг));
- АСП Участника торгов.

2.1.14.1.1. Допускается подача в Систему торгов лимитной заявки с указанием дополнительных признаков, уточняющих особенности заключения сделок по типу исполнения заявки, в соответствии с п. 2.1.13. настоящих Правил.

2.1.14.1.2. В случае регистрации в Системе торгов лимитной заявки с признаком «Полностью или отклонить» допустимыми встречными заявками являются встречные заявки, начиная с лучших цен, с ценами не большими, чем цена покупки (не меньшими, чем цена продажи), указанная в данной заявке, и совокупный объем которых не меньше указанного в подаваемой заявке. Допустимыми встречными заявками по отношению к лимитной заявке с указанием иных признаков являются встречные заявки, начиная с лучших цен, с ценами не большими, чем цена покупки (не меньшими, чем цена продажи), указанная в данной заявке.

2.1.14.1.3. В дополнение к реквизитам, предусмотренным в п. 2.1.14.1. настоящих Правил, при подаче лимитной заявки допускается указание дополнительного реквизита: «видимое количество ценных бумаг, выраженное в лотах» (далее – «видимое количество ценных бумаг»). Решением Биржи для отдельных периодов торгов и/или Режимов торгов указание такого дополнительного реквизита может быть запрещено. Такой подвид лимитной заявки для целей настоящих Правил в дальнейшем именуется - айсберг-заявка.

Участникам торгов раскрывается в очереди заявок информация об установленном при подаче заявки «видимом количестве ценных бумаг» или рассчитанном после заключения сделки значении «видимого количества ценных бумаг» (далее – «текущее видимое количество ценных бумаг»), оставшееся количество ценных бумаг в заявке не

раскрывается Участникам торгов в очереди заявок, т.е. является скрытым (далее – «скрытое количество ценных бумаг»).

2.1.14.1.4. Решением Биржи может устанавливаться, что при подаче заявки может осуществляться отклонение заявки, если нарушено установленное минимальное допустимое отношение значения «видимого количества ценных бумаг», указанного в заявке, к «скрытому количеству ценных бумаг», указанному в заявке, а также нарушено установленное ограничение минимального объема «видимого количества ценных бумаг» в валюте заявки или минимального значения реквизита «видимое количество ценных бумаг» в лотах. Для айсберг-заявки возможна подача в Систему торгов заявки с указанием следующих дополнительных признаков, уточняющих особенности заключения сделок по типу исполнения заявки:

по остатку:

- «Поставить в очередь»;

по цене:

- «По одной цене»;
- «По разным ценам».

2.1.14.1.5. При подаче лимитной заявки возможна подача в Систему торгов заявки с указанием следующих дополнительных признаков:

- «Заявка маркет-мейкера» - означает, что заявка подана в счет выполнения обязательств маркет-мейкера;
- «Поддержание цен» - означает, что заявка подана во исполнение обязательств по Договору с эмитентом.

2.1.14.1.6. Решением Биржи может быть предусмотрена возможность подачи Участником торгов в отдельных Режимх торгов и/или периодах Режимов торгов лимитной заявки, с указанием дополнительного признака «время активации заявки» - определяющего время в течение торгового дня, начиная с которого возможно заключение сделок на основании данной заявки (далее – время активации заявки).

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

2.1.14.2. 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. 1.1.1.20. настоящих Правил);
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиента (в том числе, эмитента ценных бумаг));
- АСП Участника торгов.

При подаче заявки послеторгового периода указание каких-либо дополнительных признаков, предусмотренных в п. 2.1.13. настоящих Правил, не допускается. Допустимыми встречными заявками по отношению к заявке послеторгового периода являются встречные заявки по цене послеторгового периода, начиная с заявки, зарегистрированной ранее остальных.

2.1.14.3. 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 (который включает НКД на Дату исполнения и комиссионное вознаграждение Биржи, Клиринговой организации и Технического центра);
- торгово-клиринговый счет;
- код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п. 1.1.1.20. настоящих Правил);
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиента (в том числе, эмитента ценных бумаг));
- АСП Участника торгов.

При подаче рыночной заявки указание каких-либо дополнительных признаков, предусмотренных в п. 2.1.13. настоящих Правил, не допускается. В случае регистрации в Системе торгов рыночной заявки на продажу/покупку допустимыми встречными заявками по отношению к ней являются встречные заявки, стоящие в очереди, начиная с минимальной цены покупки (максимальной цены продажи).

Подача рыночных заявок с указанием объема денежных средств, предназначенных для покупки ценных бумаг, допускается в аукционе закрытия Режиме основных торгов, аукционе закрытия Режиме торгов «Режим основных торгов Т+» и Режиме торгов «Размещение: Аукцион». Дополнительные особенности подачи и удовлетворения таких заявок при размещении ценных бумаг определяются настоящими Правилами и/или Биржей в соответствии с Решением о выпуске и/или иными документами, регламентирующими порядок проведения размещения ценных бумаг.

2.1.14.4. Условия заключения сделок на основании адресных заявок РПС предусмотрены в Подразделе 2.8. «Режим переговорных сделок» настоящих Правил. Условия заключения Сделок Т+ на основании адресных заявок РПС предусмотрены в Подразделе 2.21. «Порядок заключения сделок в Режиме торгов «РПС с ЦК» настоящих Правил.

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 (в случае подачи заявки на заключение сделки на условиях централизованного клиринга краткое наименование или идентификатор Участника торгов, заявка которого может быть признана допустимой встречной);
- направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу);
- наименование ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- цена за одну ценную бумагу;
- торгово-клиринговый счет;

- код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п. 1.1.1.20. настоящих Правил);
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиента (в том числе, эмитента ценных бумаг));
- АСП Участника торгов.

Дополнительно к вышеуказанным реквизитам может быть указан реквизит «ставка фиксированного возмещения (процент от объема сделки для адресной заявки с кодом расчетов В0-В30)».

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.

Допустимой встречной заявкой к адресной заявке РПС Участника торгов является заявка противоположной направленности со следующими совпадающими условиями:

- 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.

При этом заявка должна быть адресована Участнику торгов, подавшему допустимую встречную заявку, либо, в случае подачи адресной заявки РПС на заключение сделки на условиях централизованного клиринга, в заявке должно содержаться указание на Участника торгов, заявка которого может быть признана допустимой встречной.

2.1.14.5. Условия заключения сделок РЕПО предусмотрены в Подразделе 2.10. «Заключение сделок РЕПО на условиях нецентрализованного клиринга» настоящих Правил.

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 за счет клиента (в том числе эмитента ценных бумаг));
- ставка фиксированного возмещения (процент от Суммы РЕПО);
- код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п. 1.1.1.20. настоящих Правил);
- сумма РЕПО;
- ссылка (проверяемое поле, комментарий);
- начальное значение дисконта, %;
- максимальное предельное значение дисконта, %;

- минимальное предельное значение дисконта, %;
- количество ценных бумаг, в лотах;
- АСП Участника торгов.

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.

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 внутрисдневной 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 за счет клиента (в том числе эмитента ценных бумаг));
- ставка фиксированного возмещения (процент от Суммы РЕПО);
- код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п. 1.1.1.20. настоящих Правил);
- сумма РЕПО, включая НКД;
- начальное значение дисконта, %;
- ссылка;
- максимальное предельное значение дисконта, %;
- минимальное предельное значение дисконта, %;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- АСП Участника торгов.

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.

Допустимой встречной заявкой на заключение сделки РЕПО является заявка того же вида со следующими совпадающими условиями:

- вид заявки;
- 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.

При этом заявка должна быть адресована Участнику торгов, подавшему встречную допустимую заявку.

Если иное не предусмотрено решением Биржи, в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» допускается заключение сделки РЕПО в Системе торгов при совпадении в двух допустимых встречных адресных заявках РЕПО всех условий, определенных в настоящем пункте Правил, за исключением следующих условий:

- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- сумма РЕПО;
- начальное значение дисконта, %.

В таком случае вышеперечисленные условия сделки РЕПО определяются исходя из суммы РЕПО и начального значения дисконта в заявке с меньшей суммой РЕПО, в соответствии с п.п. 2.9.7.10.1. настоящих Правил.

При этом Участники торгов соглашаются с тем, что заявка РЕПО (акции)/заявка РЕПО (облигации) на продажу ценных бумаг, поданная в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», может быть удовлетворена частично.

В адресной заявке РЕПО (корзина) указываются следующие реквизиты:

- вид заявки (адресная заявка РЕПО (корзина));
- идентификатор Участника торгов, подавшего заявку;
- 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 внутрисдневной сделки РЕПО срок сделки РЕПО равен нулю);
- наименование (код) Списка ценных бумаг;
- тип расчетов (DVP1 или DVP3, в соответствии с Правилами клиринга);
- сумма РЕПО;
- АСП Участника торгов.

В адресной заявке РЕПО (корзина), также может быть указан приоритет подбора ценных бумаг. Приоритет подбора ценных бумаг указывается либо путем указания отдельной ценной бумаги, которая может быть передана по данной сделке, заключенной на основании подаваемой заявки, либо путем указания наименования (кода) дополнительного Списка ценных бумаг, состоящего из ценных бумаг, которые могут быть переданы по данной сделке, заключенной на основании подаваемой заявки.

Допустимой встречной заявкой к адресной заявке РЕПО (корзина) является заявка того же вида со следующими совпадающими условиями:

- вид заявки (адресная заявка РЕПО (корзина));
- ставка РЕПО в процентах годовых;
- срок сделки РЕПО;
- наименование (код) Списка ценных бумаг;
- приоритет подбора ценных бумаг;
- тип расчетов;
- сумма РЕПО
- АСП Участника торгов.

Если иное не предусмотрено решением Биржи, в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» допускается заключение сделки РЕПО в Системе торгов при совпадении в двух допустимых встречных адресных заявках РЕПО (корзина) всех условий, определенных в настоящем пункте Правил, за исключением суммы РЕПО. В таком случае вышеперечисленные условия сделки РЕПО определяются исходя из суммы

РЕПО в заявке с меньшей суммой РЕПО. При этом Участники торгов соглашаются с тем, что адресная заявка РЕПО (корзина) на продажу ценных бумаг, поданная в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», может быть удовлетворена частично.

2.1.14.6. Условия заключения сделок в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» предусмотрены в Подразделе 2.12. «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», а также условия заключения сделок предусмотрены в Подразделе 2.12. «Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» и «Размещение: Адресные заявки» настоящих Правил. 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. 1.1.1.20. настоящих Правил);
- АСП Участника торгов.

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 за счет клиента (в том числе эмитента ценных бумаг));
- код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п. 1.1.1.20. настоящих Правил);
- АСП Участника торгов.

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 может быть предусмотрена возможность подачи в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» адресной заявки на покупку ценных бумаг с указанием объема денежных средств, предназначенных для покупки ценных бумаг (который включает НКД на Дату исполнения и комиссионное вознаграждение), вместо указания количества ценных бумаг, выраженного в лотах. Дополнительные особенности подачи и

удовлетворения таких заявок при размещении (продаже) ценных бумаг определяются Биржей в соответствии с Решением о выпуске и/или иными документами, регламентирующими порядок проведения размещения (продажи) ценных бумаг.

В случаях, предусмотренных 2.12.10. настоящих Правил, в адресной заявке на покупку ценных бумаг в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» с указанием реквизита «Дата активации» должен быть указан реквизит «Частичное обеспечение/отступное». Указание реквизита заявки «Частичное обеспечение/отступное» означает:

- а) принятие Участником торгов обязательств перед эмитентом/Заявителем по заключению сделки купли-продажи ценных бумаг;
- б) принятие Участником торгов, обязательства обеспечить наличие денежных средств в количестве, достаточном для заключения сделки по заявке в момент проведения процедуры контроля ее обеспечения, установленной в соответствии с п. 2.12.6 настоящих Правил;
- с) принятие Участником торгов, обязательства обеспечить наличие денежных средств в количестве, достаточном для проведения процедуры частичного контроля обеспечения по такой заявке при подаче такой заявки.

Допустимой встречной заявкой Участника торгов к адресной заявке на заключение сделок в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» является заявка противоположной направленности с совпадающими следующими условиями:

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

При этом заявка должна быть адресована Участнику торгов, подавшему встречную допустимую заявку.

2.1.14.7. Условия заключения сделок в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки», предусмотрены в Подразделе 2.13. «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 Подразделе 2.13. «Проведение торгов по приобретению акций и выкупу облигаций» настоящих Правил.

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. 1.1.1.20. настоящих Правил);
- АСП Участника торгов.

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 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 (или «по цене контрагента»);
- торгово-клиринговый счет;
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиента (в том числе эмитента ценных бумаг));
- код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п. 1.1.1.20. настоящих Правил);
- АСП Участника торгов.

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.

Допустимой встречной заявкой Участника торгов к адресной заявке на заключение сделок в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» Участника торгов является заявка противоположной направленности с совпадающими следующими условиями:

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

При этом заявка должна быть адресована Участнику торгов, подавшему встречную допустимую заявку.

2.1.14.8. Условия заключения сделок в Режиме торгов крупными пакетами ценных бумаг, предусмотрены в Подразделе 2.15. «Режим торгов крупными пакетами ценных бумаг» настоящих Правил.

В заявке КП должны быть указаны следующие реквизиты:

- вид заявки (заявка КП);
- 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;
- направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу);
- наименование ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- торгово-клиринговый счет;
- код расчетов (К0, если иной код расчетов не установлен в соответствии с п. 1.1.1.20. настоящих Правил);
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиента (в том числе, эмитента ценных бумаг));
- АСП Участника торгов.

Не требуется обязательного указания в заявке КП реквизита «Цена за одну ценную бумагу», который рассчитывается в Системе торгов в соответствии с алгоритмом, определенным в п. 2.15.5. настоящих Правил.

В случае, если Участник торгов заполняет реквизит заявки КП «Цена за одну

ценную бумагу», то указанное значение используется при заключении сделок в Системе торгов в качестве ценового ограничения: «заключить сделку по рассчитанной в Системе торгов цене не хуже, чем указанная в заявке цена-ограничитель».

При подаче заявки КП возможна подача в Систему торгов заявки с указанием следующих дополнительных признаков (если решением Биржи не установлено иное):

- «Заявка маркет-мейкера» - означающий, что заявка подана в счет выполнения обязательств маркет-мейкера;

- «Поддержание цен» - означает, что заявка подана во исполнение обязательств по Договору с эмитентом;

и/или уточняющих особенности заключения сделок по типу исполнения заявки: по остатку:

- «Снять остаток»;
- «Поставить в очередь»;
- «Полностью или отклонить».

Допустимыми встречными заявками по отношению к заявке КП являются заявки противоположной направленности по данной ценной бумаге и совпадающим кодом расчетов по цене, определенной в соответствии с п. п. 2.15.5. настоящих Правил, начиная с заявки, зарегистрированной ранее остальных.

2.1.14.9. Условия заключения сделок в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки», предусмотрены в Подразделе 2.20. «Заключение сделок РЕПО с Центральным контрагентом» настоящих Правил.

2.1.14.9.1. В лимитной заявке РЕПО (ЦК) должны быть указаны следующие реквизиты:

- вид заявки (лимитная заявка РЕПО (ЦК));
- 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 привлечение денежных средств или заявка на размещение денежных средств);
- наименование ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- сумма РЕПО;
- ставка РЕПО (минимальная ставка размещения/максимальная ставка привлечения денежных средств);
- код расчетов (Y0/Y1, если иной код расчетов не установлен в соответствии с п. 1.1.1.20. настоящих Правил);
- дисконт (возможное значение дисконта устанавливается Биржей);
- торгово-клиринговый счет;
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиента (в том числе, эмитента ценных бумаг));
- АСП Участника торгов.

Допускается подача в Систему торгов лимитной заявки РЕПО (ЦК) с указанием дополнительных признаков, уточняющих особенности заключения сделок по типу исполнения заявки по остатку, в соответствии с п. 2.1.13. настоящих Правил.

При подаче лимитной заявки РЕПО (ЦК) возможна подача в Систему торгов лимитной заявки РЕПО (ЦК) с указанием дополнительного признака: «Заявка маркет-мейкера», означающего, что заявка подана в счет выполнения обязательств маркет-мейкера, или «Поддержание цен», означающего, что заявка подана во исполнение обязательств по Договору с эмитентом.

В случае регистрации в Системе торгов лимитной заявки РЕПО (ЦК) с признаком

«Полностью или отклонить» допустимыми встречными заявками являются встречные заявки, начиная с лучших Ставок РЕПО, со Ставками РЕПО не большими, чем Ставка РЕПО в заявке на привлечение денежных средств (не меньшими, чем Ставка РЕПО в заявке на размещение денежных средств), указанная в данной заявке, и совокупная Сумма РЕПО которых не меньше указанной в подаваемой заявке. Допустимыми встречными заявками по отношению к лимитной заявке РЕПО (ЦК) с указанием иных признаков являются встречные заявки, начиная с лучших Ставок РЕПО, со Ставками РЕПО не большими, чем Ставка РЕПО в заявке на привлечение денежных средств (не меньшими, чем Ставка РЕПО в заявке на размещение денежных средств), указанная в данной заявке.

2.1.14.9.2. В рыночной заявке РЕПО (ЦК) должны быть указаны следующие реквизиты:

- вид заявки (рыночная заявка РЕПО (ЦК);
- 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 привлечение денежных средств или заявка на размещение денежных средств);
- наименование ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- сумма РЕПО;
- торгово-клиринговый счет;
- код расчетов (Y0/Y1, если иной код расчетов не установлен в соответствии с п. 1.1.1.20. настоящих Правил);
- дисконт (возможное значение дисконта устанавливается Биржей);
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиента (в том числе, эмитента ценных бумаг));
- АСП Участника торгов.

При подаче рыночной заявки РЕПО (ЦК) указание каких-либо дополнительных признаков, предусмотренных в п. 2.1.13. настоящих Правил, не допускается. В случае регистрации в Системе торгов рыночной заявки РЕПО (ЦК) на привлечение/размещение денежных средств допустимыми встречными заявками по отношению к ней являются встречные заявки, стоящие в очереди, начиная с минимальной Ставки РЕПО для заявок на привлечение денежных средств (максимальной Ставки РЕПО для заявок на размещение денежных средств).

2.1.14.9.3. В совокупной заявке РЕПО (ЦК) должны быть указаны следующие реквизиты:

- вид заявки (совокупная заявка РЕПО (ЦК);
- идентификатор Участника торгов;
- направленность заявки (заявка на привлечение денежных средств или заявка на размещение денежных средств);
- торгово-клиринговый счет;
- наименование (код) Списка ценных бумаг;
- сумма РЕПО;
- Ставка РЕПО (минимальная ставка размещения/максимальная ставка привлечения денежных средств), % годовых;
- АСП Участника торгов.

В дополнение к указанным реквизитам совокупная заявка РЕПО (ЦК) содержит одну или несколько лимитных заявок РЕПО (ЦК) по конкретной ценной бумаге, включенной в Список ценных бумаг, по которому подается данная совокупная заявка РЕПО (ЦК).

Не допускается указание в лимитной заявке РЕПО (ЦК), подаваемой посредством подачи совокупной заявки РЕПО (ЦК), реквизитов, не совпадающих с реквизитами

совокупной заявки РЕПО (ЦК) за исключением реквизитов «вид заявки» и «сумма РЕПО».

2.1.14.10. Условия заключения сделок в Режимы торгов «РЕПО с ЦК – Адресные заявки» и «Квал.Инвесторы - РЕПО с ЦК», предусмотрены в Подразделе 2.20. «Заключение сделок РЕПО с Центральным контрагентом» настоящих Правил.

В адресной заявке РЕПО (ЦК) в Режиме торгов «РЕПО с ЦК - Адресные заявки» должны быть указаны следующие реквизиты:

- вид заявки (адресная заявка РЕПО (ЦК);
- 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, заявка которого может быть признана допустимой встречной;
- направленность заявки (заявка на привлечение или заявка на размещение денежных средств);
- ставка РЕПО в процентах годовых;
- наименование (торговый код) ценной бумаги либо наименование (код) Списка ценных бумаг;
- торгово-клиринговый счет;
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиента (в том числе эмитента ценных бумаг));
- код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п. 1.1.1.20. настоящих Правил);
- дисконт, %;
- сумма РЕПО;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах (для заявок, поданных с указанием наименования (торгового кода) ценной бумаги);
- АСП Участника торгов;

Допустимой встречной заявкой на заключение сделки РЕПО в Режимы торгов «РЕПО с ЦК – Адресные заявки» и «Квал.Инвесторы - РЕПО с ЦК» для заявки, поданной с указанием наименования (торгового кода) ценной бумаги, является заявка того же вида противоположной направленности со следующими совпадающими условиями:

- вид заявки;
- наименование (торговый код) ценной бумаги;
- количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
- дисконт, %;
- сумма РЕПО;
- ставка РЕПО;
- код расчетов.

Допустимой встречной заявкой на заключение сделки РЕПО в Режимы торгов «РЕПО с ЦК – Адресные заявки» и «Квал.Инвесторы - РЕПО с ЦК» для заявки, поданной с указанием наименования (кода) Списка ценных бумаг, является заявка того же вида противоположной направленности со следующими совпадающими условиями:

- вид заявки;
- наименование (торговый код) ценной бумаги, совпадающий с наименованием (торговым кодом) ценной бумаги, включенной в такой Список ценных бумаг;
- сумма РЕПО;
- ставка РЕПО;
- код расчетов.

Условия Сумма РЕПО и количество ценных бумаг, выраженное в лотах, сделки РЕПО, заключенной по заявке, поданной с указанием наименования (кода) Списка ценных бумаг, определяются исходя из условий допустимой встречной заявки, в соответствии с п.п. 2.20.4.3. настоящих Правил.

2.1.14.11. В лимитной заявке (А3):

- вид заявки (лимитная заявка (А3));
- 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 (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п. 1.1.1.20. настоящих Правил);
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиента (в том числе, эмитента ценных бумаг));
- АСП Участника торгов.

2.1.14.11.1. Допускается подача в Систему торгов лимитной заявки (А3) с указанием дополнительных признаков, уточняющих особенности заключения сделок по типу исполнения заявки, в соответствии с п. 2.1.13. настоящих Правил.

2.1.14.11.2. В случае регистрации в Системе торгов лимитной заявки (А3) с признаком «Полностью или отклонить» допустимыми встречными заявками являются встречные заявки, начиная с лучших цен, с ценами не большими, чем цена покупки (не меньшими, чем цена продажи), указанная в данной заявке, и совокупный объем которых не меньше указанного в подаваемой заявке. Допустимыми встречными заявками по отношению к лимитной заявке (А3) с указанием иных признаков являются встречные заявки, начиная с лучших цен, с ценами не большими, чем цена покупки (не меньшими, чем цена продажи), указанная в данной заявке.

2.1.14.11.3. При подаче лимитной заявки (А3) не допускается указание дополнительного реквизита: «видимое количество ценных бумаг, выраженное в лотах».

2.1.14.11.4. Если иное не определено решением Биржи при подаче лимитной заявки (А3) возможна подача в Систему торгов заявки с указанием следующих дополнительных признаков:

- «Заявка маркет-мейкера» - означает, что заявка подана в счет выполнения обязательств маркет-мейкера;
- или «Поддержание цен» - означает, что заявка подана во исполнение обязательств по Договору с эмитентом.

2.1.14.12. В рыночной заявке (А3):

- вид заявки (рыночная заявка (А3) с указанием количества ценных бумаг или рыночная заявка (А3) 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 (который включает НКД на Дату

исполнения и комиссионное вознаграждение Биржи, Клиринговой организации и Технического центра);

- торгово-клиринговый счет;
- код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п. 1.1.1.20. настоящих Правил);
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиента (в том числе, эмитента ценных бумаг));
- АСП Участника торгов.

При подаче рыночной заявки (АЗ) указание каких-либо дополнительных признаков, предусмотренных в п. 2.1.13. настоящих Правил, не допускается. В случае регистрации в Системе торгов рыночной заявки (АЗ) на продажу/покупку допустимыми встречными заявками по отношению к ней являются встречные заявки, стоящие в очереди, начиная с минимальной цены покупки (максимальной цены продажи).

Подача рыночных заявок (АЗ) с указанием объема денежных средств, предназначенных для покупки ценных бумаг, допускается в аукционе закрытия Режима основных торгов и в аукционе закрытия Режима торгов «Режим основных торгов Т+» Дополнительные особенности подачи и удовлетворения таких заявок при размещении ценных бумаг определяются настоящими Правилами и/или решением Биржи.

2.1.14.13. В заявке ИСК:

- вид заявки (заявка ИСК);
- 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;
- торгово-клиринговый счет;
- код расчетов (Т0, если иной код расчетов не установлен в соответствии с п. 1.1.1.20. настоящих Правил);
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиента (в том числе, эмитента ценных бумаг));
- АСП Участника торгов.

При подаче заявки ИСК указание каких-либо дополнительных признаков, предусмотренных в п. 2.1.13. настоящих Правил, не допускается. Допустимыми встречными заявками по отношению к заявке ИСК являются встречные заявки, начиная с заявки, зарегистрированной ранее остальных.

2.1.14.14. В заявке по цене аукциона закрытия:

- вид заявки (заявка по цене аукциона закрытия);
- 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 аукциона закрытия;
- торгово-клиринговый счет;
- код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п. 1.1.1.20. настоящих Правил);
- краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиента (в том числе, эмитента ценных бумаг));

- АСП Участника торгов.

В заявках по цене аукциона закрытия, подаваемых в фазе торгов по цене аукциона закрытия, допускается указание только дополнительных признаков «Поставить в очередь», «Снять остаток» и «Полностью или отклонить». Особенности заключения сделок по заявкам по цене аукциона закрытия определяются настоящими Правилами и/или решением Биржи.

2.1.15. Допускается заключение сделки в отношении части количества ценных бумаг, определенного в соответствии с условиями заявки (частичное исполнение заявки), в лимитных заявках с сохранением в котировках, лимитных заявках (АЗ) с сохранением в котировках, заявках по цене аукциона закрытия с указанием признака «Поставить в очередь», заявках ИСК или заявке КП. В случае частичного исполнения такой заявки количество ценных бумаг, указанное в частично исполненной заявке, уменьшается на то количество ценных бумаг, в отношении которого заключена сделка. В ходе дополнительной фазы сбора заявок аукциона закрытия допускается частичное исполнение рыночной заявки и рыночной заявки (АЗ). В случае частичного исполнения такой заявки количество ценных бумаг, указанное в частично исполненной заявке (рассчитанное Системой торгов), уменьшается на то количество ценных бумаг, в отношении которого заключена сделка.

Допускается частичное исполнение совокупной заявки РЕПО (ЦК) в результате заключения сделки по лимитной заявке РЕПО (ЦК), поданной посредством такой совокупной заявки РЕПО (ЦК). В случае частичного исполнения такой заявки Сумма РЕПО, указанная в частично исполненной совокупной заявке РЕПО (ЦК), уменьшается на Сумму РЕПО, в заключенной сделке.

Допускается заключение сделки в отношении части Суммы РЕПО, определенной в соответствии с условиями заявки (частичное исполнение заявки), в лимитных заявках РЕПО (ЦК) с указанием признака «Поставить в очередь». В случае частичного исполнения такой заявки Сумма РЕПО, указанная в частично исполненной заявке, уменьшается на Сумму РЕПО, в отношении которой заключена сделка.

2.1.16. Подача в Систему торгов лимитной заявки, лимитной заявки (АЗ), рыночной заявки, рыночной заявки (АЗ), заявки послеторгового периода, заявки по цене аукциона закрытия, заявки КП означает безоговорочное согласие Участника торгов заключить сделку при наличии допустимых встречных заявок на условиях полного или частичного удовлетворения (если иное не установлено Биржей) по цене не хуже, чем указанная в заявке (в случае её указания) или цене, рассчитанной в Системе торгов на основе заявок на покупку и заявок на продажу ценных бумаг по наилучшим из указанных в них ценам.

Подача в Систему торгов лимитной заявки РЕПО (ЦК), рыночной заявки РЕПО (ЦК), означает безоговорочное согласие Участника торгов заключить сделку при наличии допустимых встречных заявок на условиях полного или частичного удовлетворения (если иное не установлено Биржей) со Ставкой РЕПО не хуже, чем указанная в заявке (в случае её указания).

2.1.17. Заключение сделки(ок) по лимитной заявке, лимитной заявке (АЗ), рыночной заявке, рыночной заявке (АЗ), заявке КП, заявке ИСК, заявке по цене аукциона закрытия и заявке послеторгового периода осуществляется с учетом особенностей, определенных пп. 2.1.14.1., 2.1.14.2., 2.1.14.3., 2.1.14.8., 2.1.14.11., 2.1.14.12., 2.1.14.13., 2.1.14.14. настоящих Правил при пересечении ее ценовых условий с ценовыми условиями допустимой(ых) встречной(ых) заявки(ок) противоположной направленности, зарегистрированными в Системе торгов.

2.1.18. 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/определена в качестве цены предторгового периода, послеторгового аукциона или дискретного аукциона;

- для поданной заявки на продажу – при наличии заявок на покупку с ценами, не меньшими, чем цена, которая указана в поданной заявке/определена в качестве цены предторгового периода, послеторгового аукциона или дискретного аукциона.

2.1.19. Удовлетворение айсберг-заявок осуществляется в порядке, установленном для удовлетворения иных лимитных заявок, с учетом следующих особенностей расчета «текущего видимого количества ценных бумаг»:

2.1.19.1. При подаче заявки значение «текущего видимого количества ценных бумаг» совпадает с указанным в заявке «видимым количеством ценных бумаг».

2.1.19.2. Если количество, указанное в допустимой встречной заявке меньше «текущего видимого количества ценных бумаг», то:

- Заключение сделки осуществляется исходя из количества ценных бумаг, указанного в допустимой встречной заявке.

- Новое значение «текущего видимого количества ценных бумаг» рассчитывается как разность действовавшего в момент расчета «текущего видимого количества ценных бумаг» и количества ценных бумаг, указанного в допустимой встречной заявке.

2.1.19.3. Если количество, указанное в допустимой встречной заявке равно «текущему видимому количеству ценных бумаг», то:

- Заключение сделки осуществляется исходя из количества ценных бумаг, указанного в допустимой встречной заявке.

- Новое значение «текущего видимого количества ценных бумаг» устанавливается равным указанному при подаче заявки «видимому количеству ценных бумаг».

2.1.19.4. Если количество, указанное в допустимой встречной заявке больше «текущего видимого количества ценных бумаг», то:

- Заключение сделки осуществляется в несколько этапов исходя из количества ценных бумаг, указанного в допустимой встречной заявке, и «текущего видимого количества ценных бумаг» в айсберг-заявке. После удовлетворения «текущего видимого количества ценных бумаг» в айсберг-заявке встречная заявка (при ее достаточном объеме) последовательно удовлетворяет все иные находящиеся в очереди активные заявки по данной цене (в случае их наличия), до тех пор, пока не доходит снова до той айсберг-заявки. Далее цикл удовлетворения повторяется до тех пор, пока либо не заканчивается объем встречной заявки, или айсберг-заявка полностью не удовлетворится. Количество ценных бумаг в сделке, заключенной на основании айсберг-заявки и встречной допустимой заявки, для каждой айсберг-заявки составляет количество ценных бумаг, определенное суммарно с учетом всех этапов удовлетворения соответствующей айсберг-заявки (прохождения цикла удовлетворения заявки).

- Новое значение «текущего видимого количества ценных бумаг» в айсберг-заявке, при полном удовлетворении «текущего видимого количества ценных бумаг», на каждом новом этапе устанавливается равным «видимому количеству ценных бумаг», указанному при подаче айсберг-заявки (в случае если остаток по айсберг-заявке меньше «видимого количества ценных бумаг», указанного при подаче данной заявки «текущее видимое количество ценных бумаг» устанавливается в размере остатка по айсберг-заявке).

2.1.20. Заключение сделки(ок) по рыночной заявке, рыночной заявке РЕПО (ЦК), рыночной заявке (АЗ), заявке КП, заявке ИСК, заявке по цене аукциона закрытия и заявке послеторгового периода осуществляется только при наличии допустимой(ых) встречной(ых) заявки(ок) противоположной направленности.

2.1.21. 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.

2.1.22. Если решением Биржи не определено иное, то определение в очереди

допустимых встречных заявок осуществляется поочередно из всех заявок, находящихся в сформированной очереди, начиная с первых в очереди заявок. Если допустимой встречной заявкой является заявка, удовлетворение которой может привести к заключению сделки, критерии которой определены в п. 2.2.8. настоящих Правил, то определение допустимых встречных заявок не прекращается и осуществляется с заявки, следующей в очереди за такой заявкой.

2.1.23. Если лимитная заявка, лимитная заявка РЕПО (ЦК), лимитная заявка (АЗ) с сохранением в котировках удовлетворяется не полностью, то она (в размере неисполненной части) ставится в очередь.

2.1.24. Если лимитная заявка без сохранения в котировках, лимитная заявка РЕПО (ЦК) без сохранения в котировках, лимитная заявка (АЗ) без сохранения в котировках, рыночная заявка или рыночная заявка РЕПО (ЦК) удовлетворяется не полностью, то ее неисполненная часть снимается с торгов (если настоящими Правилами не определено иное).

2.1.25. Все заявки на заключение сделок в Системе торгов являются заявками, значения реквизитов которых не могут быть изменены, за исключением заявок, поданных с указанием реквизита «дата активации» и лимитных заявок РЕПО (ЦК), поданных посредством подачи совокупной заявки РЕПО (ЦК). Изменение Участником торгов значений реквизитов заявки в Системе торгов означает отзыв 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 отзыва. Отзыв первоначальной заявки (частично исполненной заявки) осуществляется путем ввода в Систему торгов соответствующего распоряжения на отзыв 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 отзыв заявки содержит значения реквизитов отзываемой активной заявки/заявок и АСП Участника торгов, направившего такое распоряжение на отзыв заявки. При указании в распоряжении на отзыв заявки значений реквизитов нескольких заявок перевод данных заявок в неактивные осуществляется в Системе торгов в очередности, указанной в распоряжении на отзыв заявки. Заявки с указанием реквизита «дата активации» являются заявками, реквизиты которых могут быть изменены в части изменения реквизита «дата активации», при этом изменение реквизита «дата активации» не означает отзыв первоначальной заявки и подачу новой заявки с измененными значениями реквизитов. Реквизиты Сумма РЕПО и количество ценных бумаг лимитной заявки РЕПО (ЦК), поданной посредством подачи совокупной заявки РЕПО (ЦК), могут быть изменены (пересчитаны) в результате заключения сделки по иной лимитной заявке РЕПО (ЦК), поданной посредством той же совокупной заявки РЕПО (ЦК). Подобное изменение реквизитов лимитной заявки РЕПО (ЦК) не означает отзыв первоначальной заявки и подачу новой заявки с измененными значениями данных реквизитов.

2.1.26. 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).

2.1.27. Если решением Биржи не определено иное, все неудовлетворенные заявки, находящиеся в Системе торгов, могут быть отозваны или изменены (в порядке предусмотренном настоящими Правилами) подавшим их Участником торгов, за исключением случаев, предусмотренных в Подразделе 2.10. «Заключение сделок РЕПО на условиях нецентрализованного клиринга», Подразделе 2.12. «Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» и «Размещение: Адресные заявки»», Подразделе 2.13 «Проведение торгов по приобретению акций и выкупу облигаций» и Подразделе 2.15. «Режим торгов крупными пакетами ценных бумаг» настоящих Правил, а также за исключением лимитных заявок РЕПО (ЦК), поданных посредством подачи

совокупной заявки РЕПО (ЦК), изменение таких лимитных заявок РЕПО (ЦК) осуществляется посредством изменения совокупной заявки РЕПО (ЦК), посредством которой они были поданы. Отзыв заявки осуществляется Участником торгов в порядке, предусмотренном в п. 2.1.25. настоящих Правил.

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

Подраздел 2.2. Условия принятия заявки к регистрации

2.2.1. 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 Подразделом 2.5. «Порядок взаимодействия с клиринговой организацией. Порядок исполнения сделок» настоящих Правил и Правилами клиринга:

- лимитная заявка;
- 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»;
- заявка КП;
- лимитная заявка РЕПО (ЦК);
- рыночная заявка РЕПО (ЦК);
- адресная заявка РЕПО (ЦК);
- совокупная заявка РЕПО (ЦК);
- лимитная заявка (АЗ);
- рыночная заявка (АЗ);
- заявках по цене аукциона закрытия;
- заявка ИСК.

2.2.2. При отсутствии цены послеторгового периода заявка послеторгового периода не регистрируется в Системе торгов.

2.2.3. Заявки с указанием дополнительного реквизита «Заявка маркет-мейкера» принимаются Системой торгов только от Участников торгов, которым присвоен статус Маркет-мейкера в соответствии с п.п. 1.6.1. – 1.6.2. настоящих Правил и с которыми Биржей заключены соглашения/договоры о выполнении функций Маркет-мейкера, в течение периода действия данного соглашения/договора. Заявки с указанием дополнительного реквизита «Поддержание цен» принимаются Системой торгов только от Участника торгов, предоставившего Бирже информацию о заключении Договора с эмитентом.

2.2.4. Заявки на совершение сделки, цена (Ставка РЕПО) в которых превышает предельные границы колебания цены (Ставки РЕПО) ценной бумаги, установленные исходя из расчетной цены для целей определения отклонений цен (индикативной Ставки РЕПО для целей определения отклонений ставок РЕПО) этой ценной бумаги на текущий торговый день, в Системе торгов не регистрируются.

2.2.5. Заявки, поданные с указанием типа торгово-клирингового счета, на использование которого решением Биржи на основании информации Клиринговой организации установлены ограничения в определенных Режимов торгов (периодах) и/или

по определенным ценным бумагам, в Системе торгов не регистрируются. Биржа на основании информации, полученной от Небанковской кредитной организации закрытого акционерного общества «Национальный расчетный депозитарий», может устанавливать дополнительные ограничения на разрешенные типы ценных бумаг, указываемые в заявках на покупку и/или продажу, поданных с указанием торгово-клиринговых счетов, владельцами которых являются международные центральные депозитарии.

2.2.6. В Системе торгов следующие виды заявок, подаваемые Участником торгов, регистрируются без проведения Процедуры контроля обеспечения таких заявок и получения Биржей от Клиринговой организации отчета о возможности регистрации заявки в соответствии с Подразделом 2.5. «Порядок взаимодействия с клиринговой организацией. Порядок исполнения сделок» настоящих Правил и Правилами клиринга:

- безадресная заявка на заключение сделок в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки»;
- безадресная заявка на заключение сделок в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки».

2.2.7. При подаче Участником торгов заявки на заключение сделки за счет клиента (в том числе эмитента 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 законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

2.2.8. Для исключения возможности осуществления сделок на основании заявок, поданных за счет одного и того же лица (в соответствии с кодом этого лица); а также в результате которых нарушаются ограничения, установленные для доверительного управляющего, предусмотренные законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации:

2.2.8.1. В ходе торгового периода Режим основных торгов, торгового периода Режим торгов «Режим основных торгов Т+», в Режиме торгов «Неполные лоты», в Режиме торгов «Облигации Д – Режим основных торгов», в Режиме торгов «Акции Д – Режим основных торгов», в Режиме торгов «Исполнение обязательств по срочным контрактам», в Режиме торгов «Квал.Инвесторы – Режим основных торгов» и в Режиме торгов «Квал.Инвесторы – Режим основных торгов Т+» на основании заявки (в размере неисполненной части), поданной Участником торгов, и находящейся в очереди допустимой встречной заявки в Системе торгов не регистрируется сделка:

2.2.8.1.1. на основании заявок, поданных за счет одного и того же клиента Участника (участников) торгов;

2.2.8.1.2. на основании заявок, поданных Участником торгов за свой счет, если в результате такой сделки Участник торгов станет одновременно продавцом и покупателем ценных бумаг;

2.2.8.1.3. 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);

2.2.8.1.4. на основании заявки данного Участника торгов, поданной от своего имени и за свой счет либо 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;

2.2.8.1.5. 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 за счет данного Участника торгов, выступающего в качестве клиента, с другой стороны.

2.2.8.2. В послеторговый период Режима основных торгов, послеторговый период Режима торгов «Режим основных торгов Т+», Режиме торгов крупными пакетами ценных бумаг 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:

2.2.8.2.1. поданная любым Участником торгов за счет одного и того же клиента;

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

2.2.8.2.3. 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);

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

2.2.8.2.5. поданная иным Участником торгов 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.

2.2.8.3. В предторговый период, в ходе аукциона закрытия или в ходе дискретного аукциона Режима основных торгов и Режима торгов «Режим основных торгов Т+» 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:

2.2.8.3.1. поданная любым Участником торгов за счет одного и того же клиента;

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

2.2.8.3.3. 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);

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

2.2.8.3.5. поданная иным Участником торгов 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.

2.2.8.4. В Режиме торгов РПС, «Облигации Д – РПС», «Акции Д – РПС», «Квал.Инвесторы – РПС», «Квал.Инвесторы – РПС с ЦК», «Квал.Инвесторы – РЕПО», «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)», «Квал.Инвесторы – РЕПО с ЦК», «РИИ2 – РПС», «Аукцион РЕПО», «РЕПО с акциями», «РЕПО с акциями (в ин. валюте)», «РЕПО с облигациями», «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)», «Размещение: Адресные заявки», «Выкуп: Адресные заявки», «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки», «РЕПО с ЦК – Адресные заявки», «РПС с ЦК», «Исполнение обязательств по сделкам Т+: РПС», «Исполнение обязательств по сделкам Т+: 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:

2.2.8.4.1. на основании встречных заявок Участника (участников) торгов, поданных и за счет одного и того же клиента;

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

2.2.8.4.3. 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);

2.2.8.4.4. на основании заявки, поданной данным Участником торгов от своего имени и за свой счет либо 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;

2.2.8.4.5. 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 за счет данного Участника торгов с другой стороны, выступающего в качестве клиента.

2.2.9. При подаче Участником торгов заявки на заключение сделки за счет клиентов, а также от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении, при указании в качестве кода расчетов Z0 или X0 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 торгово-клиринговый счет.

2.2.10. При подаче Участником торгов за счет клиента заявки на покупку ценных бумаг, предназначенных для квалифицированных инвесторов, заявка регистрируется в Системе торгов в случае если клиент, за счет которого подана заявка, является квалифицированным инвестором и зарегистрирован ФБ ММВБ в соответствии с Правилами допуска.

2.2.11. При подаче Участником торгов за счет клиентов заявки на покупку ценных бумаг, обращение и размещение которых может осуществляться только среди кредитных организаций, заявка регистрируется в Системе торгов в случае если клиент, за счет которого подана заявка, является кредитной организацией и зарегистрирован ФБ ММВБ в соответствии с Правилами допуска.

Подраздел 2.3. Особенности проведения торгов по облигациям

2.3.1. При торгах по облигациям Участник торгов вправе подавать в Систему торгов все виды заявок, указанных в Подразделе 2.1. «Заявки» настоящих Правил, за исключением адресных заявок РЕПО (акции) (если решением Биржи не определено иное).

2.3.2. В случае если фактическая 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 фактическую дату исполнения сделки в соответствии с Решением о выпуске ценных бумаг и/или анкетой ценной бумаги и/или в порядке, установленном эмитентом. Дополнительные особенности расчета НКД по облигациям определяются решением Биржи. В случае если фактическая дата исполнения сделки (части сделки РЕПО) с облигациями, по которым в Системе торгов рассчитывается НКД, приходится на дату составления (фиксации) списка владельцев облигаций для выплаты купонного дохода соответствующего купонного периода и при этом Решением о выпуске ценных бумаг и/или анкетой ценной бумаги предусмотрено, что начало следующего купонного периода совпадает с датой составления (фиксации) списка владельцев облигаций для выплаты купонного дохода по предыдущему купонному периоду, Участник торгов – покупатель обязан уплатить НКД Участнику торгов – продавцу в размере, установленном для нового купонного периода, определяемом в Системе торгов на фактическую дату исполнения сделки в соответствии с Решением о выпуске ценных бумаг и/или анкетой ценной бумаги.

Решением Биржи может быть установлено, что в случае получения Биржей информации о неисполнении, в том числе частичном, обязательств эмитента облигации по выплате купонного дохода или суммы погашаемой части основного долга (амортизационной выплаты) текущее значение НКД включает в себя сумму невыплаченного дохода, а текущее значение номинала по облигации не уменьшается до момента получения Биржей информации о фактически проведенных выплатах. Полученные таким образом значение НКД и текущее значение номинала используются для расчета параметров заявок и сделок, в том числе и текущих обязательств по сделкам РЕПО в соответствии с Подразделом 2.9. «Порядок заключения сделок РЕПО».

2.3.3. В случае погашения части основного долга (проведения амортизационной выплаты) по облигациям с даты ее проведения размер номинальной стоимости уменьшается на сумму погашаемой части основного долга (амортизационной выплаты), если решением Биржи не установлено иное.

Подраздел 2.4. Особенности проведения торгов по ценным бумагам, за исключением облигаций

2.4.1. При торгах по акциям, за исключением акций, определенных в соответствии с п. 1.9.2. настоящих Правил, Участник торгов вправе подавать в Систему торгов все виды заявок, указанных в Подразделе 2.1. «Заявки» настоящих Правил, за исключением адресных заявок РЕПО (облигации).

2.4.2. При торгах по акциям, определенным в соответствии с п. 1.9.2. настоящих Правил, Участник торгов вправе подавать в Систему торгов только следующие виды заявок: адресные заявки на заключение сделок в РПС, а также адресные заявки РЕПО (акции) (если решением Биржи не определено иное).

2.4.3. При торгах инвестиционными паями, депозитарными расписками и ипотечными сертификатами участия Участник торгов вправе подавать в Систему торгов все виды заявок, указанных в Подразделе 2.1. «Заявки» настоящих Правил, за исключением заявок, на основании которых заключаются сделки РЕПО (если решением Биржи не определено иное).

Подраздел 2.5. Порядок взаимодействия с клиринговой организацией. Порядок исполнения сделок

2.5.1. При подаче Участником торгов в Систему торгов заявки с кодом расчетов T0, B0-B30, S0-S2, Yn, Y0/Yn, Y1/Yn, Z0, X0, T0/Yn или Rb на покупку ценных бумаг Биржа направляет в Клиринговую организацию информацию о поданной заявке для осуществления Процедуры контроля обеспечения, которая проводится в соответствии с порядком, установленным Правилами клиринга. На основании данной информации 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.

2.5.2. При подаче Участником торгов в Систему торгов заявки с кодом расчетов T0, B0-B30, S0-S2, Yn, Y0/Yn, Y1/Yn, Z0, X0, T0/Yn или Rb на продажу ценных бумаг Биржа направляет в Клиринговую организацию информацию о поданной заявке для осуществления Процедуры контроля обеспечения, которая проводится в соответствии с порядком, установленным Правилами клиринга. На основании данной информации 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.

2.5.3. При подаче заявки на покупку или на продажу ценных бумаг с кодом расчетов K0 при проведении Аукциона в соответствии с п. 2.1.14.8. настоящих Правил Биржа направляет в Клиринговую организацию информацию о поданной заявке для проверки состояния (статуса) в Клиринговой системе торгово-клирингового счета, указанного в заявке. На основании данной информации 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.

После определения цены Аукциона в соответствии с п. 2.15.5. настоящих Правил, Биржа направляет в Клиринговую организацию запрос о возможности заключения сделки по ранее поданной заявке с кодом расчетов K0 для проверки наличия обеспечения, исходя из определенной цены Аукциона:

- По заявке на покупку - для проверки наличия суммы денежных средств, достаточной для обеспечения надлежащего исполнения обязательств по сделке, которая может быть заключена по данной заявке, включая НКД на фактическую дату исполнения сделки, в случае его расчета в Системе торгов, а также обязательства по уплате комиссионного вознаграждения по сделке.

- По заявке на продажу - для проверки наличия количества ценных бумаг, достаточного для обеспечения надлежащего исполнения обязательств по сделке, которая может быть заключена по данной заявке.

На основании данного запроса от Биржи Клиринговая организация в соответствии с Правилами клиринга совершает необходимые действия, направленные на осуществление Процедуры контроля обеспечения. В случае прохождения ранее поданными заявками с кодом расчетов K0 такой процедуры из таких заявок в Системе торгов определяются допустимые встречные заявки, информация о которых становится доступной Центральному контрагенту посредством Системы торгов Биржи. В момент определения соответствия допустимых встречных заявок в Системе торгов осуществляется регистрация двух сделок с Участниками торгов, подавшими эти заявки.

После окончания каждого из проводимых Аукционов в соответствии с Подразделом 2.15. «Режим торгов крупными пакетами ценных бумаг» настоящих Правил Биржа направляет в Клиринговую организацию уведомление об окончании аукциона.

2.5.4. При отзыве Участником торгов (снятии Биржей) в Системе торгов неисполненной заявки на продажу или на покупку ценных бумаг с кодом расчетов T0, Z0, X0, B0-B30, S0-S2, Yn, T0/Yn, Y0/Yn, Y1/Yn или Rb Биржа направляет в Клиринговую организацию уведомление о снятии заявки.

2.5.5. При регистрации в Системе торгов сделки, путем удовлетворения заявки (полном или частичном) Участника торгов в Системе торгов по результатам совершенной сделки Биржа направляет в Клиринговую организацию информацию о заключении сделки. Реестр сделок РЕПО, заключенных на основании адресных заявок РЕПО (корзина) направляется в Клиринговую организацию каждые 15 минут (если иное не определено решением Биржи) в течение торговой сессии.

В случае если условия сделки и номера заявок, на основании которых заключена сделка, содержащиеся в информации 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.

2.5.6. При регистрации в Системе торгов сделки, путем удовлетворения заявки с кодами расчетов Z0, X0, B0, Rb, Yn, T0/Yn, Y0/Yn, Y1/Yn и S0 Биржа направляет в Клиринговую организацию информацию о заключении сделки.

2.5.7. Передача информации Клиринговой организации по заявкам,

содержащим дату активации, для осуществления Процедуры контроля обеспечения по такой заявке в соответствии с п.п. 2.5.1. – 2.5.2. настоящих Правил осуществляется во время и дату, определенные Биржей. В случае если заявка не проходит проверку обеспечения, данная заявка снимается Биржей. При регистрации в Системе торгов сделки на основании таких заявок осуществляется взаимодействие в порядке, предусмотренном в п. 2.5.5. настоящих Правил.

2.5.8. После окончания торгов (торговых сессий, торгов в отдельном Режиме торгов/торгов по отдельной ценной бумаге) каждого торгового дня, а также в случае изменения расчетных и иных параметров сделок Биржа направляет в Клиринговую организацию сводный реестр сделок с ценными бумагами, содержащий информацию обо всех сделках, заключенных на Бирже, а также о сделках, расчетные и иные параметры по которым были изменены, условиями которых предусмотрено осуществление клиринга в данной Клиринговой организации.

2.5.9. В дату внесения компенсационных взносов после окончания Процедуры контроля обеспечения Клиринговая организация посредством Системы торгов направляет на Биржу информацию об исполнении обязательств по внесению / требований по получению Участниками торгов компенсационных взносов (включая информацию о получении от Участников торгов - контрагентов по сделке РЕПО поручений на отказ от компенсационного взноса).

2.5.10. В случае исполнения до Даты исполнения Участником торгов сделки РЕПО Клиринговая организация направляет на Биржу отчет о досрочном исполнении сделок РЕПО.

2.5.11. 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. 2.5.9. настоящих Правил.

2.5.12. После окончания торгов в дату, предшествующую дате внесения компенсационных взносов, Биржа посредством Системы торгов направляет в Клиринговую организацию информацию об обязательствах по внесению / требованиях по получению Участниками торгов компенсационных взносов.

2.5.13. Биржа уведомляет Клиринговую организацию (при получении от Участника торгов уведомления Участника торгов об отказе от возмещения по сделкам с ценными бумагами, предусмотренного в Приложении № 5 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.

2.5.14. 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.

2.5.15. Исполнение сделок осуществляется в порядке, определенном в Правилах клиринга, с учетом следующих условий:

2.5.15.1. Обязательства по спот-сделкам с кодами расчетов T0, K0, Z0, X0, Y0 и B0, а также по первым частям сделок РЕПО с кодами расчетов Rb, Z0, X0, T0/Yn, Y0/Yn и S0 подлежат исполнению в дату заключения этих сделок на Бирже.

2.5.15.2. Обязательства по сделкам с кодами расчетов B01-B30 могут быть исполнены в любой расчетный день после даты заключения этих сделок на Бирже, за исключением сделок, заключаемых при размещении ценных бумаг, но не позднее соответствующей Даты исполнения включительно.

2.5.15.3. Обязательства по сделкам с кодами расчетов B01-B30, заключаемым при размещении ценных бумаг, а также обязательства по сделкам с кодом

расчетов Y_n и по вторым частям сделок РЕПО с кодами расчетов $T0/Y_n$, $Y0/Y_n$ подлежат исполнению в соответствующие Даты исполнения, если иное не предусмотрено документами Клиринговой организации и не определено решением Биржи.

2.5.15.4. Обязательства по первым частям сделок РЕПО с кодами расчетов $S1-S2$, $Y1/Y_n$ и сделок РЕПО, заключенных на основании адресных заявок РЕПО (корзина) подлежат исполнению в соответствующие Даты исполнения первых частей этих сделок. При этом Участник торгов обязан исполнить свои обязательства по первой части сделки РЕПО в Дату исполнения первой части этой сделки РЕПО. В случаях, установленных в Генеральном соглашении с Банком России, допускается частичное исполнение первой части сделки РЕПО, заключенной на основании адресных заявок РЕПО (корзина), при этом Клиринговая организация, осуществляющая клиринг по такой сделке, направляет на Биржу информацию об изменении параметров сделки РЕПО.

2.5.15.5. Обязательства по вторым частям сделок РЕПО с кодами расчетов R_b , $Z0$ и $S0-S2$ и сделок РЕПО, заключенных на основании адресных заявок РЕПО (корзина) могут быть исполнены в любой расчетный день, начиная с Даты исполнения первых частей этих сделок, но не позднее соответствующей Даты исполнения вторых частей этих сделок включительно. Дата исполнения второй части сделки РЕПО, заключенной на основании адресных заявок РЕПО (корзина), может быть изменена Клиринговой организацией в случаях, установленных в Правилах клиринга.

При этом Участник торгов обязан исполнить свои обязательства по второй части сделки РЕПО в 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. В случае изменения Даты исполнения второй части сделки РЕПО в соответствии с п.п. 1.13.6., 2.5.15.5. и 2.9.10. – 2.9.11. настоящих Правил Участник торгов обязан исполнить свои обязательства по второй части сделки РЕПО в измененную Дату исполнения.

2.5.16. В случае если за 2 рабочих дня до даты вступления в силу решения Биржи об изменении Клиринговой организации, осуществляющей клиринг по заключаемым на Бирже сделкам, хотя бы одна из сторон по заключенной сделке не заключила договор об оказании клиринговых услуг с новой Клиринговой организацией, срок (дата) исполнения обязательств по заключенным сделкам РЕПО и сделкам с отложенным исполнением Участников торгов – контрагентов по сделкам считается наступившим в день, предшествующий вступлению в силу решения об изменении Клиринговой организации.

2.5.17. Если Дата исполнения сделки приходится не на расчетный день в соответствии с Правилами клиринга, то Датой исполнения сделки считается первый следующий за этой датой расчетный день. При этом обязательства по сделке пересчитываются с учетом такого переноса Даты исполнения, если решением Биржи не установлено иное.

2.5.18. Клиринговая организация, для целей заключения и обеспечения исполнения Сделок $T+$ рассчитывает риск-параметры, в соответствии с порядком, установленном Правилами клиринга и/или иными внутренними документами Клиринговой организации. Клиринговая организация с использованием Системы торгов каждый торговый день до начала торгов передает Бирже информацию об установленных риск-параметрах, в т.ч. следующую информацию:

- Расчетную цену ценной бумаги;
- Дисконты;
- Индикативную ставку РЕПО для конкретной ценной бумаги (группы ценных бумаг) и конкретного кода расчетов.

- Диапазон колебания Ставки РЕПО для конкретной ценной бумаги (группы ценных бумаг) и конкретного кода расчетов.

2.5.19. В случае заключения сделки без подачи заявок между Центральным контрагентом и Участником клиринга в соответствии с порядком, установленным Правилами клиринга, Клиринговая организация направляет на Биржу Уведомление о необходимости заключения сделки, в указанном уведомлении также содержатся сведения об условиях такой сделки.

Подраздел 2.6. Заключение сделок в Режиме основных торгов

2.6.1. В ходе Основной торговой сессии торги в Режиме основных торгов состоят из следующих периодов:

- предторгового периода;
- торгового периода;
- послеторгового периода.

По решению Биржи в целях обеспечения стабилизации рынка отдельных ценных бумаг для отдельной ценной бумаги или категории (типа) ценных бумаг может быть установлено, что:

- вместо любого из вышеуказанных периодов, торги проводятся в форме дискретного аукциона (в порядке и с учетом условий, предусмотренных в п. 2.6.6. настоящих Правил);
- вместо послеторгового периода или после окончания послеторгового периода торги проводятся в форме послеторгового аукциона (в порядке и с учетом условий, предусмотренных в п. 2.6.5. настоящих Правил) или аукциона закрытия (в порядке и с учетом условий, предусмотренных в п. 2.6.7. настоящих Правил);
- после окончания послеторгового аукциона или аукциона закрытия, торги проводятся в форме послеторгового периода (в порядке и с учетом условий, предусмотренных в п. 2.6.4. настоящих Правил);

В соответствии с законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации вместо приостановки торгов акциями, осуществляемых на основании безадресных заявок, Биржей может быть определена возможность проведения по таким акциям торгов в форме дискретного аукциона. Основанием для принятия Биржей решения о возобновлении торгов в иных Режиме торгов и/или Секторах рынка является завершение дискретного аукциона, в результате которого были совершены сделки (определена цена дискретного аукциона). Биржей могут быть определены дополнительные основания для принятия решения о возобновлении торгов в иных Режиме торгов и/или Секторах рынка.

В ходе Дополнительной торговой сессии торги, проводимые в Режиме основных торгов, состоят из торгового периода (если решением Биржи не установлено иное).

2.6.2. Заключение сделок в предторговом периоде осуществляется перед каждым торговым периодом (если решением Биржи не определено иное). Заключение сделок в предторговом периоде Режиме основных торгов осуществляется в следующем порядке:

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

2.6.2.2. 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.

2.6.2.3. 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.

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

2.6.2.5. Заключение сделки(ок) по заявке, поданной в предторговый период, осуществляется с учетом особенностей, определенных п. 1.2.11., п. 2.1.14.1., п. 2.1.15. и п. 2.1.17. настоящих Правил при пересечении ее ценовых условий с ценой предторгового периода.

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 ближайшем торговом периоде, если иное не определено решением Биржи.

2.6.2.6. 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.

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

2.6.3. Торговый период проводится после окончания предторгового периода, если иное не определено в соответствии с п. 2.6.1. и п. 2.6.6. настоящих Правил. Для заключения сделок в торговом периоде данного торгового дня принимаются лимитные заявки и рыночные заявки, поданные Участниками торгов в данном торговом периоде, а также лимитные заявки с сохранением в котировках, находящиеся в Системе торгов после окончания предторгового периода или после окончания дискретного аукциона. Заключение сделок в торговом периоде Режиме основных торгов осуществляется в следующем порядке:

2.6.3.1. Заключение сделки(ок) по лимитной заявке и рыночной заявке осуществляется с учетом особенностей, определенных п. 1.2.11., п. 2.1.14.1., 2.1.14.3., п. 2.1.15. и п. 2.1.17. настоящих Правил.

2.6.3.2. Участники торгов в ходе торгового периода имеют доступ к информации о собственных заявках, а также о заявках с двадцатью лучшими ценами (десять заявок на покупку и десять заявок на продажу), находящихся в очереди в Системе торгов, в части указанного в них количества ценных бумаг (по айсберг-заявкам только в части «текущего видимого количества ценных бумаг») и цены (если решением Биржи не предусмотрено иное).

2.6.3.3. Заявки, не удовлетворенные в ходе торгового периода, принимают участие в ближайшем периоде Режиме основных торгов или в дискретном аукционе (если решением Биржи не определено иное).

2.6.4. После торгового периода или послеторгового аукциона или аукциона закрытия проводится подача заявок и заключение сделок в послеторговом периоде (если

решением 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 Режим основных торгов осуществляется с учетом особенностей, определенных п. 1.2.11., п. 2.1.14.2., п. 2.1.15. и п. 2.1.17. настоящих Правил, в следующем порядке:

2.6.4.1. Цена послеторгового периода рассчитывается в Системе торгов как результат от деления суммарного объема сделок с данной ценной бумагой, заключенных в течение установленного Биржей периода времени в ходе Режим основных торгов, на суммарное количество ценных бумаг в этих сделках. При отсутствии в течение вышеуказанного периода времени Режим 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 в российских рублях и в иностранной валюте, цена послеторгового периода определяется в соответствии с настоящим пунктом Правил только по сделкам в российских рублях, если иной порядок ее расчета не установлен Биржей.

2.6.4.2. В послеторговом периоде в Систему торгов подаются только заявки послеторгового периода (если решением Биржи не определено иное). Цена послеторгового периода, рассчитываемая в порядке, предусмотренном в п. 2.6.4.1. настоящего пункта Правил, автоматически указывается при регистрации заявки послеторгового периода в Системе торгов.

2.6.4.3. В момент окончания послеторгового периода регистрируются сделки по цене послеторгового периода при наличии допустимой(ых) встречной(ых) заявки(ок) противоположной направленности, поданной(ых) в послеторговый период.

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

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

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

2.6.4.7. 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 Биржи не определено иное).

2.6.5. Проведение послеторгового аукциона осуществляется в следующем порядке:

2.6.5.1. После торгового периода или послеторгового периода проводится подача заявок и заключение сделок в послеторговом аукционе (если решением Биржи не определено иное).

2.6.5.2. В ходе проведения послеторгового аукциона в Систему торгов подаются только лимитные заявки.

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

2.6.5.4. Цена послеторгового аукциона определяется в следующем порядке:

- на основании поданных 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 в ходе проведения послеторгового аукциона 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 послеторгового аукциона определяется как среднее арифметическое максимального и минимального из этих значений.

2.6.5.5. Если наибольшая цена покупки среди всех поданных заявок не пересекается с наименьшей ценой продажи, или заявки на покупку или продажу отсутствуют в Системе торгов, цена послеторгового аукциона не определяется.

2.6.5.6. Заключение сделки(ок) по заявке в ходе проведения послеторгового аукциона осуществляется с учетом особенностей, определенных п. 1.2.11., п. 2.1.14.1., п. 2.1.15. и п. 2.1.17. настоящих Правил при пересечении ценовых условий такой заявки с ценой послеторгового аукциона.

2.6.5.7. При неравенстве спроса и предложения по цене послеторгового 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.

2.6.5.8. Участники торгов в ходе послеторгового аукциона имеют доступ к информации о собственных заявках, а также о заявках с двадцатью лучшими ценами (десять заявок на покупку и десять заявок на продажу), находящихся в очереди в Системе торгов, в части указанного в них количества ценных бумаг (по айсберг-заявкам только в части «текущего видимого количества ценных бумаг») и цены (если решением Биржи не определено иное).

2.6.6. Проведение дискретного аукциона осуществляется в следующем порядке:

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

2.6.6.2. На основании поданных заявок по истечении 15 минут с момента начала проведения дискретного аукциона, если иной срок не установлен Биржей, в Системе торгов определяется цена дискретного аукциона по ценной бумаге при условии наличия в Системе торгов заявок, совокупные параметры которых соответствуют следующим условиям

- количество участников торгов, подавших заявки; составило не менее 3 (если иное не определено решением Биржи);

- величина совокупного спроса составила более 150 ценных бумаг (если иное не определено решением Биржи);

- величина совокупного предложения составила более 150 ценных бумаг (если иное не определено решением Биржи);

- спрэд, определяемый как отношение разности между средневзвешенной ценой продажи и средневзвешенной ценой покупки, к средневзвешенной цене покупки, не превышает 7% (если иное не определено решением Биржи)

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

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

цены.

2.6.6.3. При выполнении условий, указанных в п. 2.6.6.2. настоящих 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.

2.6.6.4. 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. 2.6.6.2. настоящих Правил, (если иное не определено решением Биржи). При этом все ранее поданные в Систему торгов и не отозванные/снятые заявки повторно участвуют в очередном дискретном аукционе. Количество дискретных аукционов, проводимых для одной ценной бумаги в течение торгового дня, не ограничено (если иное не определено решением Биржи). Время окончания последнего дискретного аукциона не может быть позднее времени окончания торгового периода Режим основных торгов Основной торговой сессии, установленного в соответствии с п. 1.2.8. настоящих Правил.

В случае если время окончания дискретного аукциона совпадает со временем окончания торгового периода, то в текущий торговый день торги данной ценной бумагой в торговом периоде Режим основных торгов не проводятся.

2.6.6.5. 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 Биржи).

2.6.6.6. Если в ходе дискретного аукциона по ценной бумаге определена цена дискретного аукциона, то по окончании дискретного аукциона торги данной ценной бумагой осуществляются в течение торгового периода и/или в послеторговом периоде и/или послеторговом аукционе или аукционе закрытия Режим основных торгов с учетом установленного в соответствии с п. 1.2.8. настоящих Правил времени проведения данных периодов торгов Режим основных торгов.

2.6.6.7. Заключение сделок на основании заявки, поданной в ходе дискретного аукциона, осуществляется с учетом особенностей, определенных п. 1.2.11., п. 2.1.14.1., п. 2.1.15. и п. 2.1.17. настоящих Правил, по цене дискретного аукциона.

2.6.6.8. 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 (если иное не определено решением Биржи).

2.6.6.9. Участник торгов во время дискретного аукциона имеет доступ

к информации обо всех заявках, поданных в Систему торгов.

2.6.7. Проведение аукциона закрытия осуществляется в следующем порядке:

2.6.7.1. После торгового периода проводится подача заявок и заключение сделок в аукционе закрытия (если решением Биржи не определено иное).

2.6.7.2. Если решением Биржи не определено иное, в ходе проведения аукциона закрытия в Систему торгов подаются лимитные заявки, рыночные заявки, лимитные заявки (А3), рыночные заявки (А3), заявки по цене аукциона закрытия. В лимитных заявках и лимитных заявках (А3), подаваемых в фазах сбора заявок, допускается указание только дополнительных признаков «По разным ценам» и «Поставить в очередь». Если решением Биржи не определено иное, рыночные заявки и рыночные заявки (А3) на покупку ценных бумаг подаются только с указанием объема денежных средств, предназначенных для покупки ценных бумаг, Рыночные заявки и рыночные заявки (А3) на продажу ценных бумаг подаются только с указанием количества ценных бумаг.

2.6.7.3. Аукцион закрытия состоит из следующих последовательных фаз:

- фаза сбора заявок;
- дополнительная фаза сбора заявок;
- фаза торгов по цене аукциона закрытия.

Продолжительность фаз аукциона закрытия устанавливается решением Биржи. При этом дополнительная фаза сбора заявок проводится после завершения фазы сбора заявок в случае, если в фазе сбора заявок не определена цена аукциона закрытия.

2.6.7.4. На основании поданных заявок по каждой ценной бумаге на случайно определенный момент фазы сбора заявок и/или дополнительной фазы сбора заявок в Системе торгов определяется цена аукциона закрытия, обеспечивающая заключение сделок с наибольшим количеством ценных бумаг, являющихся предметом этих сделок. Период фазы сбора заявок и/или дополнительной фазы сбора заявок, в который может быть случайно выбран момент определения цены аукциона закрытия, устанавливается Биржей.

2.6.7.5. Цена аукциона закрытия определяется в следующем порядке:

- на основе поданных лимитных заявок и лимитных заявок (А3) (далее, для целей настоящего пункта – лимитные заявки) нарастающим итогом в направлении убывания цены для каждого значения цены в лимитных заявках рассчитывается агрегированный спрос по лимитным заявкам (количество лотов, выставленное на покупку), и в порядке возрастания цены нарастающим итогом для каждого значения цены рассчитывается агрегированное предложение по лимитным заявкам (количество лотов, выставленное на продажу);

- рассчитываются общие агрегированные значения спроса и предложения для каждой цены, указанной в лимитных заявках, как результат от сложения соответствующих значений агрегированного спроса по лимитным заявкам и агрегированного предложения по лимитным заявкам со значениями количества лотов в рыночных заявках и рыночных заявках (А3) (далее, для целей настоящего пункта – рыночные заявки) на покупку и рыночных заявках на продажу. Все рыночные заявки учитываются при расчете спроса и предложения по каждой цене, указанной в лимитных заявках. Количество лотов в рыночной заявке с указанием количества денежных средств, предназначенных для покупки ценных бумаг, определяется, как целая часть от частного целой части от деления суммы денежных средств в данной заявке на сумму платежа по приобретению ценной бумаге (которая включает в себя цену, для которой рассчитывается количество лотов, и совокупный размер комиссионного вознаграждения Биржи, Клиринговой организации и Технического центра) и количества ценных бумаг в одном лоте.

- для каждого значения цены определяется количество лотов, которые могут быть предметом сделок (исходя из предположения, что все сделки будут совершены по данной

цене), как минимальное из двух значений – величины общего агрегированного спроса и величины общего агрегированного предложения для данного значения цены;

- определяется значение цены, которая обеспечивает заключение сделок с максимально возможным количеством лотов;

- в случае если указанным условиям удовлетворяют несколько значений цены, то выбирается та цена, при которой значение дисбаланса (разности между общим агрегированным спросом и общим агрегированным предложением) было бы минимальным (по модулю);

- в случае если указанным условиям удовлетворяют несколько значений цены, то в случае избыточного предложения (большее количество лотов в заявках на продажу), выбирается наименьшая из цен либо, в случае избыточного спроса (большее количество лотов в заявках на покупку) выбирается наибольшая из цен;

- в случае если указанным условиям удовлетворяют несколько значений цены, то цена выбирается, как ближайшая к цене последней сделки в торговом периоде;

- если цены имеют одинаковое отклонение от цены последней сделки, то в качестве цены аукциона закрытия выбирается большая из этих цен.

2.6.7.6. Если наибольшая цена покупки среди всех поданных заявок не пересекается с наименьшей ценой продажи, или заявки на покупку или продажу отсутствуют в Системе торгов, либо рассчитанная цена выходит за предельные значения цены аукциона закрытия, установленные Биржей, либо по рассчитанной цене не полностью удовлетворяются рыночные заявки и рыночные заявки (АЗ), цена аукциона закрытия в фазе сбора заявок не определяется. Если на момент определения цены аукциона закрытия в дополнительной фазе сбора заявок наибольшая цена покупки среди всех поданных заявок не пересекается с наименьшей ценой продажи, или заявки на покупку или продажу отсутствуют в Системе торгов, либо рассчитанная цена выходит за предельные значения цены аукциона закрытия, установленные Биржей, ценой аукциона закрытия считается последняя рассчитанная текущая цена (если иное не определено решением Биржи). В случае отсутствия текущей цены ценной бумагой цена аукциона закрытия не определяется, если решением Биржи не определено иное.

2.6.7.7. После определения цены аукциона закрытия проводится фаза торгов по цене аукциона закрытия. Если цена аукциона закрытия не определяется, фаза торгов по цене аукциона закрытия не проводится. Проведение фазы торгов по цене аукциона закрытия осуществляется в следующем порядке:

2.6.7.7.1. Заключение сделок в фазе торгов по цене аукциона закрытия происходит по цене аукциона закрытия.

2.6.7.7.2. Если решением Биржи не определено иное, в ходе проведения фазы торгов по цене аукциона закрытия в Систему торгов подаются заявки по цене аукциона закрытия. Также в фазе торгов по цене аукциона закрытия принимают участие лимитные заявки, рыночные заявки, лимитные заявки (АЗ), рыночные заявки (АЗ) не исполненные или частично исполненные в фазе сбора заявок и/или дополнительной фазе сбора заявок.

2.6.7.8. Заключение сделки(ок) по заявке в ходе проведения аукциона закрытия осуществляется с учетом особенностей, определенных п. 1.2.11., п. 2.1.14.1., 2.1.14.3., п. 2.1.14.11., п. 2.1.14.12., п. 2.1.14.14., п. 2.1.15. и п. 2.1.17. настоящих Правил при пересечении ценовых условий такой заявки с ценой аукциона закрытия. Заключение сделок в фазе сбора заявок или в дополнительной фазе сбора заявок происходит в момент определения цены аукциона закрытия.

2.6.7.9. При неравенстве спроса и предложения в ходе фазы сбора заявок и/или дополнительной фазы сбора заявок по цене аукциона закрытия в первую очередь удовлетворяются рыночные заявки (АЗ), затем рыночные заявки, затем лимитные заявки (АЗ) и лимитные заявки на покупку с большей ценой, а на продажу – с меньшей ценой. При равенстве цен в первую очередь удовлетворяются лимитные заявки (АЗ),

поданные ранее по времени, затем лимитные заявки, поданные ранее по времени. При неравенстве спроса и предложения в ходе фазы торгов по цене аукциона закрытия в первую очередь удовлетворяются рыночные заявки (А3) и рыночные заявки, затем лимитные заявки (А3), лимитные заявки, заявки по цене аукциона закрытия, поданные ранее по времени. Решением Биржи может быть определен иной порядок удовлетворения заявок в аукционе закрытия.

2.6.7.10. Участники торгов в ходе фазы сбора заявок и дополнительной фазы сбора заявок имеют доступ к информации о собственных заявках, а также о заявках с двадцатью лучшими ценами (десять заявок на покупку и десять заявок на продажу), находящихся в очереди в Системе торгов, в части указанного в них количества ценных бумаг (по айсберг-заявкам только в части «текущего видимого количества ценных бумаг») и цены (если решением Биржи не определено иное). Участники торгов в ходе фазы торгов по цене аукциона закрытия имеют доступ к информации о собственных заявках и совокупных объемах всех активных заявок (если решением Биржи не определено иное).

Подраздел 2.7. Заключение сделок в Режиме торгов «Неполные лоты»

2.7.1. В Режиме торгов «Неполные лоты» данного торгового дня заключаются сделки (в т.ч. Сделки Т+) на основании лимитных заявок и рыночных заявок, поданных Участниками торгов в ходе торгов в Режиме торгов «Неполные лоты».

2.7.2. 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. 1.8.2. настоящих Правил для данной ценной бумаги (если решением Биржи не предусмотрено иное).

2.7.3. Заключение сделки(ок) по лимитной заявке и рыночной заявке осуществляется с учетом особенностей, определенных п. 1.2.11., п. 2.1.14.1, п. 2.1.14.3., п. 2.1.15. и п. 2.1.17. настоящих Правил.

2.7.4. Участники торгов в Режиме торгов «Неполные лоты» имеют доступ к информации о собственных заявках, а также о заявках с двадцатью лучшими ценами (десять заявок на покупку и десять заявок на продажу), находящихся в очереди в Системе торгов, в части указанного в них количества ценных бумаг (по айсберг-заявкам только в части «текущего видимого количества ценных бумаг») и цены (если решением Биржи не установлено иное).

Подраздел 2.8. Режим переговорных сделок

2.8.1. Торги по ценным бумагам в РПС проводятся в дни, устанавливаемые в соответствии с п. 1.3.1. настоящих Правил.

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

2.8.3. Решением Биржи 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.

2.8.4. При получении встречной адресной заявки РПС к своей адресной заявке РПС Участник торгов вправе до окончания торгов в РПС (если решением 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.

2.8.5. После регистрации в Системе торгов заявка в РПС проверяется в Системе торгов на наличие допустимой встречной заявки в Системе торгов.

Решением Биржи может быть предусмотрена возможность заключения сделки в Системе торгов при наличии допустимой встречной заявки при совпадении в двух встречных адресных заявках РПС всех условий, перечисленных в п. 1.2.11., п. 2.1.14.4. настоящих Правил, за исключением количества ценных бумаг, выраженного в лотах.

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

2.8.7. Участник торгов во время торгов имеет доступ к информации об адресных заявках РПС, направленных данному Участнику торгов, а также о собственных адресных заявках РПС находящихся в Системе торгов.

Подраздел 2.9. Порядок заключения сделок РЕПО

2.9.1. Торги ценными бумагами по заключению сделок РЕПО с ценными бумагами проводятся в Режимх торгов «Аукцион РЕПО», «РЕПО с акциями», «РЕПО с акциями (в ин. валюте)», «РЕПО с облигациями», «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)», «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс. ставка», «Квал. Инвесторы – РЕПО», «Квал. Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)», «Квал. Инвесторы – РЕПО с ЦК», «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки», «РЕПО с ЦК – Адресные заявки» в дни, устанавливаемые в соответствии с п. 1.3.1. настоящих Правил. Сделки РЕПО с ценными бумагами, с которыми могут заключаться только сделки РЕПО, могут заключаться не ранее даты включения Биржей таких ценных бумаг в Список ценных бумаг, указанный в п. 1.2.21. настоящих Правил, и только за счет квалифицированных инвесторов. Торги ценными бумагами по заключению сделок РЕПО приостанавливаются/прекращаются в случаях, предусмотренных настоящими Правилами, а по ценным бумагам, с которыми могут заключаться только сделки РЕПО, также в случаях исключения соответствующей ценной бумаги из Списка ценных бумаг, с которыми на торгах могут заключаться только сделки РЕПО.

2.9.2. Для заявок на заключение сделок РЕПО Биржей могут устанавливаться возможные предельные значения, включая точность указания, следующих реквизитов:

- Ставка РЕПО;
- Сумма РЕПО;
- Количество ценных бумаг;
- 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.

Каждый торговый день, исходя из информации, полученной в соответствии с п. 2.5.18. настоящих Правил, для заявок на заключение Сделок Т+ в Режимх торгов «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки», «РЕПО с ЦК – Адресные заявки», «Квал. Инвесторы – РЕПО с ЦК» Биржа устанавливает значения и возможные значения следующих параметров:

- Расчетную цену ценной бумаги;

- Дисконт для целей заключения сделок в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки»;
- Индикативную ставку РЕПО для конкретной ценной бумаги (группы ценных бумаг) и конкретного кода расчетов.
- Диапазон колебания Ставки РЕПО для конкретной ценной бумаги (группы ценных бумаг) и конкретного кода расчетов.

2.9.3. Расчет цены первой части сделки РЕПО осуществляется в соответствии с п. 2.9.7.3., а второй части сделки РЕПО - в соответствии с п. 2.9.7.6. настоящих Правил с точностью до 4-х знаков после запятой (если решением Биржи или настоящими Правилами не установлено иное). Решением Биржи может быть предусмотрено, что в случае если эмиссионными документами предусмотрено погашение части основного долга (амортизационные выплаты), расчет цены второй части и/или других параметров сделки РЕПО в Режиме торгов «Аукцион РЕПО», «РЕПО с облигациями», «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)», «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», «Квал.Инвесторы – РЕПО», «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)», «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки», «РЕПО с ЦК – Адресные заявки», «Квал.Инвесторы – РЕПО с ЦК» осуществляется с учетом части номинальной стоимости, непогашенной на момент проведения расчета.

2.9.4. Для каждого Режиме торгов, в котором заключаются сделки РЕПО в соответствии с настоящими Правилами, Биржей устанавливается перечень ценных бумаг и/или Списков ценных бумаг, с которыми допускается совершение сделок РЕПО.

2.9.5. Заключение сделок РЕПО на условиях нецентрализованного клиринга осуществляется в соответствии с требованиями Подраздела 2.10. «Заключение сделок РЕПО на условиях нецентрализованного клиринга» настоящих Правил.

2.9.6. Для каждого из Режимов торгов (за исключением Режиме торгов «Квал.Инвесторы – РЕПО с ЦК»), в которых заключаются сделки РЕПО в соответствии с требованиями Подраздела 2.10. «Заключение сделок РЕПО на условиях нецентрализованного клиринга», Подраздела 2.17. «Порядок заключения сделок с ценными бумагами, предназначенными для квалифицированных инвесторов» настоящих Правил, действуют следующие условия:

2.9.6.1. Адресная заявка РЕПО (облигации) Участника торгов не регистрируется в Системе торгов при указании в ней кода расчетов, в соответствии с которыми дата исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО приходится на любой день после последнего дня текущего купонного периода, в который осуществляются торги такой ценной бумагой.

2.9.6.2. 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.

2.9.6.3. Если решением Биржи не определен иной порядок и срок изменения Суммы РЕПО при начислении в течение срока сделки РЕПО купонного (процентного) дохода по облигациям и/или погашения части основного долга (проведения амортизационной выплаты) по облигациям, то при выплате в течение срока сделки РЕПО купонного (процентного) дохода по облигациям и/или погашения части основного долга (проведения амортизационной выплаты) по облигациям, Сумма РЕПО уменьшается на величину уплаченного купонного (процентного) дохода и/или на величину погашенной части основного долга (амортизационной выплаты) с даты получения Биржей от Платежного агента по облигациям, в сроки и в порядке определенным соглашением с Платежным агентом по облигациям, информации о проведении выплаты начисленного купонного (процентного) дохода и/или погашенной части основного долга (проведения амортизационной выплаты). Если у Биржи отсутствует соглашение с Платежным агентом

по облигациям, предусматривающее передачу информации о выплатах доходов по облигациям, то уменьшение Суммы РЕПО проводится в плановую дату выплаты. Если плановая дата выплаты купонного (процентного) дохода по облигациям и/или погашения части основного долга (проведения амортизационной выплаты) по облигациям, учет выплат по которым производится согласно плановым датам, приходится на нерабочий день, уменьшение Суммы РЕПО проводится в первый рабочий день после плановой даты выплаты (если решением Биржи не предусмотрено иное). При отсутствии в течение срока сделки РЕПО по сделке выплат купонных (процентных) доходов и погашения части основного долга (проведения амортизационной выплаты) Сумма РЕПО остается неизменной. В случае получения Биржей информации о проведении выплаты купонного (процентного) дохода по облигациям и/или погашения части основного долга (проведения амортизационной выплаты) в дату отличную от фактической даты проведения выплаты купонного (процентного) дохода по облигациям и/или погашения части основного долга (проведения амортизационной выплаты), урегулирование взаимоотношений связанных с уменьшением (неуменьшением) Суммы РЕПО осуществляется в порядке, установленном соглашением, заключенным между Участниками торгов, являющимися сторонами по сделке РЕПО. Действие данного пункта не распространяется на сделки РЕПО, заключенные на основании адресных заявок РЕПО (корзина).

Если решением Биржи не определено иное, Сумма РЕПО в сделках РЕПО, заключенных с облигациями в Режимах торгов «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)», «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)», уменьшается на величину начисленного купонного (процентного) дохода и/или на величину погашенной части основного долга (амортизационной выплаты) исходя из кросс-курса на дату начала следующего купонного периода по облигациям, определенной эмиссионными документами (на дату получения от Платежного агента информации о выплате такого дохода).

2.9.6.4. Если решением Биржи или настоящими Правилами не предусмотрено иное, 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 30 (тридцати) календарных дней, следующих за днем выплаты/передачи эмитентом Дохода, если список лиц, имеющих право на его получение, определяется в период после исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой части сделки РЕПО и до исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по второй части сделки Стороны вправе дополнительным соглашением установить иной срок и (или) порядок передачи Дохода, переданного эмитентом в неденежном виде.

2.9.6.5. Урегулирование взаимоотношений в случаях неисполнения или ненадлежащего исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО, а также урегулирование вопросов, связанных с выплатой доходов по ценным бумагам, осуществляется в порядке, установленном соглашением, заключенным между Участниками торгов, являющимися сторонами по сделке РЕПО, а при отсутствии такового – в порядке, предусмотренном в Приложении № 12 к настоящим Правилам.

2.9.7. Порядок и условия расчета параметров сделок РЕПО, заключенных на основании адресных заявок РЕПО (корзина), определяется Клиринговой организацией, осуществляющей клиринг по таким сделкам. Для каждого Режима торгов, в котором заключаются сделки РЕПО на условиях нецентрализованного клиринга в соответствии с требованиями Подраздела 2.10. «Заключение сделок РЕПО на условиях нецентрализованного клиринга» настоящих Правил (за исключением сделок РЕПО, заключенных на основании адресных заявок РЕПО (корзина)), действуют следующие условия:

2.9.7.1. Адресная заявка РЕПО (облигации) и адресная заявка РЕПО (акции) Участника торгов (если решением Биржи не установлено иное) не регистрируются

в Системе торгов при указании в них наименования (торгового кода) ценной бумаги, по которой в текущий торговый день на Бирже отсутствует расчетная цена, методика определения которой устанавливается Биржей, за исключением адресных заявок РЕПО (облигации) и адресных заявок РЕПО (акции), в которых Участником торгов указаны следующие реквизиты: Сумма РЕПО и количество ценных бумаг.

2.9.7.2. Реквизиты заявок: сумма РЕПО, количество ценных бумаг и начальное значение дисконта – являются взаимосвязанными, и указание Участником торгов в заявке на заключение сделки РЕПО любых двух из них является достаточным для расчета в Системе торгов третьего реквизита по следующим формулам:

$$Q = \frac{S}{\left(1 - \frac{Dn}{100\%}\right) * (P_0 + a_0) * e_0 / r_0},$$

$$S = \left(1 - \frac{Dn}{100}\right) * Q * (P_0 + a_0) * e_0 / r_0,$$

$$Dn = \left(1 - \frac{S}{Q * (P_0 + a_0) * e_0 / r_0}\right) * 100\%, \text{ где}$$

e_0 - официальный курс иностранной валюты, в которой выражена номинальная стоимость ценной бумаги, по отношению к рублю, устанавливаемый Банком России на день заключения сделки. Для ценных бумаг, номинальная стоимость которых выражена в рублях, e_0 принимается равным 1;

r_0 - официальный курс иностранной валюты, в которой заключена сделка РЕПО с ценными бумагами, по отношению к рублю, устанавливаемый Банком России на день заключения сделки. Для сделок РЕПО с ценными бумагами, заключенными в рублях, r_0 принимается равным 1;

P_0 - расчетная цена по одной ценной бумаге, установленная на день заключения сделки, методика определения которой устанавливается Биржей.

Dn - начальное значение дисконта;

S - Сумма РЕПО, рассчитывается с точностью до сотых долей валюты, в которой заключена сделка РЕПО с ценными бумагами;

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

a_0 - НКД на дату исполнения первой части сделки РЕПО (при условии его расчета для данной ценной бумаги).

2.9.7.3. Цена первой части сделки РЕПО является условием сделки РЕПО и 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 (при условии его расчета для данной ценной бумаги).

2.9.7.4. При указании Участником торгов в заявке на заключение сделки РЕПО следующих реквизитов:

2.9.7.4.1. 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 умножения 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.

2.9.7.4.2. 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 умножения 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.

2.9.7.4.3. 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 умножения 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.

2.9.7.4.4. 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 умножения 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.

2.9.7.5. Для указанных в заявке на заключение сделки РЕПО минимального и максимального предельных значений дисконта, а также для указанного в заявке на заключение сделки РЕПО 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.

Если иное не определено решением Биржи, при несоблюдении хотя бы одного из указанных в настоящем подпункте Правил соотношений такая заявка на заключение сделки РЕПО не регистрируется (автоматически отклоняется) в Системе торгов.

2.9.7.6. Если решением Биржи не установлено иное, цена второй части сделки РЕПО рассчитывается каждый расчетный день, начиная с Даты исполнения первой части сделки РЕПО, заключенной в соответствующем Режиме торгов, до даты, следующей за фактической датой исполнения второй части этой сделки РЕПО, или за Датой прекращения исполнения 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 внутридневных 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 второй части сделки РЕПО, приходящееся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T''_{366} - фактическое число календарных дней между текущим днем (j-ый день) и датой исполнения второй части сделки РЕПО, 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 (при условии его расчета для данной ценной бумаги):

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

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

A_{ti} - размер НКД в i-ый день (при условии его расчета для данной ценной бумаги);

At_2 - Размер НКД (на дату исполнения второй части сделки РЕПО при условии его расчета для данной ценной бумаги).

2.9.7.7. 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.

2.9.7.8. 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.

2.9.7.9. Если решением Биржи не установлено иное, то каждый расчетный день, начиная с Даты исполнения первой части сделки РЕПО, заключенной в соответствующем Режиме торгов, до даты, следующей за фактической датой исполнения

второй части этой сделки РЕПО, или за Датой прекращения исполнения этой сделки РЕПО, одновременно с ценой второй части сделки РЕПО рассчитывается сумма возврата - 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 (при условии его расчета для данной ценной бумаги);

At_2 - Размер НКД (на дату исполнения второй части сделки РЕПО при условии его расчета для данной ценной бумаги);

S - Сумма РЕПО;

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

2.9.7.10. По отдельным ценным бумагам решением Биржи вместо порядка расчета параметров сделки РЕПО, предусмотренного в пп. 2.9.7.3. – 2.9.7.4., 2.9.7.6., 2.9.7.9. настоящих Правил, может устанавливаться следующий порядок расчета параметров сделки РЕПО:

2.9.7.10.1. При указании Участником торгов в заявке на заключение сделки РЕПО следующих реквизитов:

- Суммы РЕПО и количества ценных бумаг в Системе торгов рассчитывается начальное значение дисконта для данной сделки РЕПО по формуле, приведенной в п. 2.9.7.2. настоящих Правил.

- Суммы РЕПО и начального значения дисконта в Системе торгов рассчитывается количество ценных бумаг по формуле, приведенной в п. 2.9.7.2. настоящих Правил. С учетом рассчитанного количества ценных бумаг в Системе торгов рассчитывается новое (скорректированное) начальное значение дисконта для данной сделки РЕПО по формуле, приведенной в п. 2.9.7.2. настоящих Правил.

- Количества ценных бумаг и начального значения дисконта в Системе торгов рассчитывается сумма РЕПО по формуле, приведенной в п. 2.9.7.2. настоящих Правил.

- Суммы РЕПО, количества ценных бумаг и начального значения дисконта в Системе торгов указанное в заявке начальное значение дисконта не учитывается и рассчитывается новое (скорректированное) начальное значение дисконта для данной сделки РЕПО по формуле, приведенной в п. 2.9.7.2. настоящих Правил.

Решением Биржи может быть установлено, что, в Режимы торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» и «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» после пересчета реквизитов сделки РЕПО в порядке, предусмотренном настоящим пунктом, скорректированное значение начального дисконта используется исключительно в информационных целях и в дальнейшем при пересчетах параметров сделки РЕПО используется значение начального дисконта, установленного Биржей с учетом предложений Банка России, в соответствии с п. 2.10.4.1.6. и 2.10.4.2.6. настоящих Правил.

2.9.7.10.2. При регистрации заявки рассчитывается Стоимость обратного выкупа, исходя из Ставки РЕПО, Срока РЕПО и Суммы РЕПО по формуле:

$$S_2 = S_1 * \left(1 + \frac{R}{100} * \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right) \right), \text{ где}$$

S_2 - Стоимость обратного выкупа;

S_1 - Сумма РЕПО;

R - Ставка РЕПО;

T_{365} - число дней между исполнением 1 и 2 частей РЕПО, приходящихся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T_{366} - число дней между исполнением 1 и 2 частей РЕПО, приходящихся на календарный год, состоящий из 366 дней.

2.9.7.10.3. Если решением Биржи не установлено иное, каждый расчетный день, начиная с фактической даты исполнения первой части сделки РЕПО, заключенной в соответствующем Режиме торгов, до даты, следующей за фактической датой исполнения второй части этой сделки РЕПО, или за Датой прекращения исполнения этой сделки РЕПО, в Системе торгов рассчитывается:

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

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

S - Сумма РЕПО;

S_i - Сумма РЕПО в i -ый день;

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

R - Ставка РЕПО;

S_{II}^j - стоимость обратного выкупа в j -ый день:

$$S_{II}^j = S_j + I_j,$$

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;

Для внутридневных 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;

Размер НКД по сделке РЕПО на текущий j -ый день (раскрывается в Системе торгов информационно):

$$A_{II}^j = N_j * A_{\text{ц}} * e_j / r_j + A_j, \text{ где}$$

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

$A_{\text{ц}}$ - размер НКД в j -ый день (при условии его расчета для данной ценной бумаги);

e_j - официальный курс иностранной валюты, в которой выражена номинальная стоимость ценной бумаги, по отношению к рублю, устанавливаемый Банком России на день j . Для ценных бумаг, номинальная стоимость которых выражена в рублях, e_j принимается равным 1.

r_j - официальный курс иностранной валюты, в которой заключена сделка РЕПО с ценными бумагами, по отношению к рублю, устанавливаемый Банком России на день j . Для сделок РЕПО с ценными бумагами, заключенными в рублях, r_j принимается равным 1.

A_j - сумма НКД, рассчитанная на текущий день, по уплаченным бумагами компенсационным взносам (при условии его расчета для данной ценной бумаги):

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

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

A_{ti} - размер НКД в i -ый день (при условии его расчета для данной ценной бумаги);

e_i - официальный курс иностранной валюты, в которой выражена номинальная стоимость ценной бумаги, по отношению к рублю, устанавливаемый Банком России на день i . Для ценных бумаг, номинальная стоимость которых выражена в рублях, e_i принимается равным 1;

r_i - официальный курс иностранной валюты, в которой заключена сделка РЕПО с ценными бумагами, по отношению к рублю, устанавливаемый Банком России на день i . Для сделок РЕПО с ценными бумагами, заключенными в рублях, r_i принимается равным 1.

2.9.8. Определение обязательств по внесению компенсационных взносов по сделкам РЕПО, заключенным в Режимх торгов «Аукцион РЕПО», «РЕПО с облигациями», «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)», «РЕПО с акциями», «РЕПО с акциями (в ин. валюте)», «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», «Квал.Инвесторы – РЕПО», «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)» (за исключением сделок РЕПО, заключенных на основании адресных заявок РЕПО (корзина)) осуществляется в следующем порядке:

2.9.8.1. Если решением Биржи не установлено иное, каждый день, в который проводятся торги, при условии проведения торгов по ценной бумаге, по которой заключена данная сделка РЕПО, начиная с Даты исполнения первой части сделки РЕПО, условиями которой заданы максимальные и/или минимальные предельные значения дисконта, до даты, следующей за фактической датой исполнения второй части этой сделки РЕПО, или за Датой прекращения исполнения этой сделки РЕПО, в Системе торгов после расчета расчетной цены рассчитывается текущее значение дисконта :

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

Dt - текущее значение дисконта;

F_j - в случае заключения сделки в порядке, предусмотренном п. 2.9.7.10., настоящих Правил принимает значение $S_j + I_{j-1}$, в случае заключения сделки в ином порядке принимает значение L_j ;

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

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

L_j - стоимость обратного выкупа текущего (j -ого) дня (текущее обязательство по второй части сделки РЕПО продавца перед покупателем по первой части сделки РЕПО);

$$C_j = N_j * (P_j + At_j) * e_j / r_j, \text{ где}$$

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

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

P_j - расчетная цена по ценной бумаге текущего торгового дня, порядок определения которой устанавливается Биржей;

At_j - НКД по одной ценной бумаге текущего (j -го) дня (при условии его расчета для данной ценной бумаги);

e_j - официальный курс иностранной валюты, в которой выражена номинальная стоимость ценной бумаги, по отношению к рублю, устанавливаемый Банком России на день j . Для ценных бумаг, номинальная стоимость которых выражена в рублях, e_j принимается равным 1;

r_j - официальный курс иностранной валюты, в которой заключена сделка РЕПО с ценными бумагами, по отношению к рублю, устанавливаемый Банком России на день j . Для сделок РЕПО с ценными бумагами, заключенными в рублях, r_j принимается равным 1.

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

2.9.8.2. Если решением Биржи не установлено иное, в Режимы торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» и «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» каждый день, в который проводятся торги, при условии проведения торгов по ценной бумаге, по которой заключена данная сделка РЕПО, начиная с Даты исполнения первой части сделки РЕПО до даты, следующей за фактической датой исполнения второй части этой сделки РЕПО, или за Датой прекращения исполнения этой сделки РЕПО, в Системе торгов после расчета расчетной цены дополнительно к значениям, рассчитываемым в п. 2.9.8.1. рассчитывается текущий дефицит маржи:

$$Ds = (S_j + I_{j-1}) - \left(1 - \frac{Dn}{100\%}\right) * N_j * (P_j + At_j) * e_j / r_j, \text{ где}$$

Ds - текущий дефицит маржи;

Dn - начальное значение дисконта;

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

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

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

P_j - расчетная цена по ценной бумаге текущего торгового дня, порядок определения которой устанавливается Биржей;

At_j - НКД по одной ценной бумаге текущего (j -го) дня (при условии его расчета для данной ценной бумаги);

e_j - официальный курс иностранной валюты, в которой выражена номинальная стоимость ценной бумаги, по отношению к рублю, устанавливаемый Банком России на день j . Для ценных бумаг, номинальная стоимость которых выражена в рублях, e_j принимается равным 1;

r_j - официальный курс иностранной валюты, в которой заключена сделка РЕПО с ценными бумагами, по отношению к рублю, устанавливаемый Банком России на день j . Для сделок РЕПО с ценными бумагами, заключенными в рублях, r_j принимается равным 1.

В случае если расчетная цена по ценной бумаге не определена, то расчет текущего дефицита маржи не производится

2.9.8.3. 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). Дополнительно в Режимы торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» и «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» Банком России определяется размер допустимого уровня переоценки в валюте расчетов по сделке РЕПО. В случае если значение текущего дефицита маржи меньше отрицательного значения допустимого уровня переоценки 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). При превышении значением текущего дефицита маржи допустимого уровня переоценки 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). В случае одновременного возникновения более одного обязательства по внесению Компенсационного взноса по одной сделке РЕПО, взимается только один Компенсационный взнос.

2.9.8.4. Размер Компенсационного взноса в денежной форме по сделке РЕПО, подлежащего внесению в текущий j-й день, $Md(j)$ рассчитывается по формуле:

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

F_j - в случае заключения сделки в порядке, предусмотренном п. 2.9.7.10., настоящих Правил принимает значение $S_j + I_{j-1}$, в случае заключения сделки в ином порядке принимает значение L_j ;

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

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

L_j - стоимость обратного выкупа текущего (j-ого) дня (текущее обязательство по второй части сделки РЕПО продавца перед покупателем по первой части сделки РЕПО);

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

Dn - начальное значение дисконта.

2.9.8.5. Размер Компенсационного взноса в форме ценных бумаг по сделке РЕПО, подлежащего внесению в текущий j-й день, $Mo(j)$ рассчитывается по формуле:

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

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

F_j - в случае заключения сделки в порядке, предусмотренном п. 2.9.7.10., настоящих Правил принимает значение $S_j + I_{j-1}$, в случае заключения сделки в ином порядке принимает значение L_j ;

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

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

L_j - стоимость обратного выкупа текущего (j-ого) дня (текущее обязательство по

второй части сделки РЕПО продавца перед покупателем по первой части сделки РЕПО);

Dn - начальное значение дисконта;

At_j - НКД по одной ценной бумаге текущего (j -го) дня (при условии его расчета для данной ценной бумаги);

P_j - расчетная цена по ценной бумаге текущего торгового дня, порядок определения которой устанавливается Биржей;

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

e_j - официальный курс иностранной валюты, в которой выражена номинальная стоимость ценной бумаги, по отношению к рублю, устанавливаемый Банком России на день j . Для ценных бумаг, номинальная стоимость которых выражена в рублях, e_j принимается равным 1;

r_j - официальный курс иностранной валюты, в которой заключена сделка РЕПО с ценными бумагами, по отношению к рублю, устанавливаемый Банком России на день j . Для сделок РЕПО с ценными бумагами, заключенными в рублях, r_j принимается равным 1.

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

2.9.9. В случае если в надлежащую дату Биржей была получена от Клиринговой организации информация об отказе Участника торгов от получения 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 Датой исполнения второй части соответствующей сделки РЕПО в соответствии с настоящими Правилами является первый расчетный день, следующий за надлежащей датой внесения компенсационного взноса, в которую обязательство по внесению компенсационного взноса не было исполнено. Вторая часть соответствующей сделки РЕПО должна быть исполнена обеими ее сторонами досрочно (до Даты исполнения второй части сделки РЕПО, определенной при ее заключении), а именно, в первый расчетный день, следующий за надлежащей датой внесения компенсационного взноса, в которую обязательство по внесению компенсационного взноса не было исполнено (исходя из рассчитанных в Системе торгов на соответствующую дату параметров сделки РЕПО).

2.9.10. Решением Биржи может быть предусмотрено, что если величина рассчитанного Биржей Компенсационного взноса в форме ценных бумаг по сделке РЕПО, подлежащего внесению в текущий расчетный день, равна количеству ценных бумаг по такой сделке РЕПО, такой компенсационный взнос не подлежит внесению.

2.9.11. Решением Биржи может быть предусмотрено, что если текущее значение Суммы РЕПО по сделке РЕПО с облигациями меньше производимой в текущий день выплаты дохода по облигации (купонный доход и амортизационная выплата), то сумма РЕПО не уменьшается на величину выплаченного дохода. Доход по облигации должен быть передан покупателем по первой части РЕПО продавцу по первой части РЕПО в валюте выплаченного эмитентом ценных бумаг дохода, в срок, определенный п. 2.9.6.4. настоящих Правил..

Подраздел 2.10. Заключение сделок РЕПО на условиях нецентрализованного клиринга

2.10.1. Подача заявок и заключение сделок на условиях

нецентрализованного клиринга осуществляются с учетом условий, определенных в Подразделе 2.9. «Порядок заключения сделок РЕПО» настоящих Правил.

2.10.2. Заключение сделок РЕПО в Режимы торгов «РЕПО с акциями» и «РЕПО с акциями (в ин. валюте)» осуществляется в следующем порядке:

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

2.10.2.2. Для заключения сделок РЕПО в Режимы торгов «РЕПО с акциями» и «РЕПО с акциями (в ин. валюте)» Участники торгов подают в Систему торгов адресные заявки РЕПО (акции). Участник торгов имеет право подавать в Систему торгов неограниченное количество таких заявок.

2.10.2.3. При получении встречной адресной заявки РЕПО (акции) Участник торгов вправе до окончания торгов в соответствующем Режиме торгов (если решением 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. 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).

2.10.2.4. Заключение сделки РЕПО в Режимы торгов «РЕПО с акциями» и «РЕПО с акциями (в ин. валюте)» осуществляется при соблюдении условий, определенных п. 2.1.14.5. настоящих Правил.

2.10.2.5. 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.

2.10.3. Заключение сделок РЕПО в Режимы торгов «РЕПО с облигациями» и «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)» осуществляется в следующем порядке:

2.10.3.1. В Режимы торгов «РЕПО с облигациями» и «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)» принимают участие адресные заявки РЕПО (облигации), поданные Участниками торгов в ходе торгов текущего дня в данном Режиме торгов (если решением Биржи не установлено иное).

2.10.3.2. Для заключения сделок РЕПО в Режимы торгов «РЕПО с облигациями» и «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)» Участники торгов подают в Систему торгов адресные заявки РЕПО (облигации). Участник торгов имеет право подавать в Систему торгов неограниченное количество адресных заявок РЕПО (облигации).

2.10.3.3. При получении встречной адресной заявки РЕПО (облигации) к адресной заявке РЕПО (облигации) Участник торгов вправе до окончания торгов в соответствующем Режиме торгов (если решением 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).

2.10.3.4. Заключение сделки РЕПО в Режимы торгов «РЕПО с облигациями» и «РЕПО с облигациями (в ин. валюте)» осуществляется при соблюдении условий, определенных п. 2.1.14.5. настоящих Правил.

2.10.3.5. 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.

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

2.10.4.1. Заключение сделок РЕПО с Банком России в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» осуществляется с учетом особенностей, определенных п. 2.1.14.5. настоящих Правил, в следующем порядке:

2.10.4.1.1. Заключение сделок РЕПО с Банком России в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» проводится в форме Аукциона на основании адресных заявок РЕПО (акции), адресных заявок РЕПО (облигации) и адресных заявок РЕПО (корзина), выставляемых Участниками торгов в адрес Банка России, удовлетворяющего их путем подачи встречных адресных заявок. При получении встречной адресной заявки РЕПО к адресной заявке РЕПО Участник торгов вправе до окончания торгов в соответствующем Режиме торгов (если решением Биржи не установлено иное) либо заключить сделку РЕПО на условиях, указанных в полученной заявке, либо направить контрагенту адресную заявку РЕПО с новыми условиями, либо отклонить полученную заявку.

2.10.4.1.2. В данном Режиме торгов подавать адресные заявки РЕПО (акции) и адресные заявки РЕПО (облигации) имеют возможность Банк России и Участники торгов КО, выступающие от своего имени и за свой счет, с которыми Банком России заключены необходимые соглашения. В случаях установленных Банком России решением Биржи может быть определена возможность участия в торгах в данном Режиме Участников торгов КО, выступающих от своего имени и за счет клиентов, являющихся кредитными организациями. Банк России и Участники торгов, подписавшие Генеральное соглашение с Банком России, а также подписавшие с Клиринговой организацией, осуществляющей клиринг сделок, заключенных на основании адресных заявок РЕПО (корзина), договор по управлению обеспечением и договор оказания клиринговых услуг имеют возможность подавать в данном Режиме торгов адресные заявки РЕПО (корзина).

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

2.10.4.1.4. При проведении торгов в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» сделки заключаются на основании адресных заявок РЕПО, поданных Участниками торгов в ходе торгов текущего торгового дня в данном Режиме торгов. В адресных заявках РЕПО должны быть указаны реквизиты, предусмотренные в п. 2.1.14.5. настоящих Правил.

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

2.10.4.1.6. Биржа с учетом предложений Банка России и/или Клиринговой организации 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 (списки ценных бумаг), по которым могут приниматься заявки;
- срок, на который заключается сделка РЕПО;
- допустимые коды расчетов (типы 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 по одной ставке РЕПО;
- приоритет подбора ценных бумаг.

2.10.4.1.7. 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.

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

2.10.4.1.9. 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.

2.10.4.1.10. Порядок удовлетворения заявок в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» определяется Биржей с учетом определенных Банком России условий, полученных в соответствии с п. 2.10.4.1.5. настоящих Правил. Неудовлетворенные на аукционе заявки отклоняются Банком России после удовлетворения заявок, подлежащих удовлетворению. При отсутствии технической возможности отклонения заявок Банком России, такие заявки снимаются Маклером по получению телефонограммы от работника Банка России, указанного в Регистрационной карточке. В телефонограмме должны быть указаны следующие данные:

- ФИО работника Банка России, передавшего телефонограмму;
- Торговый идентификатор;
- номера заявок, которые необходимо снять, с указанием реквизитов заявок в соответствии с Подразделом 2.1. «Заявки» настоящих Правил;
- 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 работнику Банка России.

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

2.10.4.2. Заключение сделок РЕПО с Банком России в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» осуществляется с учетом особенностей, определенных п. 2.1.14.5. настоящих Правил, в следующем порядке:

2.10.4.2.1. Заключение сделок РЕПО с Банком России по фиксированной ставке РЕПО в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» осуществляется на основании адресных заявок РЕПО (акции), адресных заявок РЕПО (облигации) и адресных заявок РЕПО (корзина), выставляемых Участниками торгов в адрес Банка России, удовлетворяющего их путем подачи встречных адресных заявок. При получении встречной адресной заявки РЕПО к адресной заявке РЕПО Участник торгов вправе до окончания торгов в соответствующем Режиме торгов (если решением Биржи не установлено иное) либо заключить сделку РЕПО на условиях, указанных в полученной заявке, либо направить контрагенту адресную заявку РЕПО с новыми условиями, либо отклонить полученную заявку.

2.10.4.2.2. В данном Режиме торгов подавать адресные заявки РЕПО (акции) и адресные заявки РЕПО (облигации) имеют возможность Банк России и

Участники торгов КО, выступающие от своего имени и за свой счет, с которыми Банком России заключены необходимые соглашения. В случаях установленных Банком России решением Биржи может быть определена возможность участия в торгах в данном Режиме Участников торгов КО, выступающих от своего имени и за счет клиентов, являющихся кредитными организациями. Банк России и Участники торгов, подписавшие Генеральное соглашение с Банком России, а также подписавшие с Клиринговой организацией, осуществляющей клиринг сделок, заключенных на основании адресных заявок РЕПО (корзина), договор по управлению обеспечением и договор оказания клиринговых услуг, имеют возможность подавать в данном Режиме торгов адресные заявки РЕПО (корзина).

2.10.4.2.3. 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 дня в данном Режиме торгов. В адресных заявках РЕПО (облигации) должны быть указаны реквизиты, предусмотренные в п. 2.1.14.5. настоящих Правил.

2.10.4.2.4. При проведении торгов по акциям в Режиме торгов «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» заключение сделок осуществляется 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. 2.1.14.5. настоящих Правил.

2.10.4.2.5. 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.

2.10.4.2.6. Биржа с учетом предложений Банка России и/или Клиринговой организации определяет возможные параметры реквизитов заявок, в том числе:

- разрешенные типы торгово-клиринговых счетов;
- ценные бумаги (списки ценных бумаг), по которым могут приниматься заявки;
- срок, на который заключается сделка РЕПО;
- допустимые коды расчетов (типы 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 по одной ставке РЕПО;
- приоритет подбора ценных бумаг.

2.10.4.2.7. 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.

2.10.4.2.8. 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.

2.10.4.2.9. 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. 2.10.4.2.5. настоящих Правил. Неудовлетворенные заявки отклоняются Банком России после удовлетворения заявок, подлежащих удовлетворению. При отсутствии технической возможности отклонения заявок Банком России, такие заявки снимаются Маклером по получению телефонограммы от работника Банка России, указанного в Регистрационной карточке. В телефонограмме должны быть указаны следующие данные:

- ФИО работника Банка России, передавшего телефонограмму;
- Торговый идентификатор;
- номера заявок, которые необходимо снять, с указанием реквизитов заявок в соответствии с Подразделом 2.1. «Заявки» настоящих Правил;
- 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 работнику Банка России.

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

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

2.10.5.1. Заключение сделок РЕПО в Режиме торгов «Аукцион РЕПО» осуществляется с учетом особенностей, определенных п. 2.1.14.5. настоящих Правил, 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. 2.10.2.3. и п. 2.10.3.3. настоящих Правил.

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

2.10.5.3. 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. 2.1.14.5. настоящих Правил.

2.10.5.4. При проведении торгов по акциям в Режиме торгов «Аукцион РЕПО» принимают участие адресные заявки РЕПО (акции), поданные Участниками торгов в ходе торгов текущего дня в данном Режиме торгов. В адресных заявках РЕПО (акции) должны быть указаны реквизиты, предусмотренные п. 2.1.14.5. настоящих Правил.

2.10.5.5. 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».

2.10.5.6. 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.

2.10.5.7. 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.

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

2.10.5.9. 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.

2.10.5.10. Порядок удовлетворения заявок в Режиме торгов «Аукцион РЕПО», определяется Биржей с учетом предложений Эмитента, полученных в соответствии с п. 2.10.4.3.5. настоящих Правил. Неудовлетворенные на аукционе заявки снимаются по окончании периода удовлетворения заявок.

2.10.6. Заключение сделок РЕПО в Режиме торгов «Квал.Инвесторы – РЕПО» и «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)» осуществляется в порядке, установленном в Подразделе 2.17. «Порядок заключения сделок с ценными бумагами, предназначенными для квалифицированных инвесторов» настоящих Правил с учетом особенностей настоящего Подраздела Правил.

Подраздел 2.11. Торги по акциям и облигациям, допущенным к размещению

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

2.11.2. 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) (если иное не определено решением Биржи), 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 Подразделом 2.12. «Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» и «Размещение: Адресные заявки»» настоящих Правил. Формы проведения торгов по ценным бумагам, допущенным к размещению, определяются Биржей. Биржей может быть также определен иной срок или порядок проведения торгов по ценным бумагам, допущенным к размещению, на основании эмиссионных документов и иных документов, регламентирующих порядок проведения размещения выпуска ценных бумаг.

Подраздел 2.12. Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» и «Размещение: Адресные заявки»

2.12.1. При необходимости проведения торгов по ценным бумагам, допущенным к обращению на Бирже, в форме Аукциона, Конкурса или путем выставления адресных заявок по фиксированной цене (доходности) не позднее, чем за десять рабочих дней (или в иной, согласованный между Биржей и Заявителем, срок) 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 Подразделе Правил.

2.12.2. При необходимости проведения торгов в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» по ценным бумагам, допущенным к обращению на Бирже, 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 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 пп. 2.12.3.1. – 2.12.3.4., пп. 2.12.3.7.-2.12.3.10. настоящих Правил.

2.12.3. Торги, проводимые в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» в форме Аукциона, осуществляются в следующем порядке:

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

2.12.3.2. Условия подачи, отзыва и удовлетворения заявок на покупку ценных бумаг в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» определяются в Подразделах 2.1. «Заявки», 2.2. «Условия принятия заявки к регистрации» настоящих Правил. По окончании периода сбора заявок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» Участник торгов не может отозвать поданную заявку в данном Режиме торгов.

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

Решением 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.

2.12.3.4. Заявки на покупку, подаваемые в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» содержат реквизиты, указанные в п. 2.1.14.1. и п. 2.1.14.3. настоящих Правил, за исключением реквизита «видимое количество ценных бумаг».

2.12.3.5. Решением Биржи может быть предусмотрена возможность подачи Участником торгов в Систему торгов лимитной или рыночной заявки, в которой наряду с реквизитами, предусмотренными п. 2.1.14.1. и п. 2.1.14.3. настоящих Правил, также может быть указана дата активации заявки в формате «ДДММГГГГ». При наступлении времени, определенного решением Биржи, в указанную дату возможна регистрация сделки/сделок на основании данной заявки. Проверка обеспечения по таким заявкам осуществляется в соответствии с Правилами клиринга во время и дату, определяемую решением Биржи. Решением 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 Биржи.

2.12.3.6. Решением Биржи может быть предусмотрена возможность подачи Участником торгов – продавцом в Систему торгов лимитной заявки, в которой наряду с реквизитами, предусмотренными п. 2.1.14.1. 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 на продажу, в которой указано время активации, в соответствии с настоящими Правилами может быть отменена или изменена Участником торгов – продавцом и не может быть удовлетворена до наступления времени активации. После наступления времени активации заявка, в которой указано время активации, может быть отозвана Участником торгов (в том числе в части остатка), если иное не определено решением Биржи, и/или удовлетворена в соответствии с п. 2.12.3.10. настоящих Правил.

2.12.3.7. Участники торгов во время периода сбора заявок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» имеют доступ к информации обо всех заявках, поданных в данном Режиме торгов данным Участником торгов, если иное не установлено решением Биржи.

2.12.3.8. По окончании периода сбора заявок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» Биржа передает Продавцу и/или Эмитенту Сводный реестр заявок на покупку ценных бумаг, подписанный Маклером, в котором указываются все заявки, поданные и не отозванные Участниками торгов на момент окончания периода сбора заявок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион».

2.12.3.9. 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.

2.12.3.10. 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. При этом, заключение сделок осуществляется с учетом особенностей, определенных пп. 2.1.14.1., 2.1.14.3. и п. 2.1.17. настоящих Правил.

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

2.12.4.1. Заключение сделок в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» может проводиться в форме Конкурса на основании адресных заявок, выставляемых 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 Конкурс Участники торгов имеют право подавать заявки на покупку ценных бумаг на Конкурсе и отзывать ранее поданные заявки на покупку ценных бумаг на Конкурсе. По окончании периода сбора заявок на Конкурсе Участник торгов не может отозвать поданную заявку на покупку ценных бумаг.

2.12.4.2. При проведении Конкурса в Системе торгов принимаются безадресные и адресные заявки на заключение сделок в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки». Если иное не определено решением Биржи 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.

Решением Биржи могут быть установлены предельные значения объема заявки для адресной заявки.

В адресной заявке при проведении Конкурса в дополнение к реквизитам адресной заявки Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки», указанным в п. 2.1.14.6. и п. 2.12.5.3. настоящих Правил, должен быть заполнен дополнительный реквизит – «ссылка». Реквизит «ссылка» используется для указания величины приемлемой для Участников

торгов процентной ставки, определяемой в ходе Конкурса (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, указанной в заявке).

2.12.4.3. По окончании периода сбора заявок на Конкурсе Биржа передает Продавцу и/ или Эмитенту Сводный реестр заявок на Конкурсе, подписанный Маклером, в котором указываются все заявки на покупку ценных бумаг на Конкурсе, поданные и не отозванные 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.

2.12.4.4. 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 Биржи может быть предусмотрена возможность заключения сделки в Системе торгов при совпадении в двух встречных адресных заявках всех условий, перечисленных в п. 2.1.14.6. настоящих Правил, за исключением количества ценных бумаг, выраженного в лотах.

2.12.5. 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. Решением Биржи может быть предусмотрено, что торги в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» по фиксированной цене (доходности) состоят из периода сбора заявок и периода удовлетворения заявок.

2.12.5.1. Если иное не определено решением Биржи 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.

2.12.5.2. Решением Биржи могут быть установлены предельные значения объема заявки для адресной заявки.

2.12.5.3. 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.

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.

2.12.5.4. Заключение сделок в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» осуществляется при соблюдении условий, определенных в п. 2.1.14.6. настоящих Правил. Решением Биржи может быть предусмотрена возможность заключения сделки в Системе торгов при совпадении в двух допустимых встречных адресных заявках всех условий, определенных в п. 2.1.14.6. настоящих Правил, за исключением количества ценных бумаг, выраженного в лотах, а также цены за одну ценную бумагу, если цена,

указанная в заявке на продажу, не хуже цены, указанной в заявке на покупку. При этом не допускается заключение сделки с объемом сделки, превышающим указанный в адресной заявке на покупку ценных бумаг объем денежных средств, предназначенных для покупки ценных бумаг, за вычетом НКД на Дату исполнения и комиссионного вознаграждения.

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

2.12.6. Решением 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. 2.1.14.6. настоящих Правил, также может быть указана дата активации заявки в формате «ДДММГГГГ». При наступлении времени, определенного решением 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 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 отозвана или изменена Участником торгов до наступления времени активации, определенного решением Биржи.

2.12.7. Для облигаций, Эмитентом или Генеральным агентом эмитента по обслуживанию которых (далее – Генеральный агент) является Банк России, в соответствии с документами, регламентирующими порядок проведения размещения выпуска ценных бумаг, торги по размещению осуществляются в следующих формах:

- в форме Аукционов проводимых в процессе размещения в первый день срока размещения (далее – размещение) и/или в процессе продажи неразмещенных ценных бумаг (далее - доразмещение) в Режиме торгов «Размещение: Аукцион»;
- в форме заключения сделок при размещении (доразмещении) в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки».

2.12.7.1. На основе предоставленных Эмитентом/Генеральным агентом (Продавцом ценных бумаг) документов, содержащих условия проведения размещения выпуска ценных бумаг (наряду с определенной п. 2.12.1. настоящих Правил информацией) Биржей могут быть установлены отдельные особенности проведения торгов, к которым относятся:

- ограничения по возможным категориям Участников торгов и их клиентов, которые могут участвовать в размещении (доразмещении);
- возможность проведения торгов в процессе обращения одновременно с проведением торгов по размещению и/или доразмещению;
- разрешенные виды (подвиды) заявок, доля заявок одного вида (подвида) по отношению к общему объему всех заявок, поданных Участником торгов в рамках одного Аукциона;
- допустимые коды расчетов;
- шаг цены и порядок округления при расчете цены или доходности;
- срок и порядок удовлетворения заявок;
- иные ограничения и/или особенности проведения торгов по размещению и/или доразмещению.

2.12.7.2. Заключение сделок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» в форме Аукциона, осуществляются в соответствии с п. 2.12.3., настоящих Правил, с учетом следующих особенностей:

- Перед проведением Аукциона все ранее поданные безадресные заявки по данной

ценной бумаге в иных Режимов торгов (в случае если в данный торговый день проводятся торги по данным ценным бумагам в форме Аукциона, а также проводятся торги в процессе обращения) снимаются Биржей до начала сбора заявок на Аукцион.

- Заключение сделок по данной ценной бумаге в иных Режимов торгов до окончания Аукциона не проводится, за исключением заключения сделок на основе адресных заявок, если иное не установлено решением Биржи.

- В рамках одного Аукциона возможна подача заявок только с указанием одного допустимого кода расчетов.

- Участники торгов могут подавать рыночные заявки с указанием объема денежных средств, предназначенных для покупки ценных бумаг, (далее, для целей настоящего Подраздела – неконкурентная заявка) и лимитные заявки (далее, для целей настоящего Подраздела – конкурентная заявка);

- Для конкурентных заявок отсутствует возможность указания следующих дополнительных подтипов:

- «По средневзвешенной цене»;
- «Полностью или отклонить»

- Цена удовлетворения для неконкурентных заявок рассчитывается в Системе торгов в автоматическом режиме на основе цен конкурентных заявок на Аукционе на момент подачи допустимой встречной заявки на продажу по следующей формуле:

$$P = \frac{\sum_i (P_i * Q_i)}{\sum_i Q_i}, \text{ где}$$

P - Цена удовлетворения для неконкурентных заявок;

P_i – цена удовлетворения конкурентной заявки;

Q_i – количество приобретаемых ценных бумаг в удовлетворяемой заявке.

- Конкурентные заявки удовлетворяются по цене, указанной Участником торгов при подаче этой конкурентной заявки.

- Конкурентная заявка всегда удовлетворяется полностью, если иное не определено решением Биржи.

- Количество приобретаемых ценных бумаг по неконкурентной заявке рассчитывается как целая часть от деления суммы денежных средств по данной заявке на сумму платежа по приобретению одной ценной бумаги, которая включает установленную цену, НКД на день исполнения и совокупный размер комиссионного вознаграждения Биржи, Клиринговой организации и Технического центра на фондовом рынке, если иное не определено решением Биржи.

- После окончания Аукциона все неудовлетворенные заявки снимаются Биржей.

- При проведении торгов по размещению (доразмещению) в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» при заключении сделок с кодом расчетов, отличным от T0, возможность досрочного исполнения таких сделок Участникам торгов не предоставляется.

- Решением Биржи может быть предусмотрена возможность частичного удовлетворения заявок.

При этом, в случае превышения объема спроса по номинальной стоимости по конкурентным заявкам по максимальной цене, указанной в поданных участниками аукциона заявках, над объявленным объемом размещения по номинальной стоимости на аукционе, конкурентные заявки удовлетворяются частично, пропорционально доле конкурентной заявки, поданной участником по максимальной цене, в общем объеме конкурентных заявок по максимальной цене. Неконкурентные заявки не удовлетворяются.

В случае превышения общего объема спроса по номинальной стоимости по максимальной цене, указанной в поданных участниками аукциона заявках, над объявленным объемом размещения по номинальной стоимости на аукционе (при условии, что объем спроса по конкурентным заявкам по максимальной цене не превышает

объявленный объем размещения) конкурентные заявки удовлетворяются полностью, а неконкурентные — частично, пропорционально доле неконкурентной заявки в общем объеме неконкурентных заявок.

В случае превышения общего объема спроса по номинальной стоимости по цене отсечения над объявленным объемом размещения по номинальной стоимости на аукционе (при условии, что суммарный объем спроса по конкурентным заявкам, поданным по ценам, превышающим цену отсечения, с учетом неконкурентных заявок не превышает объявленный объем размещения на аукционе) конкурентные заявки, поданные по цене отсечения, удовлетворяются частично, пропорционально доле конкурентной заявки в общем объеме конкурентных заявок, поданных по этой цене. Неконкурентные заявки удовлетворяются полностью.

Решением Биржи по согласованию с Эмитентом/Генеральным агентом (Продавцом), в том числе могут устанавливаться дополнительные особенности удовлетворения заявок. Указанное решение Биржи раскрывается на сайте Биржи в сети Интернет не позднее дня проведения Аукциона.

2.12.8. Сроки и время проведения торгов в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» или в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» по ценной бумаге определенного эмитента устанавливается решением Биржи на основании Решения о выпуске и/или иных документов эмитента, регламентирующих порядок проведения размещения и обращения ценной бумаги. Сроки и время проведения торгов в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» или в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» по облигациям, Эмитентом или Генеральным агентом по которым является Банк России, могут устанавливаться и/или изменяться Биржей на основании письма Банка России.

2.12.9. После удовлетворения заявок, подлежащих удовлетворению, в периоде удовлетворения заявок в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» все неудовлетворенные заявки на покупку ценных бумаг отклоняются в Системе торгов Продавцом. В соответствии с решением 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.

2.12.10. Если это предусмотрено предоставленными Эмитентом и/или Заявителем в соответствии с п. 1.12.1. настоящих Правил документами, содержащими соответствующие условия проведения размещения выпуска ценных бумаг/продажи ценных бумаг, порядком проведения торгов по ценным бумагам в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» может быть предусмотрено проведение процедуры контроля обеспечения и блокировка частичного обеспечения по адресным заявкам на покупку с указанной датой активации, до наступления даты активации. При этом размер такого частичного обеспечения устанавливается решением Биржи, на основании вышеуказанных документов, предоставленных Эмитентом и/или Заявителем, и не может быть больше 10% от объема заявки. Проверка и блокировка частичного обеспечения осуществляется в соответствии с порядком, установленном в Правилах клиринга. Отсутствие в момент активации денежных средств в количестве, достаточном для заключения сделки, означает неисполнение Участником торгов, подавшим такую заявку (далее для целей настоящего пункта – Потенциальный покупатель), принятого на себя обязательства, указанного в п.п. б) п. 2.1.14.6 настоящих Правил, и отказ от исполнения обязательства, указанного в п.п. а) п. 2.1.14.6 настоящих Правил.

Продавец и Потенциальный покупатель соглашаются с тем, что в случае отказа Потенциального покупателя от принятых на себя обязательств по заключению договора, данное обязательство может быть прекращено предоставлением взамен исполнения отступного на следующих условиях:

- а) Потенциальный покупатель взамен исполнения обязательства, указанного в п.п. а) п. 2.1.14.6. настоящих Правил, предоставляет Продавцу отступное в сумме денежных средств, заблокированных Клиринговой организацией в качестве частичного обеспечения по заявке, в соответствии с первым абзацем настоящего пункта;
- б) С момента предоставления отступного обязательства Потенциального покупателя в соответствии с п.п. а) и б) п. 2.1.14.6. настоящих Правил прекращаются полностью;
- в) Моментом предоставления отступного является момент увеличения планового значения соответствующей денежной позиции Продавца в Клиринговой системе Клиринговой организации на сумму отступного;
- д) Передача отступного осуществляется в соответствии с порядком, установленным в Правилах клиринга.

2.12.11. По решению 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.

2.12.12. В случаях установления возможности подачи Участниками торгов заявок с указанием реквизита «дата активации» в соответствии с п. 2.12.3.5. и п. 2.12.6. настоящих Правил распоряжением Биржи может быть предусмотрена обязанность Участника торгов, подавшего такую заявку, к определенному Биржей времени в дату активации обеспечить наличие суммы денежных средств, достаточной для обеспечения надлежащего исполнения обязательств по сделке, которая может быть заключена на основании такой заявки.

Подраздел 2.13. Проведение торгов по приобретению акций и выкупу облигаций

Выкуп облигаций

2.13.1. Выкуп облигаций может быть осуществлен:

- эмитентом – если решением о выпуске и/или иными документами эмитента, регламентирующими условия выпуска облигаций, определены возможность и порядок досрочного погашения эмитентом облигаций, а также возможность и порядок приобретения облигаций эмитентом по требованию владельцев/соглашению с владельцем (владельцами) облигаций с возможностью их дальнейшего обращения;

- иным лицом (иными лицами) – при условии выполнения им (ими) соответствующих требований законов и иных нормативных правовых актов Российской Федерации.

2.13.2. Выкуп облигаций на Бирже может проводиться во всех Режимов торгов, предусмотренных в п. 1.2.6. настоящих Правил, за исключением следующих Режимов торгов: «Размещение: Аукцион», «Размещение: Адресные заявки», Режим торгов крупными пакетами ценных бумаг, а также путем заключения сделок РЕПО, если иное не определено решением 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 Подразделах Правил. Торги по выкупу облигаций в Режимов торгов «Выкуп: Аукцион» и «Выкуп: Адресные заявки» осуществляется в порядке, предусмотренном в настоящем Подразделе Правил, если иное не определено решением Биржи.

2.13.3. При проведении торгов по выкупу облигаций в Режиме торгов «Выкуп: Аукцион» и/или в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» эмитент (или иное лицо, выступившее с предложением о выкупе облигаций) 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.

2.13.4. При наличии технической возможности Биржа определяет сроки, форму и порядок проведения торгов по выкупу облигаций на Бирже. Биржа в сроки, установленные решением Биржи, сообщает Участникам торгов наименование Участника торгов, выполняющего функции покупателя облигаций, а также об особенностях и времени проведения операций по выкупу облигаций на Бирже.

2.13.5. При проведении торгов по выкупу облигаций Участники торгов, за исключением Участника торгов, выполняющего функции покупателя облигаций (далее – Покупатель), не имеют права подавать заявки на покупку этих облигаций.

2.13.6. 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.

2.13.7. 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.

2.13.7.1. Условия подачи, отзыва и удовлетворения заявок на продажу облигаций на Аукционе в Режиме торгов «Выкуп: Аукцион» определяются в соответствии с Подразделами 2.1. «Заявки», 2.2. «Условия принятия заявки к регистрации» настоящих Правил. По окончании периода сбора заявок Участник торгов не может отозвать поданную заявку на Аукционе.

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

2.13.7.3. Решением 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.

2.13.7.4. Заявки на продажу, подаваемые в Режиме торгов «Выкуп: Аукцион» содержат реквизиты, указанные в п. 2.1.14.1. и 2.1.14.3. настоящих Правил, за исключением реквизита «видимое количество ценных бумаг».

2.13.7.5. Решением Биржи может быть предусмотрена возможность подачи Участником торгов в Систему торгов лимитной или рыночной заявки, в которой наряду с реквизитами, предусмотренными п. 2.1.14.1. и 2.1.14.3. настоящих Правил, также может быть указана дата активации заявки в формате «ДДММГГГГ». При наступлении времени, определенного решением 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 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 Биржи.

2.13.7.6. Участники торгов во время периода сбора заявок имеют доступ к информации обо всех заявках, поданных данным Участником торгов, если иное не установлено решением Биржи.

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

2.13.7.8. Во время периода удовлетворения заявок Покупатель подает в

Систему торгов заявку на покупку облигаций, которая является лимитной заявкой без сохранения в котировках.

2.13.7.9. Порядок удовлетворения заявок на Аукционе определяется Решением о выпуске и/или иными документами, регламентирующими порядок проведения выкупа облигаций. При этом заключение сделок осуществляется с учетом особенностей, определенных пп. 2.1.14.1., и 2.1.14.3. настоящих Правил.

2.13.8. Заключение сделок с ценными бумагами в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» осуществляется на основании адресных заявок, выставляемых Участниками торгов в адрес Покупателя, удовлетворяющего их путем подачи встречных адресных заявок.

2.13.9. В Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» в Системе торгов принимаются безадресные и адресные заявки на заключение сделок в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки».

2.13.10. Решением Биржи могут быть установлены предельные значения объема заявки для адресной заявки.

2.13.11. Решением Биржи может быть предусмотрена возможность подачи Участником торгов в Систему торгов адресной заявки, в которой наряду с реквизитами, предусмотренными в п. 2.1.14.7. настоящих Правил, также может быть указана дата активации заявки в формате «ДДММГГГГ». При наступлении времени, определенного решением 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 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 Биржи.

2.13.12. 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.

2.13.13. Заключение сделок в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» осуществляется при соблюдении условий, определенных п. 2.1.14.7. настоящих Правил.

Решением 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, а также цены за одну ценную бумагу, если цена, указанная в заявке на покупку, не хуже цены, указанной в заявке на продажу.

2.13.14. Участники торгов во время проведения торгов в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» имеют доступ к информации об адресных заявках, адресованных данному Участнику торгов, о собственных адресных заявках, а также обо всех безадресных заявках Режима торгов «Выкуп: Адресные заявки», находящихся в Системе торгов.

2.13.15. В соответствии с решением 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 выкупа облигаций.

2.13.16. Для облигаций, Эмитентом или Генеральным агентом по которым является Банк России, в соответствии с документами, регламентирующими порядок проведения размещения и/или выкупа выпуска ценных бумаг, для отдельной облигации или категории (типа) облигаций торги по выкупу осуществляются в следующем формах:

- в форме Аукциона, в процессе которого определяется цена выкупа в Режиме торгов «Выкуп: Аукцион»;
- в форме заключения сделок по фиксированной цене в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки».

2.13.16.1. На основе предоставленных Эмитентом/Генеральным агентом (Покупателем облигаций) документов, содержащих условия проведения выкупа ценных бумаг (наряду с определенной п. 2.13.3. настоящих Правил информацией), Биржей могут быть установлены отдельные особенности, к которым относятся:

- наличие ограничений по возможным категориям Участников торгов и их клиентов, которые могут участвовать в торгах по выкупу облигаций;
- разрешенные виды (подвиды) заявок, доля заявок одного вида (подвида) по отношению к другому виду (подвиду) в объеме всех поданных заявок;
- допустимые коды расчетов;
- шаг цены и порядок округления при расчете цены или доходности;
- срок и порядок удовлетворения заявок;
- ограничения на объем выкупа облигаций.
- иные ограничения и/или особенности проведения торгов по выкупу.

2.13.16.2. Заключение сделок в Режиме торгов «Выкуп: Аукцион» в форме Аукциона по определению цены выкупа, осуществляются в соответствии с п. 2.13.7., п. 2.13.16.1. настоящих Правил, с учетом следующих особенностей:

- в рамках одного Аукциона возможна подача заявок только с указанием одного допустимого кода расчетов.
- сделки по выкупу облигаций могут заключать только те Участники торгов, которые имеют право в соответствии с эмиссионными документами осуществлять такие операции;
- после окончания Аукциона все неудовлетворенные заявки снимаются автоматически.

2.13.16.3. Заключение сделок в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки», осуществляются в соответствии с п. 2.13.8. и п. 2.13.16.1. настоящих Правил, с учетом следующих особенностей:

- при заключении сделок с кодом расчетов, отличным от Т0, возможность досрочного исполнения таких сделок для Участников торгов не предоставляется.
- сделки по выкупу облигаций могут заключать только те Участники торгов, которые имеют право в соответствии с эмиссионными документами осуществлять такие операции;
- в заявках Участников торгов на продажу облигаций указывается цена, равная цене выкупа, установленной в эмиссионных документах, оферте или ином предложении о покупке облигаций.

2.13.16.4. Сроки и время проведения торгов в Режиме торгов «Выкуп: Аукцион» или в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» по облигациям, Эмитентом или Генеральным агентом по которым является Банк России, могут устанавливаться и/или изменяться Биржей на основании письма Банка России.

Приобретение акций

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

2.13.18. Заключение сделок по приобретению акций на Бирже осуществляется в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» в порядке, предусмотренном п. 2.13.8. – 2.13.11. настоящих Правил с учетом особенностей, предусмотренных п. 2.13.14. – 2.13.15. настоящих Правил, в течение срока приобретения, составляющего не менее 30 дней с даты определения цены приобретения.

2.13.19. Эмитент предоставляет на Биржу следующие документы:

- Нотариально удостоверенную копию устава (со всеми изменениями и дополнениями), в которой предусмотрено право приобретать размещенные акции;
- 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;
- Заявление, соответствующее требованиям, предусмотренным в п. 2.13.20 настоящих Правил;
- 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;
- Документ, подтверждающий согласование с Центральным банком Российской Федерации цены приобретения (в случаях, предусмотренных законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации);
- Документы, подтверждающие выполнение эмитентом требований по уведомлению акционеров о принятии решения о приобретении акций.

2.13.20. 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.

2.13.21. Не позднее, чем за десять рабочих дней до даты приобретения акций, эмитент предоставляет на биржу Заявление, предусмотренное п. 2.13.19. настоящих Правил.

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

2.13.23. 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.

2.13.24. 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.

2.13.25. В случаях установления возможности подачи Участниками торгов заявок с указанием реквизита «дата активации» в соответствии с п. 2.13.7.5 и п. 2.13.11. настоящих Правил Биржей может быть предусмотрена обязанность Участника торгов, подавшего такую заявку, к определенному решению Биржи времени в дату активации обеспечить наличие количества ценных бумаг, достаточного для обеспечения надлежащего исполнения обязательств по сделке, которая может быть заключена на основании такой заявки.

Подраздел 2.14. Порядок проведения торгов по обмену ценных бумаг

2.14.1. Торги по обмену ценных бумаг проводятся с облигациями, Эмитентом или Генеральным агентом по которым является Банк России. Для отдельных выпусков таких облигаций в соответствии с документами, регламентирующими порядок проведения размещения и выкупа ценных бумаг, на Бирже с использованием Системы торгов проводятся торги по обмену ценных бумаг путем осуществления операций продажи одного выпуска облигаций в Режиме(ах) торгов, предусмотренных для проведения размещения (доразмещения) в соответствии с п. 2.12.6., и покупки иного выпуска облигаций в соответствии с п. 2.13.16. настоящих Правил в Режиме(ах) торгов, предусмотренных для проведения выкупа.

2.14.2. Биржей могут быть установлены отдельные особенности на основе предоставленных не позднее, чем за 10 дней до даты проведения торгов по обмену ценных бумаг Эмитентом или Генеральным агентом эмитента документов, содержащих условия по проведению торгов по обмену ценных бумаг, к которым относятся:

- ограничения по возможным категориям Участников торгов и их клиентов, которые могут участвовать в размещении, доразмещении, выкупе облигаций;
- разрешенные виды (подвиды) заявок, доля заявок одного вида (подвида) по отношению к другому виду (подвиду) в объеме всех поданных заявок;
- разрешенные коды расчетов;
- шаг цены и порядок округления при расчете цены или доходности;
- срок и порядок удовлетворения заявок;
- осуществление выкупа ценных бумаг в объеме не более приобретенного в ходе размещений (доразмещения) иного выпуска ценных бумаг этого эмитента или иного эмитента;
- иные ограничения и\или особенности проведения торгов.

2.14.3. Сделки заключаются в соответствии с условиями, установленными для соответствующего режима торгов с учетом следующих особенностей:

- сделки по выкупу облигаций могут заключать только те Участники торгов, которые имеют право в соответствии с эмиссионными документами осуществлять такие операции, и которые заключили сделки при размещении (доразмещении) облигаций в установленном в соответствии с решением Биржи объеме;
- в заявках Участников торгов на продажу указывается цена, равная цене выкупа, установленной в эмиссионных документах, оферте или ином предложении о покупке облигаций;
- в заявках на заключение сделок указывается допустимый код расчетов, определенный Биржей;
- исполнение сделок осуществляется в порядке, определенном Правилами клиринга.

Подраздел 2.15. Режим торгов крупными пакетами ценных бумаг

2.15.1. Торги по ценным бумагам в Режиме торгов крупными пакетами ценных бумаг проводятся в форме Аукционов в торговые дни, устанавливаемые в

соответствии с п. 1.3.1. настоящих Правил. В течение торгового дня на Бирже может проводиться несколько Аукционов, время начала и окончания которых устанавливается Биржей.

2.15.2. Для целей заключения сделок в Режиме торгов крупными пакетами ценных бумаг Биржей устанавливаются:

- Период времени, в течение которого в каждый момент времени в Системе торгов с целью определения цены Аукциона производится расчет и фиксация средних цен между лучшей текущей ценой покупки и лучшей текущей ценой продажи, сведения о которых получены из Системы торгов (сведения о ценах заявок, поданных в Режиме основных торгов).

- Предельное изменение цены в течение установленного для определения цены Аукциона периода времени, в процентах.

- Возможные значения, включая точность расчета цены-ограничителя (ценовое ограничение, означающее что сделка по этой заявке может быть заключена по цене не хуже чем такое ценовое ограничение), а также рассчитанной по итогам Аукциона цены за одну ценную бумагу.

- Предельные значения и порядок расчета объема заявки для отдельного кода расчетов.

2.15.3. Решением Биржи устанавливается перечень ценных бумаг, с которыми допускается совершение сделок в Режиме торгов крупными пакетами ценных бумаг.

2.15.4. Любой Аукцион состоит из периода сбора заявок и периода удовлетворения заявок.

2.15.4.1. Подача, отзыв и удовлетворение заявок на Аукционе в Режиме торгов крупными пакетами ценных бумаг осуществляются в соответствии с Подразделами 2.1. «Заявки», 2.2. «Условия принятия заявки к регистрации» настоящих Правил. По окончании периода сбора заявок Участник торгов не может отозвать поданную заявку на Аукционе.

2.15.4.2. Во время периода сбора заявок в Режиме торгов крупными пакетами ценных бумаг подаются заявки КП. Участник торгов имеет право подавать неограниченное количество заявок КП

2.15.5. После окончания периода сбора заявок в Системе торгов определяется цена заключения сделок (цена Аукциона) по следующему алгоритму:

2.15.5.1. В установленный период времени из Системы торгов (Режима основных торгов, если иное не определено решением Биржи) получают сведения о значениях цен по текущему лучшему спросу и текущему лучшему предложению. Время начала указанного периода времени для отдельной ценной бумаги устанавливается решением Биржи, а временем его окончания является момент окончания периода сбора заявок на Аукцион.

2.15.5.2. На момент начала периода времени, указанного в п. 2.15.5.1. настоящих Правил в Системе торгов устанавливается диапазон допустимых цен Аукциона:

$$P_{\min} = P_{\text{тек.нач.}} - \Delta$$

$$P_{\max} = P_{\text{тек.нач.}} + \Delta, \text{ где}$$

$P_{\min}$ - минимальная граница ценового диапазона;

$P_{\max}$ - максимальная граница ценового диапазона;

$P_{\text{тек.нач.}}$ - текущая цена по ценной бумаге на момент начала периода времени, указанного в п. 2.15.5.1. настоящих Правил;

Δ - предельное изменение цены Аукциона в течение периода времени, указанного в п. 2.15.5.1. настоящих Правил, устанавливаемое решением Биржи.

2.15.5.3. В течение периода времени, указанного в п. 2.15.5.1. настоящих Правил, в каждый момент времени в Системе торгов производится расчет и фиксация средних цен между лучшей текущей ценой покупки и лучшей текущей ценой продажи из полученных данных по лучшему спросу и предложению. В случае отсутствия необходимых данных для расчета средней цены в конкретный момент времени, такая цена не рассчитывается и не фиксируется.

2.15.5.4. По окончании периода сбора заявок на Аукцион, в периоде времени, указанном в п. 2.15.5.1. настоящих Правил, случайным образом выбирается момент времени и определяется, какая средняя цена была рассчитана и зафиксирована в Системе торгов в соответствии с п. 2.15.5.3. настоящих Правил в данный момент времени. Если она была рассчитана и входит в диапазон допустимых цен Аукциона, то данная цена принимается в качестве цены Аукциона. В противном случае повторно, случайным образом выбирается момент времени, в который определяется цена Аукциона по вышеуказанному алгоритму.

2.15.5.5. Если иное не установлено решением Биржи в случае, если по истечении 3 (трех) попыток определения цены Аукциона такая цена не была установлена, то цена Аукциона определяется по следующей формуле:

$$P_{срвзв} = \frac{\sum_{i=1}^n (P_i * T_i)}{\sum_{i=1}^n T_i} \quad \text{где,}$$

n - количество изменений средних цен, рассчитанных Системой торгов;

P_i - средняя цена рассчитанная в i -ый момент времени;

T_i - время в течение которого действовала средняя цена, рассчитанная в i -ый момент времени, в секундах.

2.15.6. После определения цены Аукциона в соответствии с п. 2.15.5. настоящих Правил осуществляется заключение сделок по цене Аукциона в следующем порядке (с учетом особенностей изложенных в п. 2.5.3. настоящих Правил):

- Осуществляется отбор заявок КП, ценовые ограничения по которым не позволяют заключить сделки по рассчитанной цене Аукциона. Сделки по данным заявкам не заключаются;

- Для остальных заявок КП цена за одну ценную бумагу признается равной цене Аукциона, определенной в соответствии с п. 2.15.5. настоящих Правил;

- Осуществляется проверка заявок КП, оставшихся активными к моменту окончания периода сбора заявок на Аукционе, на наличие допустимых встречных заявок. Проверка заявок осуществляется в порядке времени их подачи, начиная с заявки, зарегистрированной ранее остальных.

- Происходит заключение сделок по цене, рассчитанной в соответствии с п. 2.15.5. настоящих Правил, по заявкам КП, признанным допустимыми встречными.

2.15.7. Цена Аукциона по ценной бумаге не определяется, и сделки не заключаются, если в течение периода времени, указанного в п. 2.15.5.1. настоящих Правил:

- невозможно определить среднюю цену между лучшей текущей ценой покупки и лучшей текущей ценой продажи данной ценной бумаги; и/или

- торги данной ценной бумагой не проводились (были приостановлены).

Решением Биржи для отдельной ценной бумаги могут быть определены дополнительные условия, при наступлении которых цена Аукциона не определяется.

2.15.8. Если иное не определено решением Биржи оставшиеся неудовлетворенными заявки (полностью или частично), за исключением заявок с

условиями «Снять остаток» или «Полностью или отклонить», остаются в очереди заявок для участия в следующем Аукционе данного торгового дня. В случае, установленном п. 2.15.7. неудовлетворенные заявки с условиями «Снять остаток» или «Полностью или отклонить» остаются в очереди заявок для участия в следующем Аукционе данного торгового дня. По окончании последнего Аукциона данного торгового дня все оставшиеся неудовлетворенными (полностью или частично) заявки снимаются Биржей.

2.15.9. Участник торгов во время торгов имеет доступ к информации об собственных заявках КП находящихся в Системе торгов, если решением Биржи не определено иное.

Подраздел 2.16. Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Облигации Д – Режим основных торгов» и «Облигации Д – РПС»

2.16.1. При возникновении ситуации дефолта по выпуску облигаций, как он определен в Правилах листинга, Биржа может принять решение об ограничении перечня допустимых 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» и/или
- «Выкуп: Аукцион» и/или
- «Выкуп: Адресные заявки».

Перечень допустимых Режимов торгов для данного выпуска облигаций или всех выпусков облигаций соответствующего эмитента в случаях, предусмотренных Правилами листинга, может быть изменен путем допуска данного выпуска облигаций или всех выпусков облигаций соответствующего эмитента в Режимы торгов, предусмотренные для бумаг, в отношении которых нет ситуации дефолта.

В случае, если ситуация дефолта возникла по выпуску облигаций, предназначенных для квалифицированных инвесторов, торги для данного выпуска облигаций или всех выпусков облигаций соответствующего эмитента могут осуществляться на условиях, определенных в Подразделе 2.17. «Порядок заключения сделок с ценными бумагами, предназначенными для квалифицированных инвесторов» настоящих Правил в соответствующих Режиме торгов.

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

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

2.16.2.2. Реквизиты, которые должны содержаться в лимитных заявках и рыночных заявках, предусмотрены п. 2.1.14.1. и п. 2.1.14.3. настоящих Правил.

2.16.2.3. Заключение сделок осуществляется с учетом особенностей, определенных п. 1.2.11., п.п. 2.1.14.1., п. 2.1.14.3., п. 2.1.15. и п. 2.1.17. настоящих Правил.

2.16.2.4. Участники торгов имеют доступ к информации о собственных заявках, а также о заявках с двадцатью лучшими ценами (десять заявок на покупку и десять заявок на продажу), находящихся в очереди в Системе торгов, в части указанного в них количества ценных бумаг (по айсберг-заявкам только в части «текущего видимого количества ценных бумаг») и цены (если решением Биржи не предусмотрено иное).

2.16.2.5. Заявки, не удовлетворенные в ходе торгов в Режиме торгов «Облигации Д – Режим основных торгов», снимаются с торгов по окончании торгов в данном Режиме торгов.

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

2.16.3.1. 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. 2.1.14.4. настоящих Правил.

2.16.3.2. Решением Биржи могут быть установлены предельные значения объема заявки для адресной заявки РПС.

2.16.3.3. 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 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.

2.16.3.4. Заключение сделки в Режиме торгов «Облигации Д – РПС» осуществляется с учетом особенностей, определенных в п. 2.1.14.4. настоящих Правил.

Решением Биржи может быть предусмотрена возможность заключения сделки в Системе торгов при совпадении в двух встречных адресных заявках РПС всех условий, перечисленных в п. 2.1.14.4. настоящих Правил, за исключением количества ценных бумаг, выраженного в лотах.

2.16.3.5. Участник торгов во время торгов в Режиме торгов «Облигации Д – РПС» имеет доступ к информации об адресных заявках РПС, направленных данному Участнику торгов, собственных адресных заявках РПС.

Подраздел 2.17. Порядок заключения сделок с ценными бумагами, предназначенными для квалифицированных инвесторов

2.17.1. Биржа принимает решение об ограничении перечня допустимых Режимов торгов для ценной бумаги, предназначенной для квалифицированных инвесторов, следующими Режимами торгов:

- | | |
|--|-------|
| • Режимом торгов «Квал.Инвесторы – Режим основных торгов» | и/или |
| • Режимом торгов «Квал.Инвесторы - Режим основных торгов Т+» | и/или |
| • Режимом торгов «Квал.Инвесторы – РПС» | и/или |
| • Режимом торгов «Квал.Инвесторы – РПС с ЦК» | и/или |
| • Режимом торгов «Квал.Инвесторы – РЕПО» | и/или |
| • Режимом торгов «Квал.Инвесторы – РЕПО с ЦК» | и/или |
| • «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)». | |

В случае допуска ценной бумаги к торгам в процессе размещения она может быть допущена в Режимы торгов, предусмотренные для проведения таких торгов в соответствии с Подразделом 2.11. «Торги по акциям и облигациям, допущенным к размещению» и Подразделом 2.12. «Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» и «Размещение: Адресные заявки»» настоящих Правил с учетом особенностей заключения сделок с ценными бумагами, предназначенными для квалифицированных инвесторов.

В случае проведения торгов по приобретению акций/выкупу облигаций, предназначенных для квалифицированных инвесторов, такие ценные бумаги также могут быть допущены к торгам в соответствующих Режиме торгов на условиях, установленных в Подразделе 2.13. «Проведение торгов по приобретению акций и выкупу облигаций» настоящих Правил.

2.17.2. Заключение сделок в Режиме торгов «Квал.Инвесторы – Режим основных торгов» и «Квал.Инвесторы – Режим основных торгов Т+» осуществляется в следующем порядке:

2.17.2.1. Для участия в торгах в Режиме торгов «Квал.Инвесторы – Режим основных торгов» и «Квал.Инвесторы – Режим основных торгов Т+» принимаются

лимитные заявки и рыночные заявки, поданные Участниками торгов в Систему торгов.

2.17.2.2. Реквизиты, которые должны содержаться в лимитных заявках и рыночных заявках, предусмотрены в п. 2.1.14.1. и п. 2.1.14.3. настоящих Правил.

2.17.2.3. Заключение сделок осуществляется с учетом особенностей, определенных в п. 1.2.11., п. 2.1.14.1. и п. 2.1.14.3., п. 2.1.15. и п. 2.1.17. настоящих Правил.

2.17.2.4. Участники торгов имеют доступ к информации о собственных заявках, а также о заявках с двадцатью лучшими ценами (десять заявок на покупку и десять заявок на продажу), находящихся в очереди в Системе торгов, в части указанного в них количества ценных бумаг (по айсберг-заявкам только в части «текущего видимого количества ценных бумаг») и цены (если решением Биржи не предусмотрено иное).

2.17.2.5. Заявки, не удовлетворенные в ходе торгов в Режиме торгов «Квал.Инвесторы – Режим основных торгов» и «Квал.Инвесторы – Режим основных торгов Т+», снимаются с торгов по окончании торгов в данном Режиме торгов.

2.17.3. Заключение сделок в Режиме торгов «Квал.Инвесторы – РПС» и «Квал.Инвесторы – РПС с ЦК» осуществляется в следующем порядке:

2.17.3.1. При проведении торгов в Режиме торгов «Квал.Инвесторы – РПС» и «Квал.Инвесторы – РПС с ЦК» сделки заключаются на основании адресных заявок РПС, поданных Участниками торгов в ходе торгов текущего торгового дня в данных Режиме торгов. В адресных заявках РПС должны быть указаны реквизиты, предусмотренные в п. 2.1.14.4. настоящих Правил.

2.17.3.2. Решением Биржи могут быть установлены предельные значения объема заявки для адресной заявки РПС.

2.17.3.3. При получении встречной адресной заявки РПС к своей адресной заявке РПС Участник торгов вправе до окончания торгов в Режиме торгов «Квал.Инвесторы – РПС» или в Режиме торгов «Квал.Инвесторы – РПС с ЦК» (если решением 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.

2.17.3.4. Заключение сделки в Режиме торгов «Квал.Инвесторы – РПС» и «Квал.Инвесторы – РПС с ЦК» осуществляется при соблюдении условий, определенных в п. 1.2.11, п. 2.1.14.4. настоящих Правил.

Решением Биржи может быть предусмотрена возможность заключения сделки в Системе торгов при совпадении в двух встречных адресных заявках РПС всех условий, перечисленных в п. 2.1.14.4. настоящих Правил, за исключением количества ценных бумаг, выраженного в лотах.

2.17.3.5. Участник торгов во время торгов в Режиме торгов «Квал.Инвесторы – РПС» и «Квал.Инвесторы – РПС с ЦК» имеет доступ к информации об адресных заявках РПС, направленных данному Участнику торгов, собственных адресных заявках РПС.

2.17.4. Заключение сделок в Режиме торгов «Квал.Инвесторы – РЕПО» и «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)» осуществляется в следующем порядке:

2.17.4.1. При проведении торгов по облигациям в Режиме торгов «Квал.Инвесторы – РЕПО» и «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)» заключение сделок осуществляется на основании адресных заявок РЕПО (облигации), поданных Участниками торгов в ходе торгов текущего торгового дня в соответствующем Режиме торгов. В адресных заявках РЕПО (облигации) должны быть указаны реквизиты, предусмотренные п. 2.1.14.5. настоящих Правил.

2.17.4.2. При проведении торгов по акциям в Режимх торгов «Квал.Инвесторы – РЕПО» и «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)» заключение сделок осуществляется на основании адресных заявок РЕПО (акции), поданных Участниками торгов в ходе торгов текущего торгового дня в соответствующем Режиме торгов. В адресных заявках РЕПО (акции) должны быть указаны реквизиты, предусмотренные п. 2.1.14.5. настоящих Правил.

2.17.4.3. Заключение сделок в Режимх торгов «Квал.Инвесторы – РЕПО» и «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)» осуществляется при совпадении в двух встречных адресных заявках на заключение сделок РЕПО всех условий, перечисленных в п. 2.1.14.5. настоящих Правил.

2.17.4.4. Участники торгов в Режимх торгов «Квал.Инвесторы – РЕПО» и «Квал.Инвесторы - РЕПО (в ин. валюте)» имеют доступ к информации об адресных заявках на заключение сделок РЕПО, адресованных данному Участнику торгов, и собственных адресных заявках на заключение сделок РЕПО, находящихся в Системе торгов.

2.17.4.5. Заключение сделок в Режиме торгов «Квал.Инвесторы – РЕПО с ЦК» осуществляется в порядке, определенном п. 2.20.2., п. 2.20.3., п. 2.20.4., п. 2.20.6. настоящих Правил.

Подраздел 2.18. Порядок заключения сделок в Режиме торгов «РИИ2 – РПС»

2.18.1. Биржа может принять решение об ограничении перечня допустимых Режимов торгов для ценной бумаги следующим Режимом торгов:

- Режим торгов «РИИ2– РПС».

2.18.2. Заключение сделок в Режиме торгов «РИИ2– РПС» осуществляется в следующем порядке:

2.18.2.1. При проведении торгов в Режиме торгов «РИИ2 – 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. 2.1.14.4. настоящих Правил.

Решением Биржи могут быть установлены предельные значения объема заявки для адресной заявки РПС.

2.18.2.2. При получении встречной адресной заявки РПС к своей адресной заявке РПС Участник торгов вправе до окончания торгов в Режиме торгов «РИИ2 – РПС» (если решением 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.

2.18.2.3. Заключение сделки в Режиме торгов «РИИ2 – РПС» осуществляется при соблюдении условий, определенных п. 1.2.11., п. 2.1.14.4. настоящих Правил.

2.18.2.4. Решением 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.

2.18.2.5. Участник торгов во время торгов в Режиме торгов «РИИ2 – РПС» имеет доступ к информации об адресных заявках РПС, направленных данному Участнику торгов, собственных адресных заявках РПС.

Подраздел 2.19. Порядок заключения сделок в Режимх торгов «Акции Д - Режим

основных торгов» и «Акции Д – РПС»

2.19.1 В случае включения акций в Сектор компаний с повышенным инвестиционным риском Перечня внесписочных ценных бумаг, как это определено в Правилах листинга, Биржа может принять решение об ограничении перечня допустимых Режимов торгов для акций данного эмитента только следующими Режимами торгов:

- Режим торгов «Акции Д – Режим основных торгов» и/или
- Режим торгов «Акции Д – РПС» и/или
- Режим торгов «Неполные лоты» и/или
- «Выкуп: Аукцион» и/или
- «Выкуп: Адресные заявки».

2.19.2 Заключение сделок (в т.ч. Сделок Т+) в Режиме торгов «Акции Д – Режим основных торгов» осуществляется в следующем порядке:

2.19.2.1 Для участия в торгах в Режиме торгов «Акции Д – Режим основных торгов» принимаются лимитные заявки и рыночные заявки, поданные Участниками торгов в Систему торгов.

2.19.2.2 Реквизиты, которые должны содержаться в лимитных заявках и рыночных заявках, предусмотрены п. 2.1.14.1. и п. 2.1.14.3. настоящих Правил.

2.19.2.3 Заключение сделок осуществляется с учетом особенностей, определенных п. 1.2.11., п. 2.1.14.1., п. 2.1.14.3., п. 2.1.15. и п. 2.1.17. настоящих Правил.

2.19.2.4 Участники торгов имеют доступ к информации о собственных заявках, а также о заявках с двадцатью лучшими ценами (десять заявок на покупку и десять заявок на продажу), находящихся в очереди в Системе торгов, в части указанного в них количества ценных бумаг (по айсберг-заявкам только в части «текущего видимого количества ценных бумаг») и цены (если решением Биржи не определено иное).

2.19.2.5 Заявки, не удовлетворенные в ходе торгов в Режиме торгов «Акции Д – Режим основных торгов», снимаются с торгов по окончании торгов в данном Режиме торгов.

2.19.3 Заключение сделок (в т.ч. Сделок Т+) в Режиме торгов «Акции Д – РПС» осуществляется в следующем порядке:

2.19.3.1 При проведении торгов в Режиме торгов «Акции 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. 2.1.14.4. настоящих Правил.

2.19.3.2 Решением Биржи могут быть установлены предельные значения объема заявки для адресной заявки РПС.

2.19.3.3 При получении встречной адресной заявки РПС к своей адресной заявке РПС Участник торгов вправе до окончания торгов в Режиме торгов «Акции Д – РПС» (если решением 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.

2.19.3.4 Заключение сделки в Режиме торгов «Акции Д – РПС»

осуществляется с учетом особенностей, определенных в п. 2.1.14.4. настоящих Правил.

Решением Биржи может быть предусмотрена возможность заключения сделки в Системе торгов при совпадении в двух встречных адресных заявках РПС всех условий, перечисленных в п. 2.1.14.4. настоящих Правил, за исключением количества ценных бумаг, выраженного в лотах.

2.19.3.5 Участник торгов во время торгов в Режиме торгов «Акции Д – РПС» имеет доступ к информации об адресных заявках РПС, направленных данному Участнику торгов, собственных адресных заявках РПС.

Подраздел 2.20. Заключение сделок РЕПО с Центральным контрагентом

2.20.1. Особенности подачи заявок и заключения Сделок Т+ в Режиме торгов «Исполнение обязательств по Сделкам Т+: РЕПО» изложены в подразделе 2.24. Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Исполнение обязательств по Сделкам Т+: РЕПО».

2.20.2. В Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки» в Систему торгов подаются лимитные заявки РЕПО (ЦК) и рыночные заявки РЕПО (ЦК). В Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Адресные заявки» и «Квал.Инвесторы – РЕПО с ЦК» в Систему торгов подаются адресные заявки РЕПО (ЦК).

2.20.3. В Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки», «РЕПО с ЦК – Адресные заявки» и «Квал.Инвесторы - РЕПО с ЦК» принимают участие заявки, поданные Участниками торгов в ходе торгового периода текущего торгового дня в данном Режиме торгов (если решением Биржи не установлено иное). Участник торгов имеет право подавать в Систему торгов неограниченное количество таких заявок.

2.20.4. В ходе торгов в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки», «РЕПО с ЦК – Адресные заявки» и «Квал.Инвесторы - РЕПО с ЦК» действуют следующие условия:

2.20.4.1. Реквизиты заявок: Сумма РЕПО, количество ценных бумаг в лотах, дисконт – являются взаимосвязанными, и указание Участником торгов в заявке на заключение сделки РЕПО любых двух из них является достаточным для расчета в Системе торгов третьего реквизита по следующим формулам.

$$Q = \frac{S}{\text{округл}\left(1 - \frac{D}{100}\right) * P; k} * N, \quad (1)$$

$$S = Q * \text{округл}\left(1 - \frac{D}{100}\right) * P; k * N, \quad (2)$$

$$D = \left(1 - \frac{S}{Q * N * P}\right) * 100 \quad (3)$$

Q - Количество ценных бумаг, в лотах;

S - Сумма РЕПО, с точностью до копеек;

N - Количество ценных бумаг в одном лоте, шт.;

P - Расчетная цена по одной ценной бумаге, установленная на день заключения сделки, методика определения которой устанавливается Клиринговой организацией (в валюте сделки);

D - значение дисконта (в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки» устанавливается Биржей, в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Адресные

заявки» указывается Участником торгов, либо используется значение дисконта, установленное Биржей);

k – устанавливается решением Биржи для каждого выпуска ценных бумаг.

2.20.4.2. При указании Участником торгов в заявке на заключение сделки РЕПО в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки»:

- Суммы РЕПО: в Системе торгов рассчитывается количество ценных бумаг в лотах, с округлением в сторону уменьшения до целого числа по формуле (1) п. 2.20.4.1. Исходя из рассчитанного количества ценных бумаг в лотах, рассчитывается скорректированная Сумма РЕПО.
- Количества ценных бумаг в лотах: в Системе торгов рассчитывается Сумма РЕПО по формуле (2) п. 2.20.4.1.

2.20.4.3. При указании Участником торгов в заявке на заключение сделки РЕПО в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Адресные заявки»:

- Количества ценных бумаг в лотах и дисконта: в Системе торгов рассчитывается сумма РЕПО по формуле (2) п. 2.20.4.1. Из рассчитанной суммы РЕПО и количества бумаг пересчитывается скорректированный дисконт по формуле (3) п. 2.20.4.1.;
- Суммы РЕПО и дисконта: в Системе торгов рассчитывается количество бумаг в лотах с округлением в сторону уменьшения до целого числа по формуле (1) п. 2.20.4.1. Исходя из рассчитанного количества лотов и дисконта, рассчитывается новая (скорректированная) сумма РЕПО по формуле (2) п. 2.20.4.1. Из рассчитанной суммы РЕПО и количества бумаг пересчитывается скорректированный дисконт по формуле (3) п. 2.20.4.1.;
- Суммы РЕПО и количества ценных бумаг в лотах: в Системе торгов рассчитывается дисконт по формуле (3) п. 2.20.4.1. Исходя из рассчитанного значения дисконта и количества ценных бумаг в лотах, в системе торгов рассчитывается новая (скорректированная) сумма РЕПО по формуле (2) п. 2.20.4.1. Из рассчитанной суммы РЕПО и количества бумаг пересчитывается скорректированный дисконт по формуле (3) п. 2.20.4.1.;
- Суммы РЕПО, количества ценных бумаг в лотах и дисконта: введенный дисконт игнорируется, в Системе торгов рассчитывается дисконт по формуле (3) п. 2.20.4.1. Исходя из рассчитанного значения дисконта и количества ценных бумаг в лотах, в системе торгов рассчитывается новая (скорректированная) сумма РЕПО по формуле (2) п. 2.20.4.1. Из рассчитанной суммы РЕПО и количества бумаг пересчитывается скорректированный дисконт по формуле (3) п. 2.20.4.1.

2.20.4.4. При регистрации заявки рассчитывается Стоимость обратного выкупа, исходя из Ставки РЕПО, Суммы РЕПО и кода расчетов, по следующей формуле:

$$S_2 = S_1 * \left(1 + \frac{R}{100} * \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right) \right), \text{ где}$$

S_2 - Стоимость обратного выкупа;

S_1 - Сумма РЕПО;

R - Ставка РЕПО;

T_{365} - число дней между исполнением 1 и 2 частей РЕПО, приходящихся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T_{366} - число дней между исполнением 1 и 2 частей РЕПО, приходящихся на календарный год, состоящий из 366 дней.

2.20.4.5. Если решением Биржи не установлено иное, каждый расчетный день, начиная с фактической даты исполнения первой части сделки РЕПО,

заключенной в соответствующем Режиме торгов, до даты, следующей за фактической датой исполнения второй части этой сделки РЕПО, или за Датой прекращения исполнения этой сделки РЕПО, в Системе торгов рассчитывается:

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

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

S - Сумма РЕПО;

S_i - Сумма РЕПО в i-ый день;

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

R - Ставка РЕПО;

S_{II}^j - стоимость обратного выкупа в j-ый день:

$$S_{II}^j = S_j + I_j,$$

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;

i-ый день – Дата исполнения первой части сделки РЕПО либо дата последнего изменения перед текущим расчетным (j-ым) днем Суммы РЕПО;

2.20.4.6. Размер НКД по сделке РЕПО на текущий j-ый день (раскрывается в Системе торгов информационно):

$$A_{II}^j = N_j * At_j * e_j, \text{ где}$$

At_j - НКД по одной ценной бумаге текущего (j-го) дня (при условии его расчета для данной ценной бумаги);

N_j - Количество ценных бумаг в одном лоте, шт.

2.20.4.7. Заявка Участника торгов не регистрируется в Системе торгов при указании в ней кода расчетов, в соответствии с которым дата исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО приходится на любой день после последнего дня текущего купонного периода ценной бумаги.

2.20.4.8. Заявка Участника торгов не регистрируется в Системе торгов при указании в ней кода расчетов, в соответствии с которым дата исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО приходится на любой день после истечения срока обращения соответствующей ценной бумаги на Бирже.

2.20.4.9. Если иное не установлено Биржей, заявка Участника торгов не регистрируется в Системе торгов при указании в ней кода расчетов, в соответствии с которым дата исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО приходится на любой день после последнего дня текущего купонного периода ценной бумаги, в который осуществляются торги такой ценной бумагой.

2.20.4.10. В случае выплаты Дохода по неисполненным на дату составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода, сделкам РЕПО, заключенным с Центральным контрагентом, передача Дохода осуществляется в соответствии с порядком, определенным в Правилах клиринга. Для сделок РЕПО под неисполненными сделками понимаются неисполненные вторые части сделок РЕПО.

2.20.5. Торги в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки» проводятся с учетом следующих особенностей:

2.20.5.1. Заключение сделок по лимитным заявкам РЕПО (ЦК) и рыночным заявкам РЕПО (ЦК) осуществляется с учетом особенностей, определенных п.

1.2.11., п. 2.1.14.9, п. 2.1.15. настоящих Правил.

2.20.5.2. Заключение сделки по лимитной заявке РЕПО (ЦК) или рыночной заявке РЕПО (ЦК) осуществляется при пересечении значения Ставки РЕПО, указанной в такой заявке, со значением(ями) Ставки РЕПО, указанным(и) в допустимой(ых) встречной(ых) заявке(ах) противоположной направленности, зарегистрированной(ых) в Системе торгов.

2.20.5.3. Пересечение значений Ставок РЕПО имеет место:

- для поданной заявки на привлечение денежных средств – при наличии заявок на размещение денежных средств со Ставками РЕПО, не превышающими Ставку РЕПО, которая указана в поданной заявке;
- для поданной заявки на размещение денежных средств – при наличии заявок на привлечение денежных средств со Ставками РЕПО, не меньшими, чем Ставка РЕПО, которая указана в поданной заявке.

2.20.5.4. После заключения сделки по лимитной заявке РЕПО (ЦК), поданной посредством подачи совокупной заявки РЕПО (ЦК), Сумма РЕПО и количество ценных бумаг в лимитных заявках РЕПО (ЦК), поданных посредством данной совокупной заявки РЕПО (ЦК), по каждой ценной бумаге пересчитывается по следующим формулам:

$$Q = \text{Min}\{(Q_{inish} - \sum Q_{deal_i}; \text{Int}[(S_{order} - \sum S_{deal}) / (P_{lowi} * N_i)]\},$$

$$S_i = \text{Min}\{(S_{inish} - \sum S_{deal_i}; \text{Int}[(S_{order} - \sum S_{deal}) / (P_{lowi} * N_i)] * (P_{lowi} * N_i)\}$$

Где

Q_i - пересчитанное количество ценных бумаг лимитной заявки РЕПО (ЦК) по данному инструменту (ценной бумаге) i ;

S_i - пересчитанная сумма РЕПО лимитной заявки РЕПО (ЦК) по данной ценной бумаге i ;

S_{order} - Сумма РЕПО в реквизитах совокупной заявки РЕПО (ЦК);

S_{deal} - Сумма РЕПО в сделке, заключенной по лимитной заявке РЕПО (ЦК), поданной по данной совокупной заявке;

S_{deal_i} - Сумма РЕПО в сделке, заключенной по лимитной заявке РЕПО (ЦК), по данной ценной бумаге i

Q_{deal_i} - количество бумаг в сделке, заключенной по лимитной заявке РЕПО (ЦК), по данной ценной бумаге i

S_{inish} - Сумма РЕПО первоначально заданная в лимитной заявке РЕПО (ЦК) по данной ценной бумаге i

Q_{inish} - Количество бумаг первоначально заданное в лимитной заявке РЕПО (ЦК) по данной ценной бумаге i

N_i - Количество ценных бумаг в одном лоте по данной ценной бумаге i в режиме торгов «РЕПО с ЦК- Безадресные заявки»

P_{lowi} - Расчетная цена с учетом дисконта в рублях за одну ценную бумагу в Режиме торгов «РЕПО с ЦК- Безадресные заявки»

2.20.5.5. Во время торгов в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки» Участник торгов имеет доступ к информации о собственных заявках, а также о заявках с двадцатью лучшими Ставками РЕПО, находящихся в очереди в Системе торгов, и совокупной Сумме РЕПО по заявкам на размещение и заявкам на привлечение

денежных средств в разрезе Ставок РЕПО.

2.20.5.6. Заявки, не удовлетворенные в ходе торгового периода снимаются с торгов Биржей.

2.20.6. Заключение сделок РЕПО в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Адресные заявки» и «Квал.Инвесторы - РЕПО с ЦК» осуществляется в следующем порядке:

2.20.6.1. Заключение сделок по адресным заявкам РЕПО (ЦК) осуществляется с учетом особенностей, определенных п. 1.2.11., 2.1.14.10.

2.20.6.2. При получении встречной адресной заявки РЕПО (ЦК) в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Адресные заявки» и «Квал.Инвесторы - РЕПО с ЦК» Участник торгов вправе до окончания торгов в данном Режиме торгов (если решением Биржи не установлено иное) либо заключить сделку РЕПО на условиях, указанных в полученной заявке, либо направить контрагенту адресную заявку РЕПО (ЦК) с новыми условиями, либо отклонить полученную заявку.

2.20.6.3. Заявка с указанием наименования (кода) Списка ценных бумаг снимается с торгов Биржей после заключения первой сделки по такой заявке.

2.20.6.4. Участник торгов во время торгов в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Адресные заявки» и «Квал.Инвесторы - РЕПО с ЦК» имеет доступ к информации об адресных заявках РЕПО (ЦК), направленных данному Участнику торгов и собственных адресных заявках РЕПО (ЦК).

Подраздел 2.21. Порядок проведения торгов в Режиме торгов «РПС с ЦК»

2.21.1. В режиме торгов «РПС с ЦК» заключаются Сделки Т+. Заключение сделок в Режиме торгов «РПС с ЦК» осуществляется в следующем порядке:

2.21.1.1. При проведении торгов в Режиме торгов «РПС с ЦК» 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. 2.1.14.4. настоящих Правил.

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

2.21.1.2. При получении встречной адресной заявки РПС к своей адресной заявке РПС Участник торгов вправе до окончания торгов в Режиме торгов «РПС с ЦК» (если решением Биржи не установлено иное) либо заключить сделку с Центральным Контрагентом 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.

2.21.1.3. После регистрации в Системе торгов каждая заявка в Режиме торгов «РПС с ЦК» проверяется в Системе торгов на наличие допустимой встречной заявки.

2.21.1.4. Заключение сделок осуществляется с учетом особенностей, определенных п. 2.1.14.4. настоящих Правил. Решением Биржи может быть предусмотрена возможность заключения сделки в Системе торгов при наличии допустимой встречной заявки при совпадении в двух встречных адресных заявках РПС всех условий, перечисленных в п. 2.1.14.4. настоящих Правил, за исключением количества ценных бумаг, выраженного в лотах.

2.21.2. В Режиме торгов «РПС с ЦК» принимают участие адресные

заявки РПС, поданные Участниками торгов в ходе торгов текущего торгового дня в Режиме торгов «РПС с ЦК» (если решением Биржи не определено иное).

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

2.21.4. Заявки, не удовлетворенные в ходе торгов в Режиме торгов «РПС с ЦК», снимаются с торгов по окончании торгов в данном Режиме торгов.

Подраздел 2.22. Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Режим основных торгов Т+»

2.22.1. В Режиме торгов «Режим основных торгов Т+» заключаются Сделки Т+.

2.22.2. В ходе Основной торговой сессии торги в Режиме торгов «Режим основных торгов Т+» состоят из следующих периодов:

- предторгового периода;
- торгового периода;
- аукциона закрытия.

По решению Биржи в целях обеспечения стабилизации рынка отдельных ценных бумаг для отдельной ценной бумаги или категории (типа) ценных бумаг может быть установлено, что:

- вместо любого из вышеуказанных периодов, торги проводятся в форме дискретного аукциона (в порядке и с учетом условий, предусмотренных в п. 2.22.7. настоящих Правил);

- вместо аукциона закрытия или после окончания аукциона закрытия торги проводятся в форме послеторгового периода (в порядке и с учетом условий, предусмотренных в п. 2.22.5. настоящих Правил);

В соответствии с требованиями законов и иных нормативных правовых актов Российской Федерации вместо приостановки торгов акциями, осуществляемых на основании безадресных заявок, Биржей может быть определена возможность проведения по таким акциям торгов в форме дискретного аукциона. Основанием для принятия Биржей решения о возобновлении торгов в иных Режимах торгов и/или Секторах рынка является завершение дискретного аукциона, в результате которого были совершены сделки (определена цена дискретного аукциона). Биржей могут быть определены дополнительные основания для принятия решения о возобновлении торгов в иных Режимах торгов и/или Секторах рынка.

В ходе Дополнительной торговой сессии торги, проводимые в Режиме торгов «Режим основных торгов Т+», состоят из торгового периода (если решением Биржи не установлено иное).

2.22.3. Заключение сделок в предторговом периоде осуществляется перед каждым торговым периодом (если решением Биржи не определено иное). Заключение сделок в предторговом периоде осуществляется в следующем порядке:

2.22.3.1. В предторговом периоде в Систему торгов подаются лимитные заявки, лимитные заявки (АЗ), рыночные заявки (АЗ), если иное не определено решением Биржи.

2.22.3.2. На основании поданных в предторговый период лимитных 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.

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

- на основании поданных в предторговый период лимитных 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.

2.22.3.4. 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.

2.22.3.5. Заключение сделки(ок) по лимитной заявке, поданной в предторговый период, осуществляется с учетом особенностей, определенных п. 1.2.11., п. 2.1.14.1., п. 2.1.15. и п. 2.1.17. настоящих Правил при пересечении ее ценовых условий с ценой предторгового периода.

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 ближайшем торговом периоде, если иное не определено решением Биржи.

2.22.3.6. 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.

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

2.22.4. Торговый период проводится после окончания предторгового периода, если иное не определено в соответствии с п. 2.22.2. и п. 2.22.7. настоящих Правил. В торговом периоде в Систему торгов подаются лимитные заявки, рыночные заявки, лимитные заявки (АЗ), рыночные заявки (АЗ), если иное не определено решением Биржи. Заключение сделок в торговом периоде данного торгового дня осуществляется по лимитным заявкам и рыночным заявкам, поданным Участниками торгов в данном торговом периоде, а также лимитным заявкам с сохранением в котировках, находящимся в Системе торгов после окончания предторгового периода или после окончания дискретного аукциона. Заключение сделок в торговом периоде осуществляется в следующем порядке:

2.22.4.1. Заключение сделки(ок) по лимитной заявке и рыночной заявке осуществляется с учетом особенностей, определенных п. 1.2.11., п. 2.1.14.1., 2.1.14.3., п. 2.1.15. и п. 2.1.17. настоящих Правил.

2.22.4.2. Участники торгов в ходе торгового периода имеют доступ к информации о собственных заявках, а также о заявках с двадцатью лучшими ценами (десять заявок на покупку и десять заявок на продажу), находящихся в очереди в Системе торгов, в части указанного в них количества ценных бумаг (по айсберг-заявкам только в части «текущего видимого количества ценных бумаг») и цены (если решением Биржи не предусмотрено иное).

2.22.4.3. Заявки, не удовлетворенные в ходе торгового периода,

принимают участие в ближайшем периоде Режим торгов «Режим основных торгов T+» или в дискретном аукционе (если решением Биржи не определено иное).

2.22.5. После торгового периода или аукциона закрытия проводится подача заявок и заключение сделок в послеторговом периоде (если решением 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 осуществляется с учетом особенностей, определенных п. 1.2.11., п. 2.1.14.2., п. 2.1.15. и п. 2.1.17. настоящих Правил, в следующем порядке:

2.22.5.1. Цена послеторгового периода рассчитывается в Системе торгов как результат от деления суммарного объема сделок с данной ценной бумагой, заключенных в течение установленного Биржей периода времени в ходе Режим торгов «Режим основных торгов T+», на суммарное количество ценных бумаг в этих сделках. При отсутствии, в течение вышеуказанного периода времени, 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 в российских рублях и в иностранной валюте, цена послеторгового периода определяется в соответствии с настоящим пунктом Правил только по сделкам в российских рублях, если иной порядок ее расчета не установлен Биржей.

2.22.5.2. В послеторговом периоде в Систему торгов подаются только заявки послеторгового периода (если решением Биржи не определено иное). Цена послеторгового периода, рассчитываемая в порядке, предусмотренном в п. 2.22.5.1. настоящего пункта Правил, автоматически указывается при регистрации заявки послеторгового периода в Системе торгов.

2.22.5.3. В момент окончания послеторгового периода регистрируются сделки по цене послеторгового периода при наличии допустимой(ых) встречной(ых) заявки(ок) противоположной направленности, поданной(ых) в послеторговый период.

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

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

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

2.22.5.7. 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 Биржи не определено иное).

2.22.6. Проведение аукциона закрытия осуществляется в следующем порядке:

2.22.6.1. После торгового периода проводится подача заявок и заключение сделок в аукционе закрытия (если решением Биржи не определено иное).

2.22.6.2. Если решением Биржи не определено иное, в ходе проведения аукциона закрытия в Систему торгов подаются лимитные заявки, рыночные заявки, лимитные заявки (А3), рыночные заявки (А3), заявки по цене аукциона закрытия. В лимитных заявках и лимитных заявках (А3), подаваемых в фазах сбора заявок, допускается указание только дополнительных признаков «По разным ценам» и «Поставить в очередь». Если решением Биржи не определено иное, рыночные заявки и рыночные заявки (А3) подаются только с указанием количества ценных бумаг.

2.22.6.3. Аукцион закрытия состоит из следующих последовательных фаз:

- фаза сбора заявок;

- дополнительная фаза сбора заявок;
- фаза торгов по цене аукциона закрытия.

Продолжительность фаз аукциона закрытия устанавливается решением Биржи. При этом дополнительная фаза сбора заявок проводится после завершения фазы сбора заявок в случае, если в фазе сбора заявок не определена цена аукциона закрытия.

2.22.6.4. На основании поданных заявок по каждой ценной бумаге на случайно определенный момент фазы сбора заявок и/или дополнительной фазы сбора заявок в Системе торгов определяется цена аукциона закрытия, обеспечивающая заключение сделок с наибольшим количеством ценных бумаг, являющихся предметом этих сделок. Период фазы сбора заявок и/или дополнительной фазы сбора заявок, в который может быть случайно выбран момент определения цены аукциона закрытия, устанавливается Биржей.

2.22.6.5. Цена аукциона закрытия определяется в следующем порядке:

- на основе поданных лимитных заявок и лимитных заявок (АЗ) (далее, для целей настоящего пункта – лимитные заявки) нарастающим итогом в направлении убывания цены для каждого значения цены в лимитных заявках рассчитывается агрегированный спрос по лимитным заявкам (количество лотов, выставленное на покупку), и в порядке возрастания цены нарастающим итогом для каждого значения цены рассчитывается агрегированное предложение по лимитным заявкам (количество лотов, выставленное на продажу);

- рассчитываются общие агрегированные значения спроса и предложения для каждой цены, указанной в лимитных заявках, как результат от сложения соответствующих значений агрегированного спроса по лимитным заявкам и агрегированного предложения по лимитным заявкам со значениями количества лотов в рыночных заявках и рыночных заявках (АЗ) (далее, для целей настоящего пункта – рыночные заявки) на покупку и рыночных заявках на продажу. Все рыночные заявки учитываются при расчете спроса и предложения по каждой цене, указанной в лимитных заявках. Количество лотов в рыночной заявке с указанием количества денежных средств, предназначенных для покупки ценных бумаг, определяется, как целая часть от частного целой части от деления суммы денежных средств в данной заявке на сумму платежа по приобретению ценной бумаги (которая включает в себя цену, для которой рассчитывается количество лотов, и совокупный размер комиссионного вознаграждения Биржи, Клиринговой организации и Технического центра) и количества ценных бумаг в одном лоте.

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

- определяется значение цены, которая обеспечивает заключение сделок с максимально возможным количеством лотов;

- в случае если указанным условиям удовлетворяют несколько значений цены, то выбирается та цена, при которой значение дисбаланса (разности между общим агрегированным спросом и общим агрегированным предложением) было бы минимальным (по модулю);

- в случае если указанным условиям удовлетворяют несколько значений цены, то в случае избыточного предложения (больше количество лотов в заявках на продажу), выбирается наименьшая из цен либо, в случае избыточного спроса (больше количество лотов в заявках на покупку) выбирается наибольшая из цен;

- в случае если указанным условиям удовлетворяют несколько значений цены, то цена выбирается, как ближайшая к цене последней сделки в торговом периоде;

- если цены имеют одинаковое отклонение от цены последней сделки, то в качестве цены аукциона закрытия выбирается большая из этих цен.

2.22.6.6. Если наибольшая цена покупки среди всех поданных заявок не

пересекается с наименьшей ценой продажи, или заявки на покупку или продажу отсутствуют в Системе торгов, либо рассчитанная цена выходит за предельные значения цены аукциона закрытия, установленные Биржей, либо по рассчитанной цене не полностью удовлетворяются рыночные заявки и рыночные заявки (АЗ), цена аукциона закрытия в фазе сбора заявок не определяется. Если на момент определения цены аукциона закрытия в дополнительной фазе сбора заявок наибольшая цена покупки среди всех поданных заявок не пересекается с наименьшей ценой продажи, или заявки на покупку или продажу отсутствуют в Системе торгов, либо рассчитанная цена выходит за предельные значения цены аукциона закрытия, установленные Биржей, ценой аукциона закрытия считается последняя рассчитанная текущая цена (если иное не определено решением Биржи). В случае отсутствия в данном режиме торгов хотя бы одной сделки с ценной бумагой цена аукциона закрытия не определяется, если решением Биржи не определено иное.

2.22.6.7. После определения цены аукциона закрытия проводится фаза торгов по цене аукциона закрытия. Если цена аукциона закрытия не определяется, фаза торгов по цене аукциона закрытия не проводится. Проведение фазы торгов по цене аукциона закрытия осуществляется в следующем порядке:

2.22.6.7.1. Заключение сделок в фазе торгов по цене аукциона закрытия происходит по цене аукциона закрытия.

2.22.6.7.2. Если решением Биржи не определено иное, в ходе проведения фазы торгов по цене аукциона закрытия в Систему торгов подаются заявки по цене аукциона закрытия. Также, если иное не определено решением Биржи, в фазе торгов по цене аукциона закрытия принимают участие лимитные заявки, рыночные заявки, лимитные заявки (АЗ), рыночные заявки (АЗ) не исполненные или частично исполненные в фазе сбора заявок и/или дополнительной фазе сбора заявок.

2.22.6.8. Заключение сделки(ок) по заявке в ходе проведения аукциона закрытия осуществляется с учетом особенностей, определенных п. 1.2.11., п. 2.1.14.1., 2.1.14.3., п. 2.1.14.11., п. 2.1.14.12., п. 2.1.14.14., п. 2.1.15. и п. 2.1.17. настоящих Правил при пересечении ценовых условий такой заявки с ценой аукциона закрытия. Заключение сделок в фазе сбора заявок или в дополнительной фазе сбора заявок происходит в момент определения цены аукциона закрытия.

2.22.6.9. При неравенстве спроса и предложения в ходе фазы сбора заявок и/или дополнительной фазы сбора заявок по цене аукциона закрытия в первую очередь удовлетворяются рыночные заявки (АЗ), затем рыночные заявки, затем лимитные заявки (АЗ) и лимитные заявки на покупку с большей ценой, а на продажу – с меньшей ценой. При равенстве цен в первую очередь удовлетворяются лимитные заявки (АЗ), поданные ранее по времени, затем лимитные заявки, поданные ранее по времени. При неравенстве спроса и предложения в ходе фазы торгов по цене аукциона закрытия в первую очередь удовлетворяются рыночные заявки (АЗ) и рыночные заявки, затем лимитные заявки (АЗ), лимитные заявки, заявки по цене аукциона закрытия, поданные ранее по времени. Решением Биржи может быть определен иной порядок удовлетворения заявок в аукционе закрытия.

2.22.6.10. Участники торгов в ходе фазы сбора заявок и дополнительной фазы сбора заявок имеют доступ к информации о собственных заявках, а также о заявках с двадцатью лучшими ценами (десять заявок на покупку и десять заявок на продажу), находящихся в очереди в Системе торгов, в части указанного в них количества ценных бумаг (по айсберг-заявкам только в части «текущего видимого количества ценных бумаг») и цены (если решением Биржи не определено иное). Участники торгов в ходе фазы торгов по цене аукциона закрытия имеют доступ к информации о собственных заявках и совокупных объемах всех активных заявок (если решением Биржи не определено иное).

2.22.7. Проведение дискретного аукциона осуществляется в следующем

порядке:

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

2.22.7.2. На основании поданных заявок по истечении 15 минут с момента начала проведения дискретного аукциона, если иной срок не установлен Биржей, в Системе торгов определяется цена дискретного аукциона по ценной бумаге при условии наличия в Системе торгов заявок, совокупные параметры которых соответствуют следующим условиям

- количество участников торгов, подавших заявки; составило не менее 3 (если иное не определено решением Биржи);
- величина совокупного спроса составила более 150 ценных бумаг (если иное не определено решением Биржи);
- величина совокупного предложения составила более 150 ценных бумаг (если иное не определено решением Биржи);
- спрэд, определяемый как отношение разности между средневзвешенной ценой продажи и средневзвешенной ценой покупки, к средневзвешенной цене покупки, не превышает 7% (если иное не определено решением Биржи)

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

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

2.22.7.3. При выполнении условий, указанных в п. 2.22.7.2. настоящих 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.

2.22.7.4. 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. 2.22.7.2. настоящих Правил, (если иное не определено решением Биржи). При этом все ранее поданные в Систему торгов и не отозванные/снятые заявки повторно участвуют в очередном дискретном аукционе. Количество дискретных аукционов, проводимых для одной ценной бумаги в течение торгового дня, не ограничено (если иное не определено решением Биржи). Время окончания последнего дискретного аукциона не может быть позднее времени окончания торгового периода Режим торгов «Режим основных торгов T+» Основной торговой

сессии, установленного в соответствии с п. 1.2.8. настоящих Правил.

В случае если время окончания дискретного аукциона совпадает со временем окончания торгового периода Режим торгов «Режим основных торгов Т+», то в текущий торговый день торги данной ценной бумагой в торговом периоде Режим основных торгов не проводятся.

2.22.7.5. 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 Биржи).

2.22.7.6. Если в ходе дискретного аукциона по ценной бумаге определена цена дискретного аукциона, то по окончании дискретного аукциона торги данной ценной бумагой осуществляются в течение торгового периода и/или в послеторговом периоде и/или аукционе закрытия с учетом, установленного в соответствии с п. 1.2.8. настоящих Правил, времени проведения данных периодов торгов.

2.22.7.7. Заключение сделок на основании заявки, поданной в ходе дискретного аукциона, осуществляется с учетом особенностей, определенных п. 1.2.11., п. 2.1.14.1., п. 2.1.15. и п. 2.1.17. настоящих Правил, по цене дискретного аукциона.

2.22.7.8. 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 (если иное не определено решением Биржи).

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

Подраздел 2.23. Порядок проведения торгов в Режиме торгов «Исполнение обязательств по Сделкам Т+: РПС»

2.23.1. В случаях и в порядке, установленном Правилами клиринга, допускается заключение Сделки Т+ без подачи заявки между Центральным контрагентом и Участником клиринга в Режиме торгов «Исполнение обязательств по сделкам Т+: РПС». Указанная сделка считается заключенной в момент получения Биржей от Клиринговой организации уведомления согласно п. 2.5.19. настоящих Правил.

2.23.2. Заключение Сделок Т+ без подачи заявок в Режиме торгов «Исполнение обязательств по сделкам Т+: РПС» осуществляется в порядке, установленном Правилами клиринга. Также, если решением Биржи не определено иное, в Режиме торгов «Исполнение обязательств по сделкам Т+: РПС» допускается заключение Сделок Т+ в соответствии с порядком, изложенным в Подразделе 2.21. Порядок проведения торгов в Режиме торгов «РПС с ЦК», настоящих Правил.

2.23.3. Продавец по сделке, заключенной без подачи заявок в данном Режиме торгов с кодом расчетов У1, обязан передать Покупателю Доход на ценные бумаги, в отношении которых заключена сделка, если список лиц, имеющих право на его получение, определяется в период с даты заключения сделки, включая эту дату, до фактической даты исполнения, не включая эту дату. Порядок и сроки передачи Дохода, а также размер обязательства по передаче Дохода определяются Правилами клиринга.

Подраздел 2.24. Порядок проведения торгов в Режиме торгов «Исполнение обязательств по Сделкам Т+: РЕПО»

2.24.1. В случаях и в порядке, установленном Правилами клиринга, допускается заключение Сделки Т+ без подачи заявки между Центральным контрагентом и Участником клиринга в Режиме торгов «Исполнение обязательств по сделкам Т+: РЕПО». Указанная сделка считается заключенной в момент получения Биржей от

Клиринговой организации уведомления согласно п. 2.5.19. настоящих Правил.

2.24.2. Заключение Сделок Т+ без подачи заявок в Режиме торгов «Исполнение обязательств по сделкам Т+: РЕПО» осуществляется в порядке, установленном Правилами клиринга. Также, если решением Биржи не определено иное, в Режиме торгов «Исполнение обязательств по сделкам Т+: РЕПО» допускается заключение Сделок Т+, на основании адресных заявок, в соответствии с порядком, изложенным в Подразделе 2.20. Заключение сделок РЕПО с Центральным контрагентом, настоящих Правил.

2.24.3. Покупатель по первой части сделки, заключенной в данном Режиме торгов обязан передать продавцу по первой части сделки Доход на ценные бумаги, в отношении которых заключена сделка, если список лиц, имеющих право на его получение, определяется в период с даты исполнения первой части такой сделки, включая эту дату, до фактической даты исполнения второй части такой сделки, не включая эту дату. Порядок и сроки передачи Дохода, а также размер обязательства по передаче Дохода определяются Правилами клиринга.

Подраздел 2.25. Порядок заключения сделок в Режиме торгов «Исполнение обязательств по срочным контрактам»

2.25.1. Заключение сделок в Режиме торгов «Исполнение обязательств по срочным контрактам» с облигациями, эмитентом которых является Министерство финансов Российской Федерации, осуществляется в следующем порядке:

2.25.1.1. Подача заявок и заключение сделок в Режиме торгов «Исполнение обязательств по срочным контрактам» осуществляется в ходе нескольких торговых периодов, время проведения которых устанавливается Биржей.

2.25.1.2. При проведении торгов в Режиме торгов «Исполнение обязательств по срочным контрактам» сделки заключаются на основании заявок ИСК, поданных Участниками торгов в ходе торговых периодов текущего торгового дня в данном Режиме торгов. В заявках должны быть указаны реквизиты, предусмотренные в п. 2.1.14.13. настоящих Правил. Если иное не определено решением Биржи, допускается указание Участником торгов в заявке ИСК дополнительного признака «время активации заявки».

2.25.1.3. Биржей, в соответствии с информацией, полученной от Клиринговой организации, на время проведения торгов устанавливается цена заключения сделок в Режиме торгов «Исполнение обязательств по срочным контрактам». Данная цена рассчитывается Клиринговой организацией в порядке, установленном Правилами клиринга и Спецификациями срочных контрактов. В Режиме торгов «Исполнение обязательств по срочным контрактам» проводятся торги только ценными бумагами, по которым Биржей получена от Клиринговой организации информация о цене поставки (цене выпуска).

2.25.1.4. Биржей может быть установлено ограничение на максимальный совокупный объем заявок, поданных Участником торгов в ходе одного торгового периода, по которым могут быть заключены сделки в ходе этого торгового периода.

2.25.1.5. В торгах в данном режиме могут принимать участие только те Участники торгов, у которых существуют обязательства по поставке ценных бумаг для целей исполнения срочных контрактов. Наличие таких обязательств определяется Клиринговой организацией, в соответствии с порядком, определенном в Правилах клиринга. Список Участников торгов, которые могут принимать участие в торгах в данном режиме, направляется Клиринговой организацией Бирже в порядке, установленном в Правилах клиринга.

2.25.1.6. Заключение сделки(ок) по заявке ИСК осуществляется с учетом особенностей, определенных п. 1.2.11., п. 2.1.14.13., п. 2.1.15. и п. 2.1.17. настоящих Правил.

2.25.1.7. Если иное не установлено решением Биржи, участники торгов в ходе торгового периода имеют доступ к информации о собственных заявках, а также о совокупном объеме всех активных заявок, поданных в течение торгового периода.

2.25.1.8. Заявки, не удовлетворенные в ходе торгового периода, снимаются с торгов по окончании данного торгового периода (за исключением заявок ИСК, поданных с указанием признака «время активации заявки», в случае, если указанное время активации не наступило на момент окончания торгового периода).

2.25.2. Если иное не определено решением Биржи, в Режиме торгов «Исполнение обязательств по срочным контрактам» заключаются Сделки Т+ с акциями с кодом расчетов Y2, при этом такие сделки заключаются без подачи заявок на условиях, установленных Правилами клиринга. Такая сделка считается заключенной в момент получения Биржей от Клиринговой организации Уведомления о необходимости заключения сделки согласно п. 2.5.19. настоящих Правил.

2.25.3. Если иное не установлено решением Биржи, информация о сделках, заключенных в данном Режиме торгов, за исключением совокупной биржевой информации по итогам торгов, не раскрывается Участникам торгов, которые не принимают участия в торгах в данном режиме.

Раздел 3. Сектор рынка Standard

Подраздел 3.1. Общие положения

3.1.1. Настоящий Раздел Правил регулирует порядок проведения Торгов в Секторе рынка Standard.

3.1.2. В Секторе рынка Standard Сделки заключаются Участниками торгов, действующими от своего имени, с Центральным контрагентом.

Сделки купли-продажи заключаются на условиях, определенных настоящим Разделом Правил и Условиями сделок, заключаемых с Центральным контрагентом в Секторе рынка Standard, являющимися Приложением №16 к настоящим Правилам (далее – Условия сделки).

3.1.2.1. Сделки РЕПО заключаются на условиях, определенных настоящим Разделом Правил и Условиями сделок РЕПО, заключаемых с Центральным контрагентом (далее – Условия сделок РЕПО), являющимися Приложением №17 к настоящим Правилам.

Подраздел 3.2. Виды Заявок

3.2.1. В Секторе рынка Standard допускается объявление следующих заявок:

3.2.1.1. Заявок на заключение сделок купли-продажи ценных бумаг (далее - Заявки на продажу (покупку) ценных бумаг);

3.2.1.2. Заявок на заключение сделок репо (далее - Заявка репо).

3.2.2. В целях настоящего Раздела Правил под Заявкой на заключение сделок купли-продажи ценных бумаг понимается Заявка, содержащая оферту (оферты) на заключение сделки (сделок) продажи ценных бумаг и (или) покупки ценных бумаг, или уведомление о принятии оферты (оферт) на заключение сделки покупки ценных бумаг и (или) продажи ценных бумаг. Под Заявкой на заключение сделок репо в целях настоящего раздела Правил понимается Заявка, содержащая предложение (уведомление о принятии предложения) о заключении Сделки репо в соответствии с настоящими Правилами. Заявки на покупку (продажу) ценных бумаг и Заявки репо далее совместно именуются Заявками.

3.2.3. Заявки, адресованные (информация о которых раскрывается) всем Участникам торгов, в том числе в случае, когда сделки на основании Заявок заключаются

с Клиринговой организацией, признаются безадресными (далее – безадресные Заявки). Все иные Заявки признаются адресными (далее – Адресные Заявки).

3.2.4. В случае если информация, позволяющая идентифицировать Участника торгов, подавшего Заявку, не раскрывается в ходе Торгов всем Участникам торгов, такая Заявка признается анонимной. Заявка, не соответствующая указанным признакам, признается неанонимной.

3.2.5. Заявка, предусматривающая заключение сделки по цене, указанной в Заявке, или по лучшей цене признается лимитной Заявкой.

3.2.6. Заявка, допускающая частичное исполнение, то есть заключение на ее основании сделки или нескольких сделок, предметом которой (которых) является количество ценных бумаг меньшее, чем количество ценных бумаг, указанное в Заявке, признается Заявкой, допускающей частичное исполнение (далее – Заявка, допускающая частичное исполнение). Заявка признается не допускающей частичного исполнения, если на основании этой Заявки может быть заключена одна сделка на все указанное в Заявке количество ценных бумаг (далее – Заявка, не допускающая частичного исполнения).

3.2.7. Заявка, которая подлежит исполнению полностью или частично в момент ее объявления, а в случае ее неисполнения в указанный момент времени немедленно удаляется, признается Заявкой мгновенного исполнения (далее – Заявка мгновенного исполнения).

3.2.8. Заявка, действующая до конца Торгового дня, удаляется Биржей из объявленных Заявок по окончании Торгового дня, в течение которого она была объявлена (далее – Заявка, действующая до конца Торгового дня).

3.2.9. Заявка, содержащая дату окончания срока ее действия, действует до окончания проводимой в указанную дату Основной Торговой сессии (далее – Срочная Заявка), а в случае проведения в эту дату вечерней Дополнительной торговой сессии, - до ее окончания. В случае если такая заявка не была исполнена до окончания срока ее действия, она удаляется Биржей по истечении этого срока. При этом в период срока действия Заявки такая Заявка удаляется Биржей из объявленных Заявок на период проведения вечерних клиринговых сессий и восстанавливается Биржей после окончания указанных вечерних клиринговых сессий; при этом такая Заявка считается объявленной с момента ее объявления Участником торгов.

3.2.10. В целях настоящего Раздела Правил объявленная Заявка, которая не исполнена полностью и не удалена, именуется Активной Заявкой.

3.2.11. Активная Заявка может быть удалена Биржей на основании информации, полученной от Клиринговой организации, в порядке и по основаниям, предусмотренным Правилами клиринга.

3.2.12. В Секторе рынка Standard допускается объявление следующих Заявок на продажу (покупку) ценных бумаг:

3.2.12.1. Заявки на продажу (покупку) ценных бумаг могут быть адресными и безадресными.

3.2.12.2. Адресные Заявки на продажу (покупку) ценных бумаг могут быть только неанонимными.

3.2.12.3. Безадресные Заявки на продажу (покупку) ценных бумаг могут быть только анонимными.

3.2.12.4. Все Заявки на продажу (покупку) ценных бумаг являются лимитными заявками.

3.2.12.5. Заявки на продажу (покупку) ценных бумаг могут быть Заявками, действующими до конца Торгового дня или Срочными Заявками.

3.2.12.6. Безадресные Заявки на продажу (покупку ценных бумаг) могут являться Заявками, допускающими частичное исполнение, и Заявками, не допускающими частичного исполнения. Безадресная Заявка на продажу (покупку) ценных бумаг, допускающая частичное исполнение, может являться Заявкой мгновенного исполнения. Безадресная Заявка на продажу (покупку) ценных бумаг, не допускающая частичного исполнения, может быть только Заявкой мгновенного исполнения.

3.2.12.7. Адресная Заявка на продажу (покупку) ценных бумаг может быть только Заявкой, не допускающей частичного исполнения.

3.2.12.8. Адресная Заявка на продажу (покупку) ценных бумаг может содержать две оферты на совершение сделок с ценными бумагами одного вида, одного эмитента, в одинаковом количестве (оферту на покупку и оферту на продажу или оферту на продажу и оферту на покупку).

3.2.13. В Секторе рынка Standard допускается объявление следующих Заявок репо:

3.2.13.1. Заявки репо могут быть адресными и безадресными.

3.2.13.2. Адресные Заявки репо могут быть только неанонимными.

3.2.13.3. Безадресные Заявки репо могут быть только анонимными.

3.2.13.4. Все Заявки репо являются лимитными заявками.

3.2.13.5. Заявки репо бумаг могут быть Заявками, действующими до конца Торгового дня или Срочными Заявками.

3.2.13.6. Безадресные Заявки репо могут являться Заявками, допускающими частичное исполнение, и Заявками, не допускающими частичного исполнения. Безадресная Заявка репо, допускающая частичное исполнение, может являться Заявкой мгновенного исполнения. Безадресная Заявка на продажу (покупку) ценных бумаг, не допускающая частичного исполнения, может быть только Заявкой мгновенного исполнения.

3.2.13.7. Адресная Заявка репо может быть только Заявкой, не допускающей частичного исполнения.

Подраздел 3.3. Требования к содержанию Заявок

3.3.1. Заявка на продажу (покупку) в Секторе рынка Standard должна содержать:

3.3.1.1. указание на код раздела регистра учета позиций в отношении клиента, по поручению или в интересах которого Участник торгов подает Заявку. Код раздела регистра учета позиций содержит указание на код Участника торгов, подавшего Заявку; Заявка считается поданной Участником торгов в качестве доверительного управляющего, если Заявка содержит указание на код Клиента, являющегося учредителем доверительного управления;

3.3.1.2. наименование и (или) код ценной бумаги;

3.3.1.3. цену одной ценной бумаги;

3.3.1.4. указание на направление оферт (покупка и (или) продажа ценных бумаг);

3.3.1.5. количество ценных бумаг;

3.3.1.6. указание на срок исполнения обязательств по сделке, заключаемой на основании такой Заявки, в соответствии с пунктом 3.5.8 настоящих Правил; указание на срок исполнения обязательств считается указанием Условий перерегистрации ценных бумаг.

3.3.1.7. указание на вид Заявки в соответствии с пунктами 3.2.12.5-3.2.12.7 настоящих Правил; Заявка на продажу (покупку) ценных бумаг может содержать дату окончания срока действия такой Заявки. В случае если Заявка на продажу (покупку) ценных бумаг не содержит дату окончания срока ее действия, она считается Заявкой, действующей до конца Торгового дня;

3.3.1.8. Указание на идентификатор Участника торгов, которому адресована Заявка (для адресных Заявок).

3.3.2. В случае если Заявка на продажу (покупку) ценных бумаг в соответствии с настоящим Разделом Правил содержит более одной оферты на совершение сделки с ценными бумагами, сведения, указанные в подпунктах 3.3.1.3 – 3.3.1.6, указываются в отношении каждой оферты, содержащейся в Заявке. Иные условия, содержащиеся в Заявке, если они указаны для одной из оферт, считаются такими же для других оферт.

3.3.3. Заявка Маркет-мейкера, исполняющего обязательства в Секторе рынка Standard, должна содержать код соответствующего раздела регистра учета позиций, присвоенный Клиринговой организацией в соответствии с Правилами клиринга и предусмотренный договором об исполнении обязательств Маркет-мейкера.

3.3.4. Количество ценных бумаг в Заявках на продажу (покупку) ценных бумаг определяется путем указания на количество лотов ценных бумаг. Количество ценных бумаг в безадресных Заявках на продажу (покупку) ценных бумаг указывается кратным стандартному лоту. Кратность количества ценных бумаг в адресных Заявках не ограничена.

3.3.5. Заявка репо в Секторе рынка Standard должна содержать:

3.3.5.1. указание на Код раздела регистра учета позиций в отношении клиента, по поручению или в интересах которого Участник торгов подает Заявку. Код раздела регистра учета позиций содержит указание на код Участника торгов, подавшего Заявку. Заявка считается поданной Участником торгов в качестве доверительного управляющего, если Заявка содержит указание на код Клиента, являющегося учредителем доверительного управления;

3.3.5.2. наименование и (или) код ценной бумаги;

3.3.5.3. указание на направление Заявки репо, определяемое содержанием Первой части репо (покупка или продажа ценных бумаг);

3.3.5.4. цену одной ценной бумаги по Первой части репо; Цена одной ценной бумаги по Первой части репо указывается в российских рублях;

3.3.5.5. ставку репо, выраженную в процентах годовых.

3.3.5.6. указание на срок исполнения обязательств по Первой части репо;

3.3.5.7. указание на срок исполнения обязательств по Второй части репо;

3.3.5.8. количество ценных бумаг;

3.3.5.9. указание на вид Заявки в соответствии с пунктами 3.2.13.5 – 3.2.13.7.

3.3.5.10. указание на срок исполнения обязательств по сделке, заключаемой на основании такой Заявки, в соответствии с пунктом 3.5.8 настоящих Правил; указание на срок исполнения обязательств считается указанием Условий перерегистрации ценных бумаг;

3.3.5.11. указание на идентификатор Участника торгов, которому адресована Заявка (для адресных Заявок).

3.3.6. Цена одной ценной бумаги по Первой части репо, содержащаяся в безадресной Заявке репо, должна быть равна последней расчетной цене такой ценной бумаги, определенной Клиринговой организацией в порядке, установленном Правилами клиринга.

3.3.7. Сроки исполнения обязательств по Первой части репо и по Второй части репо, указание на которые содержится в Заявке репо, определяются в соответствии с пунктом 3.5.8 настоящих Правил. При этом срок исполнения обязательств по Второй части репо должен превышать срок исполнения обязательств по Первой части репо.

3.3.8. Количество ценных бумаг в Заявке репо определяется путем указания на количество лотов ценных бумаг. Количество ценных бумаг в безадресных Заявках на продажу (покупку) ценных бумаг указывается кратным лоту. Кратность количества ценных бумаг в адресных Заявках не ограничена.

Подраздел 3.4. Объявление и удаление Заявок

3.4.1. Заявка на продажу (покупку) ценных бумаг считается встречной по отношению к другой Заявке на продажу (покупку) ценных бумаг в целях настоящего Раздела Правил, если:

3.4.1.1. одна Заявка содержит оферту на заключение сделки покупки (продажи) ценных бумаг, а другая Заявка содержит оферту на заключение сделки продажи (покупки) ценных бумаг; при этом в случае если каждая Заявка в соответствии с настоящими Правилами содержит более одной оферты, указанное условие должно выполняться в отношении каждой оферты, содержащейся в Заявке;

3.4.1.2. указанные Заявки относятся к одному и тому же виду (адресные/безадресные);

3.4.1.3. одна из указанных Заявок объявлена Участником торгов, которому адресована вторая из них, которая, в свою очередь, объявлена Участником торгов, которому адресована первая из указанных Заявок (для адресных Заявок);

3.4.1.4. указанные Заявки содержат одинаковое количество оферт;

3.4.1.5. указанные Заявки объявлены в Секторе рынка Standard;

3.4.1.6. указанные Заявки содержат одинаковый код ценных бумаг;

3.4.1.7. цена покупки превышает или равна цене продажи (для Заявок на продажу (покупку) ценных бумаг);

3.4.1.8. указанные Заявки имеют одинаковые условия перерегистрации ценных бумаг (в случае если Заявки содержат соответствующее поле);

3.4.1.9. соблюдаются иные требования, предусмотренные настоящими Правилами.

3.4.2. Активная Заявка репо считается встречной по отношению к другой Активной Заявке репо в целях настоящих Правил, если указанные Заявки соответствуют следующим требованиям:

3.4.2.1. Заявка репо, предусматривающая указание на содержание Первой части репо – покупка (продажа) ценных бумаг, и Заявка репо, предусматривающая указание на содержание Первой части репо – соответственно продажа (покупка) ценных бумаг

3.4.2.2. совпадают следующие сведения, указанные в таких Заявках репо:

- срок исполнения обязательств по Первой части репо;
- срок исполнения обязательств по Второй части репо;
- количество ценных бумаг;
- цена одной ценной бумаги по Первой части репо;
- ставка репо.

3.4.2.3. указанные Заявки относятся к одному и тому же виду (адресные/безадресные);

3.4.2.4. одна из указанных Заявок объявлена Участником торгов, которому адресована вторая из них, которая, в свою очередь, объявлена Участником торгов, которому адресована первая из указанных Заявок (для адресных Заявок);

3.4.2.5. указанные Заявки объявлены в Секторе рынка Standard;

3.4.2.6. указанные Заявки содержат одинаковый код ценных бумаг;

3.4.2.7. соблюдаются иные требования, предусмотренные настоящими Правилами.

3.4.3. С помощью Рабочей станции осуществляется заполнение формы Заявки и ее отправка в Систему торгов. В целях настоящего раздела Правила под Рабочей станцией понимается программное обеспечение, которое позволяет объявлять (изменять, удалять) Заявки на Торгах в Секторе рынка Standard, заключать сделки, получать раскрываемую Биржей информацию и осуществлять иные действия, необходимые для участия в Торгах, в соответствии с настоящими Правилами, другими документами Биржи и документами Технического центра и право использования которого предоставлено Участнику торгов Техническим центром.

3.4.4. Заявка считается объявленной с момента ее регистрации в Реестре Заявок.

3.4.5. Ответственность за несоответствие Заявки установленным требованиям несет Участник торгов, подавший данную Заявку.

3.4.6. Заявка не регистрируется в Реестре Заявок в случаях, предусмотренных пунктом 1.15.14 настоящих Правил, а также если:

3.4.6.1. Участник торгов не допущен к торгам в Секторе рынка Standard; или

3.4.6.2. указанная в Заявке цена выше верхнего (ниже нижнего) Лимита колебаний цены ценных бумаг, установленного Клиринговой организацией; или

3.4.6.3. исполнение Заявки приведет к превышению Лимитов открытых позиций, установленных в отношении Участника торгов в соответствии с настоящими Правилами и Правилами клиринга; или

3.4.6.4. Биржей получен от Клиринговой организации отказ в объявлении Заявки в соответствии с Правилами клиринга.

3.4.7. В случае превышения максимально допустимого количества Транзакций за период Биржа вправе не регистрировать подаваемые Заявки в Реестре Заявок, а также не предоставлять возможность изменения/отзыва ранее поданных Активных Заявок до истечения установленного срока. Максимально допустимое количество Транзакций за период, продолжительность периода и срока, в течение которого Биржа вправе не регистрировать подаваемые Заявки в Реестре Заявок, а также не предоставлять возможность изменения/отзыва ранее поданных Активных Заявок, устанавливается Биржей и публикуется на сайте Биржи. В целях настоящего Раздела под Транзакцией понимается одно из следующих действий Участника торгов, с использованием Торгового идентификатора, в Системе торгов: подача Заявки, удаление Активной Заявки, удаление (отзыв) Активной Заявки (Заявок) с одновременной подачей Заявки (Заявок) с иными условиями.

3.4.8. Заявки объявляются на условии того, что они могут быть удалены Биржей в случаях, предусмотренных настоящими Правилами.

3.4.9. Биржа удаляет Активные Заявки в случаях, предусмотренных пунктом 3.4.6 настоящих Правил.

3.4.10. Участники торгов вправе устанавливать Клиентские лимиты и изменять Брокерские лимиты в Системе торгов. Биржа передает Клиринговой организации, информацию об установленных Клиентских лимитах в режиме реального времени. Под Клиентскими лимитами и Брокерскими лимитами в целях настоящего Раздела Правил понимаются Клиентские лимиты и Брокерские лимиты как они определены в Правилах клиринга.

При получении от Участника торгов в Системе торгов запроса на изменение Брокерского лимита, Клиринговая организация осуществляет проверку возможности данного изменения в порядке, определенном в Правилах клиринга. Клиринговая организация осуществляет изменение Брокерского лимита при положительном результате проверки и передает Бирже информацию об изменении Брокерского лимита в режиме реального времени, о чем Биржа уведомляет Участника торгов посредством Системы торгов.

3.4.11. Биржа в порядке, установленном договором с Центральным контрагентом и Правилами клиринга, уведомляет Центрального контрагента о подаче Заявок на заключение сделок, а также о подаче запросов на удаление указанных Заявок, являющихся Активными Заявками.

3.4.12. Центральный контрагент в порядке и сроки, определенные Правилами клиринга, осуществляет проверку возможности объявления Заявки, о подаче которой он был уведомлен Биржей. В случае положительного результата этой проверки Центральный контрагент направляет Бирже подтверждение возможности объявления Заявки, а в случае отрицательного результата указанной проверки - отказ в объявлении Заявки.

3.4.13. Участник торгов имеет право удалить поданную им Активную Заявку, если иное не предусмотрено настоящими Правилами. Активная Заявка может быть удалена Биржей в случаях, предусмотренных настоящими Правилами. Факты удаления Заявок регистрируются в Реестре Заявок.

3.4.14. Ограничения на объявление Заявок и заключение сделок:

3.4.14.1. Биржа вправе устанавливать ограничения цен, по которым Участником торгов может быть подана Заявка на покупку/продажу ценных бумаг (ценовой коридор).

3.4.14.2. В течение первого дня обращения ценной бумаги на Торгах не допускается объявление Заявок (кроме Заявок репо), цена которых превышает установленный Биржей размер предельных отклонений цен заявок на покупку/продажу ценной бумаги по сравнению с расчетной ценой данной ценной бумаги.

3.4.14.3. Заявка, поданная Участником торгов от имени или за счет Клиента, который не был зарегистрирован в установленном порядке, либо поданная с иным нарушением настоящих Правил, не регистрируется в Реестре Заявок.

3.4.14.4. Не допускается заключение сделки на основании Заявок, поданных за счет одного Участника торгов или одного Клиента (в соответствии с кодом этого лица) (кросс-сделок).

3.4.14.5. Биржа вправе устанавливать иные ограничения на объявление Заявок и (или) на заключение сделок на Торгах в Секторе рынка Standard.

Подраздел 3.5. Заключение Сделок

3.5.1. Сделки в Секторе рынка Standard заключаются в российских рублях.

3.5.2. Сделки Участниками торгов с Центральным контрагентом заключаются в следующем порядке:

3.5.2.1. Моментом получения Центральным контрагентом оферты является момент объявления Участником торгов Заявки на заключение сделки с Центральным контрагентом в соответствии с настоящими Правилами.

3.5.2.2. В момент объявления Заявки, являющейся встречной по отношению к Активной Заявке, Центральный контрагент обязан принять (акцептовать) адресованные ему оферты, сделанные посредством объявления указанных Заявок. При этом количество ценных бумаг, являющихся предметом сделок купли-продажи ценных бумаг, и цена таких сделок определяются в порядке, установленном п. 3.5.3 и п. 3.5.4 настоящего Раздела Правил, за исключением сделок купли-продажи ценных бумаг, на основании адресных Заявок.

3.5.2.3. Акцепт оферт, сделанных Участниками торгов, осуществляется Центральным контрагентом при соблюдении условий, предусмотренных настоящими Правилами и Правилами клиринга, посредством направления им соответствующих сообщений с указанием количества ценных бумаг, являющихся предметом сделки, и цены сделки. Указанные сообщения не являются Заявками. Сообщения Центрального контрагента о принятии оферт, сделанных Участниками торгов, направляются Участникам торгов через Биржу. Момент отображения указанного сообщения в Системе торгов считается моментом получения Участниками торгов - оферентами акцепта Центрального контрагента.

3.5.2.4. Сделки Участников торгов с Центральным контрагентом считаются заключенными в момент получения Участниками торгов - оферентами акцепта Центрального контрагента.

3.5.2.5. Центральный контрагент заключает сделки на основании Заявки и встречной по отношению к ней Заявки одновременно с каждым из Участников торгов, объявивших указанные Заявки.

3.5.2.6. Центральный контрагент заключает сделки с Участниками торгов исключительно для целей осуществления клиринга по сделкам, заключенным на Торгах.

3.5.3. Сделки купли-продажи ценных бумаг на основании безадресных Заявок на покупку (продажу) ценных бумаг заключаются по правилам двойного аукциона, при условии объявления встречных Заявок. Цена таких сделок определяется в порядке, предусмотренном настоящим пунктом. Количество ценных бумаг при заключении таких сделок определяется в порядке, предусмотренном пунктом 3.5.4 настоящего Раздела Правил.

3.5.3.1. Сделка купли-продажи ценных бумаг может быть заключена по цене, указанной в Активной Заявке, или по лучшей цене. При этом лучшей ценой, содержащейся в Заявке на продажу ценных бумаг, считается наименьшая цена, а лучшей ценой, содержащейся в Заявке на покупку ценных бумаг, – наибольшая цена.

3.5.3.2. При заключении сделки купли-продажи ценных бумаг на основании лимитированных Активных Заявок сделка заключается по цене, указанной в ранее объявленной Активной Заявке.

3.5.3.3. Сделки купли-продажи ценных бумаг на основании рыночных Активных Заявок заключаются по ценам встречных по отношению к ним лимитированных Активных Заявок.

3.5.3.4. При наличии в Реестре Заявок нескольких Активных Заявок, встречных по отношению к вновь объявленной Активной Заявке, сделка купли-продажи ценных бумаг заключается на основании лучшей Активной Заявки (Заявок). При этом лучшей Активной Заявкой на продажу считается Активная Заявка на продажу, содержащая наименьшую цену, а при наличии нескольких таких Активных заявок – объявленная раньше; лучшей Активной Заявкой на покупку считается Активная заявка на покупку, содержащая наибольшую цену, а при наличии нескольких таких Активных заявок – объявленная раньше.

3.5.3.5. Если Активные Заявки, встречные по отношению к вновь объявленной Активной Заявке, содержат одинаковые цены, они исполняются в порядке их регистрации в Реестре Заявок.

3.5.3.6. Если для полного исполнения вновь объявленной Активной Заявки происходит заключение сделок купли-продажи ценных бумаг с участием нескольких встречных по отношению к ней Активных Заявок, содержащих различные цены, части вновь объявленной Активной Заявки исполняются по ценам, указанным в ранее поступивших Активных Заявках.

3.5.3.7. Активная Заявка, содержащая лучшую цену, а при наличии нескольких таких Активных Заявок – объявленная раньше, считается лучшей Активной Заявкой.

3.5.4. Определение количества ценных бумаг при заключении сделок купли-продажи на основании безадресных Заявок в рамках аукциона встречных Заявок:

3.5.4.1. Сделка (сделки) купли-продажи ценных бумаг на основании Активной Заявки, допускающей возможность ее частичного исполнения, может быть заключена на часть указанного в данной Активной Заявке количества ценных бумаг,

соответствующую общему количеству ценных бумаг во встречных по отношению к ней Активных Заявках.

3.5.4.2. Сделка (сделки) купли-продажи ценных бумаг на основании Активной Заявки, не предусматривающей возможность ее частичного исполнения, может быть заключена только на все указанное в данной Активной Заявке количество ценных бумаг.

3.5.5. В случае объявления адресной Заявки Центральный контрагент вправе акцептовать оферту (оферты), содержащуюся в такой Заявке, независимо от наличия встречной Активной Заявки.

3.5.6. Сделки репо заключаются на условиях, установленных Условиями сделок репо, и при этом:

Дата покупки определяется исходя из даты заключения Сделки репо и срока исполнения обязательств по Первой части репо;

Дата обратного выкупа определяется исходя из даты заключения Сделки репо и срока исполнения обязательств по Второй части репо;

Сумма покупки определяется исходя из количества ценных бумаг, в отношении которых заключена Сделка репо, и цены одной ценной бумаги по Первой части репо, указанной в Заявке репо, на основании которой заключена Сделка репо;

Сумма обратного выкупа определяется по следующей формуле:

$$A = Q * P * \left(1 + \frac{r * t}{T * 100}\right),$$

где:

A – Сумма обратного выкупа;

Q – количество ценных бумаг, в отношении которых заключена Сделка репо;

P – цена одной ценной бумаги по Первой части репо;

r – ставка репо;

t – срок Сделки репо, определяемый как количество календарных дней, составляющих период с Даты покупки до Даты обратного выкупа, исключая Дату покупки, но включая Дату обратного выкупа;

T – количество календарных дней в календарном году, в котором заключена Сделка репо.

3.5.7. Сделки репо на основании безадресных Заявок репо в Секторе рынка Standard заключаются по правилам двойного аукциона ставок репо при условии объявления встречных Заявок репо. При этом лучшей ставкой репо, содержащейся в Заявке репо, на основании которой может быть заключена Сделка репо, в соответствии с которой Участник торгов, подавший эту Заявку репо, является Покупателем по сделке репо, является наименьшая ставка репо, а лучшей ставкой репо, содержащейся в Заявке репо, на основании которой может быть заключена Сделка репо, в соответствии с которой

Участник торгов, подавший эту Заявку репо, является Продавцом по сделке репо, - наибольшая ставка репо.

3.5.8. Срок исполнения обязательств по сделкам купли-продажи ценных бумаг, а также срок исполнения обязательств по Первой части репо и по Второй части репо исчисляются в Рабочих днях с даты заключения сделки. Срок исполнения обязательств по сделкам купли-продажи ценных бумаг определяется в соответствии с Условиями сделки. Сроки исполнения обязательств по Первой части репо и по Второй части репо по сделкам РЕПО, заключаемым на основании безадресных Заявок репо, определяются Биржей и раскрываются на Сайте Биржи. Минимальный и (или) максимальный сроки исполнения обязательств по сделкам купли-продажи ценных бумаг, заключаемым на основании адресных Заявок, а также обязательств по Первой части репо и по Второй части репо по Сделкам репо, заключаемым на основании адресных Заявок репо, определяются Биржей и раскрываются на Сайте Биржи. При этом, в случае принятия решения о том, что сделка купли-продажи или Первая часть репо подлежит исполнению в день заключения соответствующей сделки купли-продажи (Сделки репо), Биржей могут быть установлены ограничения на период (периоды) времени в течение Торгового дня, в течение которого (которых) допускается заключение таких сделок.

3.5.9. В целях проведения дневной клиринговой сессии Биржа вправе приостановить Торги в Секторе рынка Standard не более чем на три минуты в период с 14 часов 00 минут до 14 часов 03 минут (по московскому времени). В целях проведения вечерней клиринговой сессии Биржа вправе приостановить Торги в Секторе рынка Standard не более чем на тридцать минут в период с 18 часов 45 минут до 19 часов 25 минут (по московскому времени). Время начала и окончания периода приостановки Торгов в Секторе рынка Standard в целях проведения дневной/вечерней клиринговой сессии устанавливается решением Биржи.

3.5.10. Лимит колебаний цены сделки изменяется в порядке, определенном в Правилах клиринга. Биржа, получив указанную информацию от Клиринговой организации, доводит ее до сведения Участников торгов в Секторе рынка Standard. В случае если в соответствии с Правилами клиринга возникает необходимость увеличения лимита колебаний цены сделок, заключаемых с определенными ценными бумагами в Секторе рынка Standard, Клиринговая организация уведомляет об этом Биржу, и Биржа приостанавливает Торги по соответствующим ценным бумагам для увеличения указанных лимитов.

3.5.11. Приостановление или прекращение допуска Участника торгов к участию в Торгах может быть осуществлено с использованием одного, нескольких или всех разделов регистра учета позиций (как они определены в Правилах клиринга) Участника торгов, по основаниям, предусмотренным настоящими Правилами и Правилами допуска.

3.5.12. Расчетная цена ценной бумаги в первый день ее обращения на Торгах в Секторе рынка Standard определяется Клиринговой организацией.

Предельные отклонения цен Заявок по отношению к расчетной цене ценной бумаги в первый день ее обращения на Торгах, цены открытия такой ценной бумаги по отношению к ее расчетной цене и текущей цены по отношению к цене открытия определяются и изменяются в соответствии с документами Биржи.

Подача Заявок и заключение сделок с ценными бумагами в первый день их обращения на Торгах осуществляются в течение Торгового дня, если иное время не установлено Биржей.

Подраздел 3.6. Особенности заключения сделок в результате исполнения Срочных контрактов

3.6.1. В случае если при исполнении Срочных контрактов Клиринговой организации в соответствии с Правилами клиринга подается оферта на заключение сделки купли-продажи в Секторе рынка Standard, такая оферта считается полученной Клиринговой организацией в момент ее подачи.

3.6.2. Клиринговая организация осуществляет акцепт оферты, указанной в 3.6.1, в порядке, установленном настоящими Правилами. При этом сделка купли-продажи ценных бумаг заключается на условиях, определенных в соответствии с Правилами клиринга.

3.6.3. Если иное не определено решением Биржи срок исполнения обязательств по сделке купли-продажи, заключаемой в результате исполнения Срочного контракта, считается равным 3 (трем) Рабочим дням.

3.6.4. Включение сделки купли-продажи ценных бумаг, заключенной в результате исполнения Срочного контракта, в Реестр сделок осуществляется с указанием в качестве кода Клиента кода раздела регистра учета позиций, на котором в соответствии с Правилами клиринга учитываются обязательства по такой сделке.

Подраздел 3.7. Исполнение (прекращение) сделок

3.7.1. Исполнение сделок, заключенных в Секторе рынка Standard, осуществляется на основании информации, передаваемой Биржей Центральному контрагенту. Дополнительного оформления, подтверждения или сверки заключенных сделок Участниками торгов или Клиентами не требуется.

3.7.2. Обязательства по сделкам купли-продажи ценных бумаг исполняются (прекращаются) в соответствии с Условиями сделки и Правилами клиринга.

3.7.3. Обязательства по сделкам репо исполняются (прекращаются) в соответствии с Условиями сделок репо и Правилами клиринга.

3.7.4. Исполнение обязательств по сделкам в том числе Первой части репо и Второй части репо, осуществляется в российских рублях.

3.7.5. Односторонний отказ от сделки, заключенной на Торгах, допускается только в случаях, установленных законодательством Российской Федерации и договором.

3.7.6. Взаимодействие между Биржей и Клиринговой организацией осуществляется на основании заключенного между ними договора, а также в соответствии с настоящими Правилами и Правилами клиринга.

3.7.7. При взаимодействии Клиринговой организации и Биржи обмен документами и информацией осуществляется в порядке, установленном Правилами клиринга.

Подраздел 3.8. Отчеты о сделках с ценными бумагами

3.8.1. Биржа каждый Торговый день формирует отчеты о сделках с ценными бумагами, заключенных Участниками торгов на Торгах в Секторе рынка Standard.

3.8.2. Отчет о сделках Участника торгов, заключенных в Секторе рынка Standard содержит следующие сведения:

- 3.8.2.1. идентификационный номер сделки;
- 3.8.2.2. дату и время регистрации сделки в Реестре сделок;
- 3.8.2.3. совокупность прав и обязанностей по сделке купли-продажи ценных бумаг (покупка ценных бумаг или продажа ценных бумаг) или указание на то, что заключена Сделка репо;
- 3.8.2.4. код Участника торгов, которому была адресована Заявка, на основании которой заключена сделка (указывается, если сделка заключена на основании адресных Заявок);
- 3.8.2.5. код ценных бумаг, являющихся предметом сделки, наименование эмитента (название паевого инвестиционного фонда и наименование его управляющей компании, индивидуальное обозначение, идентифицирующее ипотечные сертификаты участия, и наименование управляющего ипотечным покрытием), вид, категорию (тип), серию ценной бумаги, являющейся предметом сделки, а для российских депозитарных расписок дополнительно указываются: вид представляемых ценных бумаг; наименование эмитента представляемых ценных бумаг; соотношение одной российской депозитарной расписки и количества представляемых ценных бумаг, право собственности на которые удостоверяется одной российской депозитарной распиской данного выпуска;
- 3.8.2.6. цену одной ценной бумаги, а в отношении Сделки репо – цену одной ценной бумаги по Первой части репо;
- 3.8.2.7. сумму сделки (при этом сумма сделки округляется по правилам математического округления до второго десятичного знака, но не менее 0,01);
- 3.8.2.8. количество ценных бумаг;
- 3.8.2.9. дату проведения расчетов по сделке.

3.8.3. Сведения о Сделке репо указываются в отчете о сделках посредством внесения в этот отчет отдельно сведений о Первой части репо и о Второй части репо.

3.8.4. Отчет о сделках содержит также в отношении Сделок репо указание на дату исполнения обязательств по Первой части репо и по Второй части репо, ставку репо (процентную ставку), а также указание на то, что установлена обязанность Покупателя по сделке репо передать Продавцу по сделке репо доход по ценным бумагам, в отношении которых заключена Сделка репо.

3.8.5. Отчеты о сделках, заключенных Участником торгов, предоставляются Участнику торгов через Рабочую станцию в режиме реального времени. Отчет о сделке считается предоставленным Участнику торгов в момент регистрации сделки в Реестре сделок.

3.8.6. Реестр сделок, заключенных Участником торгов в течение Торгового дня, представляет собой совокупность сведений, содержащихся в отчетах о всех таких сделках, и считается предоставленным Участнику торгов с момента предоставления ему указанных отчетов.

Раздел 4. Сектор рынка Classica

Подраздел 4.1. Заявки в Секторе рынка Classica

4.1.1. В Секторе рынка Classica допускается объявление следующих заявок: Заявок на заключение сделок купли-продажи ценных бумаг (далее - Заявки на продажу (покупку) ценных бумаг).

4.1.2. В целях настоящего Раздела Правил под Заявкой на заключение сделок купли-продажи ценных бумаг понимается Заявка, содержащая оферту (оферты) на заключение сделки (сделок) продажи ценных бумаг и (или) покупки ценных бумаг, или уведомление о принятии оферты (оферт) на заключение сделки покупки ценных бумаг и (или) продажи ценных бумаг.. Заявка на покупку (продажу) ценных бумаг и Заявки также именуется Заявкой.

4.1.3. Заявки, адресованные (информация о которых раскрывается) всем Участникам торгов, признаются безадресными (далее – безадресные Заявки). Все иные Заявки признаются адресными (далее – Адресные Заявки).

4.1.4. В случае если информация, позволяющая идентифицировать Участника торгов, подавшего Заявку, не раскрывается в ходе Торгов всем Участникам торгов, такая Заявка признается анонимной. В случае если указанная информация раскрывается в ходе Торгов всем Участникам торгов, Заявка признается неанонимной.

4.1.5. Заявка, предусматривающая заключение сделки по цене, указанной в Заявке, или по лучшей цене признается лимитной Заявкой.

4.1.6. Заявка, допускающая частичное исполнение, то есть заключение на ее основании сделки или нескольких сделок, предметом которой (которых) является количество ценных бумаг меньшее, чем количество ценных бумаг, указанное в Заявке, признается Заявкой, допускающей частичное исполнение (далее – Заявка, допускающая частичное исполнение). Заявка признается не допускающей частичного исполнения, если на основании этой Заявки может быть заключена одна сделка на все указанное в Заявке количество ценных бумаг (далее – Заявка, не допускающая частичного исполнения).

4.1.7. Заявка, действующая до конца Торгового дня, удаляется Биржей из объявленных Заявок по окончании Торгового дня, в течение которого она была объявлена (далее – Заявка, действующая до конца Торгового дня).

4.1.8. Бессрочная Заявка действует (является объявленной) до ее удаления Участником торгов или до ее полного исполнения (далее – Бессрочная Заявка).

4.1.9. В целях настоящего Раздела Правил объявленная Заявка, которая не исполнена полностью и не удалена, именуется Активной Заявкой.

4.1.10. В Секторе рынка Classica допускается объявление следующих Заявок на продажу (покупку) ценных бумаг:

4.1.10.1. Заявки на продажу (покупку) ценных бумаг могут быть адресными и безадресными.

4.1.10.2. Адресные Заявки на продажу (покупку) ценных бумаг могут быть только неанонимными.

4.1.10.3. Безадресные Заявки на продажу (покупку) ценных бумаг могут быть только неанонимными.

4.1.10.4. Безадресные заявки могут быть только заявками, не допускающими частичного исполнения.

4.1.10.5. Безадресные Заявки могут быть заявками, действующими до конца Торгового дня, или Бессрочными Заявками.

4.1.10.6. Адресные Заявки могут быть только Бессрочными заявками.

4.1.10.7. Адресные заявки могут быть только Заявками, не допускающими частичного исполнения.

4.1.10.8. При объявлении безадресной Заявки на продажу (покупку) ценных бумаг Участник торгов вправе указать в Заявке количество ценных бумаг, информация о которых раскрывается другим Участникам торгов (Основное количество ценных бумаг), а также количество ценных бумаг, информация о которых не раскрывается другим Участникам торгов (Резервное количество ценных бумаг). В этом случае Заявка считается объявленной на Основное количество ценных бумаг с момента раскрытия другим Участникам торгов информации об Основном количестве ценных бумаг.

Подраздел 4.2. Требования к содержанию Заявки

4.2.1. Заявка должна содержать:

4.2.1.1. указание на код Участника торгов, подавшего Заявку;

4.2.1.2. указание на код Клиента (код торговых счетов), по поручению или в интересах которого Участник торгов подает Заявку. Заявка считается поданной Участником торгов в качестве доверительного управляющего, если Заявка содержит указание на код Клиента, являющегося учредителем доверительного управления;

4.2.1.3. наименование и (или) код ценной бумаги;

4.2.1.4. цену одной ценной бумаги;

4.2.1.5. указание на направление оферт (покупка и (или) продажа ценных бумаг);

4.2.1.6. количество ценных бумаг;

4.2.1.7. указание на валюту платежа;

4.2.1.8. указание на Условия перерегистрации ценных бумаг;

4.2.1.9. указание на вид Заявки в соответствии с пунктами 4.1.10.4 – 4.1.10.8 настоящих Правил;

4.2.1.10. указание на валюту сделки (для адресной Заявки).

4.2.2. Указание на валюту платежа может принимать следующие значения:

«В» – российские рубли;

«S» – доллары США;

«J» – российские рубли или доллары США по усмотрению инициатора сделки;

4.2.3. Цены акций, российских депозитарных расписок, инвестиционных паев и ипотечных сертификатов участия указываются:

в безадресных Заявках - в долларах США;

в адресных Заявках - в долларах США или российских рублях.

Цены облигаций указываются в Заявках в процентах от номинальной стоимости без учета накопленного купонного дохода. Цена облигации внешнего облигационного займа должна содержать не более 6 значащих цифр и может указываться в Заявке с точностью до 0,0005 процента от ее номинальной стоимости. Цена иной облигации должна содержать не более 5 значащих цифр и может указываться в Заявке с точностью до 0,01 процента от ее номинальной стоимости.

4.2.4. Поле «Условия перерегистрации ценных бумаг» может содержать срок перерегистрации ценных бумаг с Участника торгов / Клиента Участника торгов - продавца ценных бумаг на Участника торгов/ Клиента Участника торгов – покупателя или принимать иные значения, предусмотренные настоящим Разделом Правил.

4.2.5. Количество (резервное количество) ценных бумаг в безадресных Заявках на продажу (покупку) ценных бумаг указывается кратным стандартному лоту. Кратность количества ценных бумаг в адресных Заявках не ограничена.

4.2.6. Заявка Маркет-мейкера, исполняющего обязательства в Секторе рынка Classica, должна быть подана с использованием вкладки «Market Making» Рабочей станции или содержать код разделов регистра учета позиций, присвоенный Клиринговой организацией в соответствии с Правилами клиринга и предусмотренный договором об исполнении обязательств Маркет-мейкера.

4.2.7. Решением Биржи для ценной бумаги или вида (типа) ценных бумаг могут быть установлены ограничения, предельные значения и/или порядок расчета для следующих реквизитов или параметров заявок:

- минимальный объем заявки для всех Участников торгов и/или для Прайм-брокеров;
- DBQ-лот;
- валюта указания цены в заявке/сделки.

4.2.8. Условия перерегистрации ценных бумаг:

4.2.8.1. При объявлении безадресных Заявок в отношении ценных бумаг эмитента (управляющей компании паевых инвестиционных фондов, управляющего ипотечным покрытием), перечень которых, утвержден Биржей, в поле «Условие перерегистрации ценных бумаг» допускается указание только символа «Р». Указание в поле «Условия перерегистрации ценных бумаг» Заявки символа «Р» означает следующее:

сделка, заключенная на основании данной Заявки, подлежит исполнению на условиях «поставки против платежа» без предварительного обеспечения в соответствии с Правилами клиринга;

срок исполнения обязательств составляет 3 Рабочих дня с даты заключения договора.

4.2.8.2. Решением Биржи может быть установлен перечень эмитентов (управляющих компаний паевых инвестиционных фондов, управляющих ипотечным покрытием), перерегистрация ценных бумаг которых производится только со счета НКО ЗАО НРД на счет НКО ЗАО НРД (далее по тексту расчетно-депозитарные организации или РДО). Указание в отношении указанных ценных бумаг в поле «Условия перерегистрации ценных бумаг» безадресной Заявки символа «D» означает, что перерегистрация ценных бумаг должна быть осуществлена:

- со счета в НКО ЗАО НРД на счет в НКО ЗАО НРД;
- на счет в НКО ЗАО НРД как номинального держателя Покупателя в реестре владельцев ценных бумаг.

В этом случае Участник торгов, выступающий продавцом, обязан до подписания договора сообщить Покупателю, с какого счета РДО будет осуществлена передача ценных бумаг (в реестре владельцев ценных бумаг или в РДО).

4.2.8.3. В случае если в заявке на заключение сделки с акциями указано количество дней на перерегистрацию ценных бумаг, покупатель вправе при

заключении сделки потребовать перерегистрации ценных бумаг на счет в реестре владельцев именных ценных бумаг, при условии компенсации продавцу расходов, связанных с перерегистрацией ценных бумаг. Указанная сумма компенсации определяется в ходе переговоров до заключения сделки и включается в сумму сделки. При недостижении согласия о размере компенсации сделка считается незаключенной. Количество дней на перерегистрацию акций в реестре владельцев именных ценных бумаг, указываемое в заявке, не должно превышать 10 (десять) дней.

Подраздел 4.3. Объявление и удаление Заявок в Секторе рынка Classica

4.3.1. Заявка на продажу (покупку) ценных бумаг считается встречной по отношению к другой Заявке на продажу (покупку) ценных бумаг в целях настоящего раздела Правил, если:

4.3.1.1. одна Заявка содержит оферту на заключение сделки покупки (продажи) ценных бумаг, а другая Заявка содержит оферту на заключение сделки продажи (покупки) ценных бумаг;

4.3.1.2. указанные Заявки относятся к одному и тому же виду (адресные/безадресные); в случае, предусмотренном п. 4.6.1 настоящих Правил, адресная Заявка признается встречной по отношению к безадресной Заявке.

4.3.1.3. одна из указанных Заявок объявлена Участником торгов, которому адресована вторая из них, которая, в свою очередь, объявлена Участником торгов, которому адресована первая из указанных Заявок (для адресных Заявок);

4.3.1.4. указанные Заявки содержат одинаковое количество оферт;

4.3.1.5. указанные Заявки объявлены в Секторе рынка Classica;

4.3.1.6. указанные Заявки содержат одинаковое указание на валюту платежа (в случае если Заявки содержат соответствующее поле);

4.3.1.7. указанные Заявки содержат одинаковый код ценных бумаг;

4.3.1.8. цена покупки превышает или равна цене продажи (для Заявок на продажу (покупку) ценных бумаг);

4.3.1.9. указанные Заявки имеют одинаковые условия перерегистрации ценных бумаг (в случае если Заявки содержат соответствующее поле);

4.3.1.10. соблюдаются иные требования, предусмотренные настоящими Правилами.

4.3.2. С помощью Рабочей станции осуществляется заполнение формы Заявки и ее отправка в Систему торгов. В целях настоящего раздела Правила под Рабочей станцией (далее - Рабочая станция) понимается программное обеспечение, которое позволяет объявлять (изменять, удалять) Заявки на Торгах в Секторе рынка Classica, заключать сделки, получать раскрываемую Биржей информацию и осуществлять иные действия, необходимые для участия в Торгах, в соответствии с настоящими Правилами, другими документами Биржи и документами Технического центра и право использования которого предоставлено Участнику торгов Техническим центром.

4.3.3. Заявка считается объявленной с момента ее регистрации в Реестре Заявок.

4.3.4. Ответственность за несоответствие Заявки установленным требованиям несет Участник торгов, подавший данную Заявку.

4.3.5. Объявление Участником торгов Заявок и заключение сделок осуществляется без ограничений Лимитами.

4.3.6. Участник торгов освобождается от обязанностей, вытекающих из объявленных им в Системе торгов Активных Заявок при одновременном наличии следующих обстоятельств:

- для данного Участника торгов пользование Системой торгов затруднено или невозможно в связи с техническими неполадками Системы торгов, каналов связи или его Рабочей станции;
- Участник торгов известил об указанных технических неполадках Маклера.

При этом Маклер обязан:

- зафиксировать в журнале Маклера вышеуказанные обстоятельства;
- удалить все Активные Заявки соответствующего Участника торгов.

4.3.7. Ограничения на объявление Заявок и заключение сделок:

4.3.7.1. Биржа вправе устанавливать ограничения цен, по которым Участником торгов может быть подана Заявка на покупку/продажу ценных бумаг (ценовой коридор).

4.3.7.2. В течение первого дня обращения ценной бумаги на Торгах не допускается объявление Заявок, цена которых превышает установленный Биржей размер предельных отклонений цен заявок на покупку/продажу ценной бумаги по сравнению с расчетной ценой данной ценной бумаги.

4.3.7.3. Заявка, поданная Участником торгов от имени или за счет Клиента, который не был зарегистрирован в установленном порядке, либо поданная с иным нарушением настоящих Правил, не регистрируется в Реестре Заявок.

4.3.7.4. Не допускается заключение сделки на основании Заявок, поданных за счет одного Участника торгов или одного Клиента (в соответствии с кодом этого лица) (кросс-сделок).

4.3.7.5. Биржа вправе устанавливать иные ограничения на объявление Заявок и (или) на заключение сделок на Торгах.

Подраздел 4.4. Заключение сделок в Секторе рынка Classica

4.4.1. Моментом получения Участниками торгов оферты является момент объявления Заявки.

4.4.2. Принятие оферты (акцепт) осуществляется Участником торгов посредством объявления встречной Заявки. Моментом получения Участником торгов – оферентом акцепта является момент объявления Заявки, являющейся встречной по отношению к Заявке, объявленной этим Участником торгов.

4.4.3. Все сделки, заключенные на Торгах, считаются заключенными в г.Москве.

4.4.4. Сделки купли-продажи ценных бумаг заключаются на условиях, определенных Правилами и Порядком письменного оформления сделок, заключенных в Секторе рынка Classica, являющимся Приложением №15 к настоящим Правилам.

4.4.5. В Секторе рынка Classica сделка может быть заключена:

4.4.5.1. путем переговоров;

4.4.5.2. электронным способом.

Подраздел 4.5. Заключение сделок путем переговоров

4.5.1. В течение Торгового дня Участник торгов обязан обеспечить возможность телефонных переговоров с другими Участниками торгов, имеющими доступ к Сектору рынка Classica, в отношении условий Активных Заявок, объявленных данным Участником торгов в Секторе рынка Classica. Указанное требование считается соблюденным в случае, когда Участник торгов, объявивший Активную Заявку, отвечает на звонок по телефонному номеру, зарегистрированному в Системе торгов для такого Участника торгов, не позднее 3 (трех) минут с момента поступления последнему телефонного звонка.

4.5.2. Началом переговоров по заключению сделки считается первое упоминание Участником торгов эмитента (управляющей компании паевых инвестиционных фондов, управляющего ипотечным покрытием) или кода ценной бумаги. Осуществление переговоров допускается с использованием телефонной связи, а также с использованием функции Communications Рабочей станции.

4.5.3. Участник торгов (далее – «Инициатор сделки»), обратившийся с целью заключения сделки к другому Участнику торгов, объявившему Активную Заявку, вправе по своему усмотрению прекратить переговоры до момента заключения сделки.

4.5.4. В случае если Инициатор сделки и Участник торгов, объявивший Активную Заявку, достигают согласия в отношении:

4.5.4.1. условий, содержащихся в Заявке, зарегистрированной в Реестре Заявок, по состоянию на начало переговоров по заключению сделки;

4.5.4.2. условий, определяющих порядок исполнения обязательств;

4.5.4.3. иных условий, высказанных Инициатором сделки,

то,

4.5.4.4. Участник торгов, объявивший Активную Заявку, обязан удалить данную Заявку в течение 1 минуты с момента достижения согласия по указанным выше условиям;

4.5.4.5. в течение 10 минут с момента достижения согласия по указанным выше условиям Участник торгов - продавец, обязан объявить адресную Заявку на продажу согласованного количества ценных бумаг на согласованных условиях;

4.5.4.6. в течение 10 минут с момента достижения согласия по указанным выше условиям Участник торгов - покупатель, обязан объявить встречную адресную Заявку на покупку согласованного количества ценных бумаг на согласованных условиях.

4.5.5. Ссылка Участника Торгов, объявившего Активную Заявку в Системе торгов, в момент начала переговоров с Инициатором сделки на факт заключения с другим Участником торгов сделки по данной Заявке и на отсутствие у него в связи с этим достаточного времени на изменение условий своей Активной Заявки допускается только при подтверждении Контролером Биржи факта регистрации соответствующей сделки. Для подтверждения Контролером Биржи факта заключения сделки необходимо, чтобы в объявленной Активной Заявке и зарегистрированной сделке совпали следующие параметры:

4.5.5.1. код Участника торгов;

4.5.5.2. код ценной бумаги;

4.5.5.3. направление сделки.

4.5.6. При заключении сделок Участники торгов могут осуществлять звукозапись переговоров, а также запись переговоров с помощью функции Communications Рабочей станции. Такие записи рассматриваются Участниками торгов в качестве подтверждения факта достижения согласия о заключении сделки. Запись переговоров с помощью функции Communications Рабочей станции ведется средствами Системы торгов.

4.5.7. Если иное не установлено настоящими Правилами или соглашением сторон, очередность оплаты и перерегистрации ценных бумаг определяется Участником торгов, не являющимся Инициатором сделки.

4.5.8. Участник торгов, не являющийся Прайм-брокером, вправе отказаться от заключения сделки с Участником торгов, являющимся Прайм-брокером, на предложенных последним условиях, если по ранее заключенным между ними сделкам на общую сумму не менее 200 тысяч долларов США обязательства не исполнены или не прекращены иным способом.

4.5.9. Участник торгов, являющийся Прайм-брокером, вправе отказаться от заключения сделки с акциями с Участником торгов, являющимся Прайм-брокером, если по ранее заключенным между ними сделкам с акциями на общую сумму не менее 500 тысяч долларов США обязательства не исполнены или не прекращены иным способом.

4.5.10. Участник торгов, являющийся Прайм-брокером, вправе отказаться от заключения сделки с акциями с Участником торгов, не являющимся Прайм-брокером, если по ранее заключенным между ними сделкам на общую сумму не менее 50 тысяч долларов США обязательства не исполнены или не прекращены иным способом.

4.5.11. При заключении путем переговоров сделки с ценными бумагами эмитента (управляющей компании паевых инвестиционных фондов, управляющего ипотечным покрытием), перечень которых, утвержден Биржей, а также при заключении сделки, предусматривающей расчеты в российских рублях, любой из Участников торгов, намеренный заключить сделку на согласованных условиях, вправе потребовать исполнения обязательств по такой сделке на условиях «поставка против платежа».

4.5.12. Участник торгов вправе отказаться от исполнения обязательств по сделке на условиях «поставка против платежа». При этом Участник торгов, ведущий переговоры о заключении сделки с Участником торгов, отказавшимся от исполнения обязательств на условиях «поставка против платежа», вправе выбирать очередность исполнения обязательств по оплате и перерегистрации ценных бумаг. При этом срок оплаты и перерегистрации ценных бумаг устанавливается в соответствии с настоящим Разделом Правил.

4.5.13. Если Участники торгов отказались от заключения сделки на условиях «поставка против платежа», условия исполнения обязательств по оплате и перерегистрации ценных бумаг определяются в соответствии с настоящими Правилами.

4.5.14. При заключении сделок путем переговоров не допускается объявление Заявок, допускающих частичное исполнение.

Подраздел 4.6. Заключение сделок электронным способом

4.6.1. Сделка заключается электронным способом посредством объявления адресной Заявки, встречной по отношению к безадресной Активной Заявке и содержащей ссылку на Идентификационный номер данной Заявки.

4.6.2. В случае если значение Резервного количества ценных бумаг, указанного в Активной Заявке, равно нулю, то:

4.6.2.1. при частичном исполнении Активной Заявки значение Основного количества ценных бумаг уменьшается на количество ценных бумаг, в отношении которых была заключена сделка;

4.6.2.2. при полном исполнении Активная Заявка удаляется.

4.6.3. В случае если значение Резервного количества ценных бумаг, указанного в Активной Заявке, не равно нулю, то при частичном или полном исполнении этой Заявки значения Основного количества ценных бумаг и Резервного количества ценных бумаг в Активной Заявке после такого исполнения определяются по следующим правилам:

Если количество ценных бумаг, в отношении которых была заключена сделка, меньше Резервного количества ценных бумаг до заключения сделки, то Резервное количество ценных бумаг в Активной Заявке уменьшается на количество ценных бумаг, в отношении которых была заключена сделка, при этом Основное количество ценных бумаг остается неизменным;

Если количество ценных бумаг, в отношении которых была заключена сделка, больше или равно Резервному количеству ценных бумаг до заключения сделки, то значение Резервного количества ценных бумаг в Активной Заявке становится равным нулю, а значение Основного количества ценных бумаг определяется по следующей формуле;

$$Q2 = Q + R - T, \text{ где}$$

Q2 - Основное количество ценных бумаг после заключения сделки;

Q - Основное количество ценных бумаг, указанных в Активной Заявке до заключения сделки;

R - Резервное количество ценных бумаг, указанных в Активной Заявке до заключения сделки;

T - Количество ценных бумаг, в отношении которых была заключена сделка.

4.6.4. Маклер имеет право временно приостановить возможность заключения сделок электронным способом для всех Участников торгов одновременно в случае возникновения технического сбоя в Системе торгов.

4.6.5. Сведения об условиях перерегистрации ценных бумаг во исполнение сделок на основании Заявок вносятся в Реестр сделок с соблюдением следующих правил:

- если Заявка в поле «Условия перерегистрации ценных бумаг» содержит символ **«P»**, в Реестр сделок вносится символ **«PVD»**;
- если Заявка в поле «Условия перерегистрации ценных бумаг» содержит символ **«D»**, в Реестр сделок вносится символ **«DCC»**;
- если Заявка в поле «Условия перерегистрации ценных бумаг» содержит число, соответствующее поле Реестра сделок не заполняется.

Подраздел 4.7. Порядок сверки сделок

4.7.1. Сделки, заключенные Участниками торгов в Секторе рынка Classica, за исключением случаев, установленных настоящими Правилами, подлежат письменному оформлению в соответствии с Порядком письменного оформления сделок, заключенных в Секторе рынка Classica, являющимся Приложением №17 к настоящим Правилам (далее –

Порядок письменного оформления заключенных сделок). Исполнение обязательств по договорам купли-продажи осуществляется в срок, определенный договорами.

4.7.2. Сверка сделок, заключенных в Секторе рынка Classica, производится Участниками торгов в процессе письменного оформления договора купли-продажи в соответствии с Порядком письменного оформления заключенных сделок.

4.7.3. Сделки, заключенные в Секторе рынка Classica, в отношении которых в Реестре сделок в поле «Условия перерегистрации ценных бумаг» содержится символ «RTS», не оформляются письменно в соответствии с Порядком письменного оформления заключенных сделок. Обязательство по оформлению такой сделки прекращается по истечении 3 (трех) Рабочих дней с даты исполнения, указанной при регистрации сделки.

Подраздел 4.8. Обеспечение исполнения обязательств по сделкам в Секторе рынка Classica

4.8.1. Если Участник торгов подписывает договор от имени третьего лица, он обязан заключить со своим контрагентом договор поручительства, обеспечивающего исполнения обязательств данного третьего лица по договору.

4.8.2. В договоре поручительства поручителем является Участник торгов, подписывающий договор от имени третьего лица, должником – третье лицо, кредитором – контрагент, предъявляющий требование о заключении договора поручительства.

4.8.3. Договор поручительства оформляется как единый документ с договором купли-продажи.

4.8.4. Подготовка договора поручительства осуществляется в соответствии с типовой формой, одновременно с подготовкой договора купли-продажи.

Подраздел 4.9. Порядок исполнения сделок в Секторе рынка Classica

4.9.1. Сделки, заключенные в Режиме неанонимной торговли, исполняются на условиях «поставка против платежа» или на иных условиях, определенных Участниками торгов, заключившими сделку, в соответствии с настоящими Правилами.

4.9.2. Если в Реестре сделок в отношении данной сделки поле «Условия перерегистрации ценных бумаг» содержит символ «PVD», то сделка подлежит исполнению на условиях «поставка против платежа» в соответствии с Правилами клиринга.

4.9.3. Участник торгов, подавший Заявку, содержащую в поле «Условия перерегистрации ценных бумаг» символ «D» или число, обязан предоставить Бирже отчет об исполнении такой сделки. Под отчетом об исполнении сделки в целях настоящих Правил понимается подтверждение Участником торгов исполнения обязательств контрагентом стороны по сделке, от имени и за счет которой Участник торгов заключил сделку. Отчет об исполнении сделки должен быть предоставлен не позднее 21 (двадцати одного) дня со дня истечения срока исполнения, установленного при заключении сделки.

4.9.4. В случае если в соответствии с Порядком письменного оформления заключенных сделок сделка была оформлена с использованием подсистемы электронного документооборота Биржи отчет об исполнении сделки представляется с использованием подсистемы электронного документооборота Биржи.

4.9.5. В случае если в соответствии с Порядком письменного оформления заключенных сделок сделка была оформлена на бумажном носителе, отчет об исполнении сделки представляется в письменном виде за подписью уполномоченного лица, скрепленной печатью Участника торгов.

4.9.6. В случае непредставления Участником торгов отчета об исполнении сделки в установленный срок Биржа обязана начать проверку соответствующего Участника торгов.

4.9.7. Факты исполнения, неисполнения, ненадлежащего исполнения, изменения условий сделки или ее расторжения, факты исполнения, неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником торгов обязанности по представлению Бирже отчета об исполнении сделки устанавливаются Биржей в ходе проверки.

4.9.8. В случае:

- нарушения Участником торгов установленного срока представления отчета об исполнении сделки два и более раза в течение одного календарного месяца, или
- непредставления Участником торгов отчета об исполнении сделки в течение 60 (шестидесяти) дней со дня истечения срока исполнения, установленного при заключении сделки, или
- представления Участником торгов недостоверной информации об исполнении сделки два и более раза в течение одного календарного месяца, или
- исполнения сделки по цене, отличной от цены, указанной при регистрации сделки Биржей, если такая сделка является рыночной в соответствии требованиями законов и иных нормативных правовых актов Российской Федерации, или
- расторжения сделки после ее регистрации Биржей, если такая сделка является рыночной в соответствии требованиями законов и иных нормативных правовых актов Российской Федерации,

Биржа принимает меры в соответствии с Правилами допуска.

Подраздел 4.10. Особые условия перерегистрации ценных бумаг

4.10.1. Если в поле «Условия перерегистрации ценных бумаг» Заявки указан символ «D», а код ценной бумаги содержит указание на эмитента (управляющую компанию паевых инвестиционных фондов, управляющего ипотечным покрытием), включенного в Перечень, Участник торгов - покупатель вправе потребовать перерегистрацию ценных бумаг на свой счет в реестре владельцев ценных бумаг. В таком случае Участник торгов - продавец вправе потребовать от Участника торгов - покупателя компенсации связанных с этим расходов. Сумма компенсации определяется путем переговоров до заключения сделки и включается в сумму сделки. В случае недостижения согласия о размере компенсации сделка считается не заключенной.

4.10.2. В случае если перерегистрация ценных бумаг осуществляется со счета депо в РДО или на счет депо в РДО, и такая перерегистрация ведет к необходимости осуществления операций в реестре владельцев ценных бумаг, сторона, права которой на ценные бумаги учитываются в таком депозитарии, обязана возместить другой стороне дополнительные расходы, связанные с проведением операций в реестре владельцев ценных бумаг.

Подраздел 4.11. Отчеты о сделках с ценными бумагами

4.11.1. Биржа каждый Торговый день формирует отчеты о сделках с ценными бумагами, заключенных Участниками торгов на Торгах в Секторе рынка Classica.

4.11.2. Отчет о сделках Участника торгов, заключенных в Секторе рынка Classica содержит следующие сведения:

4.11.2.1. идентификационный номер сделки;

4.11.2.2. дату и время регистрации сделки в Реестре сделок;

4.11.2.3. совокупность прав и обязанностей по сделке купли-продажи ценных бумаг (покупка ценных бумаг или продажа ценных бумаг);

4.11.2.4. код Участника торгов, которому была адресована Заявка, на основании которой заключена сделка (указывается, если сделка заключена на основании адресных Заявок);

4.11.2.5. код ценных бумаг, являющихся предметом сделки, наименование эмитента (название паевого инвестиционного фонда и наименование его управляющей компании, индивидуальное обозначение, идентифицирующее ипотечные сертификаты участия, и наименование управляющего ипотечным покрытием), вид, категорию (тип), серию ценной бумаги, являющейся предметом сделки, а для российских депозитарных расписок дополнительно указываются: вид представляемых ценных бумаг; наименование эмитента представляемых ценных бумаг; соотношение одной российской депозитарной расписки и количества представляемых ценных бумаг, право собственности на которые удостоверяется одной российской депозитарной распиской данного выпуска;

4.11.2.6. цену одной ценной бумаги;

4.11.2.7. сумму сделки (при этом сумма сделки округляется по правилам математического округления до второго десятичного знака, но не менее 0,01);

4.11.2.8. количество ценных бумаг;

4.11.2.9. дату проведения расчетов по сделке.

4.11.3. Отчеты о сделках, заключенных Участником торгов, предоставляются Участнику торгов через Рабочую станцию в режиме реального времени. Отчет о сделке считается предоставленным Участнику торгов в момент регистрации сделки в Реестре сделок.

4.11.4. Реестр сделок, заключенных Участником торгов в течение Торгового дня, представляет собой совокупность сведений, содержащихся в отчетах о всех таких сделках, и считается предоставленным Участнику торгов с момента предоставления ему указанных отчетов.

ПРИЛОЖЕНИЕ №1

**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»**

**Порядок приостановки и возобновления торгов при наступлении ситуаций,
определенных законами и иными нормативными правовыми актами Российской
Федерации.**

1. Торги на Бирже приостанавливаются при наступлении условий, являющихся основанием для приостановки/прекращения торгов в соответствии с требованиями законов и иных нормативных правовых актов Российской Федерации, за исключением случаев, когда в соответствии с положениями законов и иных нормативных правовых актов Российской Федерации и решением Биржи вместо приостановки торгов Биржа вправе осуществлять торги путем проведения дискретного аукциона. Проведение дискретного аукциона осуществляется в порядке, установленном в п. 2.6.6. и/или п. 2.22.7. настоящих Правил. Сообщение о приостановке торгов направляется Участникам торгов средствами Системы торгов. Биржа принимает решение о приостановке торгов инвестиционными паями биржевого паевого инвестиционного фонда в случае изменения конъюнктуры организованных (регулируемых) рынков или изменения прочих рыночных условий, способных существенно повлиять на возможность Участника торгов, являющегося Маркет-мейкером по инвестиционным паям такого биржевого паевого инвестиционного фонда, исполнить обязательства маркет-мейкера.

2. 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%.

3. В случае приостановки торгов в соответствии с п. 1. настоящего Приложения к Правилам торги возобновляются по истечении периода времени, установленного законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации, за исключением случаев, предусмотренных законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации, когда торги возобновляются на основании распоряжения Центрального банка Российской Федерации.

4. В случае приостановки торгов в соответствии с п. 1. настоящего Приложения к Правилам в Центральный банк Российской Федерации незамедлительно направляется сообщение о факте приостановки торгов на Бирже, а также не позднее следующего рабочего дня справка обо всех случаях приостановления (прекращения) торгов, содержащее сведения, предусмотренные законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

5. При наступлении ситуации ценовой нестабильности ценной бумаги торги отдельной ценной бумагой могут быть приостановлены во всех Режимх торгов/Секторах рынка, либо в отдельном Режиме торгов/Секторе рынка по решению Биржи. При этом все неудовлетворенные заявки, поданные в соответствующих Режимх торгов/Секторе рынка и находящиеся в Системе торгов на момент приостановки торгов, удаляются из Системы торгов. Торги ценной бумагой возобновляются по истечении периода приостановки, если Биржей не будет принято иное решение.

6. Торги отдельной ценной бумагой могут быть приостановлены во всех Режимх торгов/Секторах рынка, либо в отдельном Режиме торгов/Секторе рынка по решению Биржи в случае выявления нарушений, указанных в п. 1.9.3. настоящих Правил. При этом все неудовлетворенные заявки, поданные в соответствующих Режимх торгов/Секторах рынка и находящиеся в Системе торгов на момент приостановки торгов, удаляются из Системы торгов. Торги ценной бумагой возобновляются по истечении периода приостановки, если Биржей не будет принято иное решение.

ПРИЛОЖЕНИЕ №2
к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»
Основная (Дополнительная) торговая сессия

Форма выписки из реестра сделок

День недели, дата
ЗАО «ФБ ММВБ»
Участник торгов (Код Участника торгов)
Идентификатор Участника торгов
Режим торгов
Ценная бумага (Список ценных бумаг)
Номинальная стоимость(непогашенная часть основного долга)
Номер торгово-клирингового счета

№ п/п	Номер сделки	Время	Вид сделки	Цена	Количество	Объем	Контрагент (Код Участника торгов-контрагента)	Номер торгово-клирингового счета контрагента	Код расчетов	Комиссионное вознаграждение	Номер заявки	Вид заявки	НКД	Ставка РЕПО	Сумма РЕПО, включая НКД	Начальное значение дисконта, %	Срок РЕПО	Минимальное предельное значение дисконта	Максимальное предельное значение дисконта	Ставка фикс. Возмещения	Ссылка	Приоритет подбора ценных бумаг	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

Маклер ЗАО «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 ОАО Московская Биржа в соответствии с документами, определяющими ее правовой статус и порядок разрешения споров, действующими на момент подачи искового заявления. Решения Арбитражной комиссии при ОАО Московская Биржа являются окончательными и обязательными для исполнения. Неисполненное добровольно решение Арбитражной комиссии при ОАО Московская Биржа 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 (размещение денежных средств для сделок РЕПО с Центральным контрагентом), S – продажа (привлечение денежных средств для сделок РЕПО с Центральным контрагентом));
 Колонка 5 – Цена одной бумаги (с учетом особенностей, определенных п. 1.15.13. настоящих Правил);
 Колонка 6 – Количество бумаг (шт);
 Колонка 7 – Объем сделки (с учетом особенностей, определенных п. 1.15.13. настоящих Правил);
 Колонка 8 – Код участника торгов или Центрального контрагента, краткое наименование, ИНН контрагента;
 Колонка 9 – Номер торгового-клирингового счета контрагента;
 Колонка 10 – Код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п.п. 1.1.1.20 настоящих Правил торгов), либо тип 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 (в соответствии с п. 2.1.6. настоящих Правил)(в соответствии с п. 2.1.8. настоящих Правил вид заявки указывает на то, что заявка адресована конкретному Участнику торгов либо всем Участникам торгов);
 Колонка 14 – НКД;
 Колонка 15 – Ставка РЕПО (для сделок РЕПО);
 Колонка 16 – Сумма РЕПО, включая НКД;
 Колонка 17 – Начальное значение дисконта (Дисконт для заявок РЕПО (ЦК)), %;
 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 – Приоритет подбора ценных бумаг (для адресных заявок РЕПО (корзина))
 Колонка 24 – Код клиента;
 Колонка 25 – Примечание.

ПРИЛОЖЕНИЕ №3
к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»
Основная (Дополнительная) торговая сессия

Форма выписки из реестра заявок

День недели, дата
ЗАО «ФБ ММВБ»
Участник торгов (Код Участника торгов)
Идентификатор Участника торгов
Режим торгов
Дата регистрации заявки
Дата и/или время активации

№ п/п	Номер заявки	Номер совокупной заявки	Состояние	Вид заявки	Направленность	Ценная бумага	Цена	Количество	Номер торгово-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	АСП Участника торгов	Ставка фикс. Возмещения	Ссылка	Приоритет подбора ценных бумаг	Клиент	Частичное обеспечение/отсутствующее	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.	28.	29.	30.

Маклер ЗАО «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 ОАО Московская Биржа в соответствии с документами, определяющими ее правовой статус и порядок разрешения споров, действующими на момент подачи искового заявления. Решения Арбитражной комиссии при ОАО Московская Биржа являются окончательными и обязательными для исполнения. Неисполненное добровольно решение Арбитражной комиссии при ОАО Московская Биржа 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 – Номер совокупной заявки РЕПО (ЦК) (для лимитных заявок, зарегистрированных путем подачи совокупной заявки РЕПО (ЦК));

Колонка 4 – Состояние заявки (М-заявка удовлетворена, W-заявка отозвана Участником торгов, С-заявка снята Системой торгов, О-заявка не удовлетворена и не отозвана/снята, F-заявка отклонена контрагентом);

Колонка 5 – Вид заявки (в соответствии с п. 2.1.6. настоящих Правил)(в соответствии с п. 2.1.8. настоящих Правил вид заявки указывает на то, что заявка адресована конкретному Участнику торгов либо всем Участникам торгов);

Колонка 6 – Направленность заявки (покупка (размещение денежных средств для заявок РЕПО (ЦК))/продажа (привлечение денежных средств для заявок РЕПО (ЦК));

Колонка 7 – Ценная бумага (Список ценных бумаг);

Колонка 8 – Цена за одну ценную бумагу, с учетом особенностей, определенных п. 1.15.13. настоящих Правил, либо цена-ограничитель, в случае если заявка подана в Режиме торгов крупными пакетами ценных бумаг;

Колонка 9 – Количество ценных бумаг, выраженное в лотах / Видимое количество ценных бумаг, выраженное в лотах, либо расчетное количество ценных бумаг (для заявок, поданных с указанием объема денежных средств, предназначенных для покупки ценных бумаг);

Колонка 10 – Торгово-клиринговый счет, указанный при подаче заявки в Систему торгов

Колонка 11 – Идентификатор, код участника торгов-контрагента (для заявок, адресованных конкретному Участнику торгов) либо код Участника торгов, заявка которого может быть признана допустимой встречной (в случае подачи адресной заявки на заключение сделки на условиях централизованного клиринга);

Колонка 12 – Время регистрации заявки в Системе торгов;

Колонка 13 – Время исполнения заявки;

Колонка 14 – Время отзыва/снятия заявки;

Колонка 15 – Код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п. 1.1.1.20. настоящих Правил торгов), либо тип расчетов;

Колонка 16 – НКД;

Колонка 17 – Количество сделок, заключенных на основании заявки;

Колонка 18 – Ставка РЕПО, %;

Колонка 19 – Сумма РЕПО, включая НКД.;

Колонка 20 – Начальное значение дисконта (Дисконт, для заявок РЕПО (ЦК)), %;

Колонка 21 – Срок РЕПО;

Колонка 22 – Минимальное предельное значение дисконта;

Колонка 23 – Максимальное предельное значение дисконта;

Колонка 24 – АСП Участника торгов, подавшего заявку;

Колонка 25 – Ставка фиксированного возмещения, %;

Колонка 26 – Ссылка;

Колонка 27 – Приоритет подбора ценных бумаг (для адресных заявок РЕПО (корзина));

Колонка 28 – Код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг));

Колонка 29 – Заполняется в случае указания дополнительного реквизита заявки «Частичное обеспечение/отступное», в соответствии с п. 2.1.14.6. настоящих Правил;

Колонка 30 – 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

ЗАО «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	АСП Участника торгов	Ставка фикс.возмещения	Ссылка	Приоритет подбора ценных бумаг	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

Маклер ЗАО «ФБ ММВБ»

(подпись)

Колонка 1 – Номер по порядку;	Колонка 13 – Код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п.п. 1.1.1.20. настоящих Правил торгов);
Колонка 2 – Номер заявки в Системе торгов;	Колонка 14 – НКД;
Колонка 3 – Состояние заявки (М-заявка удовлетворена, W-заявка отозвана Участником торгов, С-заявка снята Системой торгов, О-заявка не удовлетворена и не отозвана/снята, F-заявка отклонена контрагентом);	Колонка 15 – Количество сделок, заключенных на основании заявки;
Колонка 4 – Вид заявки;	Колонка 16 – Ставка РЕПО, %;
Колонка 5 – Направленность заявки (покупка/продажа);	Колонка 17 – Сумма РЕПО, включая НКД;
Колонка 6 – Ценная бумага (Список ценных бумаг);	Колонка 18 – Начальное значение дисконта (Дисконт для заявок РЕПО (ЦК)), %;
Колонка 7 – Цена за одну ценную бумагу, с учетом особенностей, определенных п. 1.15.13. настоящих Правил;	Колонка 19 – Срок РЕПО;
Колонка 8 – Количество ценных бумаг, выраженное в лотах, либо расчетное количество ценных бумаг (для заявок, поданных с указанием объема денежных средств, предназначенных для покупки ценных бумаг);	Колонка 20 – Минимальное предельное значение дисконта;
Колонка 9 – Идентификатор, код участника торгов-контрагента;	Колонка 21 – Максимальное предельное значение дисконта;
Колонка 10 – Время регистрации заявки в Системе торгов;	Колонка 22 – АСП Участника торгов, подавшего заявку;
Колонка 11 – Время исполнения заявки;	Колонка 23 – Ставка фиксированного возмещения, %;
Колонка 12 – Время отзыва/снятия заявки;	Колонка 24 – Ссылка;
	Колонка 25 – Приоритет подбора ценных бумаг (для адресных заявок РЕПО (корзина))
	Колонка 26 – Примечание

ПРИЛОЖЕНИЕ №4
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

ЗАО «ФБ ММВБ»

Участник торгов (Код Участника торгов)

Идентификатор Участника торгов

Наименование возмещения	Обязательство по уплате возмещения	Ставка фиксированного возмещения	Цена переменного возмещения	Номер сделки	Идентификатор Участника торгов контрагента

Маклер ЗАО «ФБ ММВБ»

(подпись)

ПРИЛОЖЕНИЕ №5
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 ЗАО «ФБ ММВБ», в лице _____,
действующего на основании _____, уведомляет ЗАО «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 №6
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
ЗАО «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	Текущий дефицит маржи (в валюте, в которой заключена сделка РЕПО)	Допустимый уровень переоценки (в валюте, в которой заключена сделка РЕПО)	Сумма денежных средств (в валюте, в которой заключена сделка РЕПО), которые необходимо внести/получить	Количество ценных бумаг (в штуках), которые необходимо внести/получить	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.	17.	18.

Маклер ЗАО «ФБ ММВБ»

(подпись)

*при условии внесения компенсационного взноса

Колонка 1 – Номер по порядку;
Колонка 2 – Номер сделки РЕПО, по которой должен быть внесен/получен Компенсационный взнос, в Системе торгов;
Колонка 3 – Дата заключения сделки РЕПО, по которой должен быть внесен/получен Компенсационный взнос;
Колонка 4 – Дата внесения/получения Компенсационного взноса;
Колонка 5 – Вид операции (D- списание, K – зачисление);
Колонка 6 – Текущее значение дисконта;
Колонка 7 – Максимальное (или минимальное) предельное значение дисконта, которое было превышено;
Колонка 8 – Текущий дефицит маржи (в валюте, в которой заключена сделка РЕПО);
Колонка 9 – Допустимый уровень переоценки (в валюте, в которой заключена сделка РЕПО);
Колонка 10 – Сумма денежных средств (в валюте, в которой заключена сделка РЕПО), которые необходимо внести/получить;
Колонка 11 – Количество ценных бумаг (в штуках), которые необходимо внести/получить;
Колонка 12 – Расчетное значение текущего дисконта при условии внесения компенсационного взноса;

Колонка 13 – Расчетное значение суммы РЕПО (если он производится в денежной форме) при условии внесения компенсационного взноса;
Колонка 14 – Расчетное значение количества ценных бумаг по второй части сделки РЕПО* (если он производится в форме ценных бумаг) при условии внесения компенсационного взноса;
Колонка 15 – Расчетное значение цены за одну ценную бумагу по второй части сделки РЕПО (цены выкупа) при условии внесения компенсационного взноса, при условии ее расчета (с учетом особенностей, определенных п. 1.15.13. настоящих Правил);
Колонка 16 – Торгово-клиринговый счет (указанный при подаче заявки на заключение соответствующей сделки РЕПО), с которого должна произойти поставка (выплата) компенсационного взноса;
Колонка 17 – Код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг));
Колонка 18 – Код (краткое наименование) Участника торгов – контрагента по сделке РЕПО.

ПРИЛОЖЕНИЕ №6А
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

ЗАО «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	Размер компенсационного взноса*	Текущее значение суммы РЕПО	Текущее значение стоимости обратного выкупа	Значение расчетных параметров сделки с учетом выплаты дохода		Значение расчетных параметров сделки с учетом выплаты дохода и уплаты компенсационного взноса*		Сумма выплаченного эмитентом дохода, подлежащая передаче	Валюта передаваемого дохода*	Код клиента
									Сумма РЕПО	Стоимость обратного выкупа	Сумма РЕПО	Стоимость обратного выкупа			
1	2	3	4	5	6	7	8	8	10	11	12	13	14	15	16

Маклер ЗАО «ФБ ММВБ»

Колонка 1 – Номер по порядку;

Колонка 2 – Номер сделки РЕПО, по облигациям которой, выплачивается купонный доход;

Колонка 3 – Дата заключения сделки РЕПО, по облигациям которой, выплачивается купонный доход/амортизационная выплата;

Колонка 4 – Дата, с которой изменяется Сумма РЕПО;

Колонка 5 – Величина погашенной части основного долга (амортизационной выплаты), в валюте, в которой заключена сделка РЕПО.;

Колонка 6 – Размер купонного дохода, в валюте, в которой заключена сделка РЕПО.;

Колонка 7 – Размер компенсационного взноса в денежной форме (заполняется в случае наличия компенсационного взноса подлежащего уплате в дату выплаты купонного дохода/амортизационной выплаты), в валюте, в которой заключена сделка РЕПО;*

Колонка 8 – Сумма РЕПО до получения купонного дохода по облигациям, в валюте, в которой заключена сделка РЕПО;

Колонка 9 – Стоимость обратного выкупа до получения купонного дохода по облигациям, в валюте, в которой заключена сделка РЕПО;

Колонка 10 – Сумма РЕПО после получения дохода по облигациям, в валюте, в которой заключена сделка РЕПО;

Колонка 11 – Стоимость обратного выкупа после получения дохода по облигациям, в валюте, в которой заключена сделка РЕПО;

Колонка 12 – Сумма РЕПО после получения дохода по облигациям и в случае исполнения обязательств по уплате компенсационного взноса, в валюте, в которой заключена сделка РЕПО;*

Колонка 13 – Стоимость обратного выкупа после получения дохода по облигациям и в случае исполнения обязательств по уплате компенсационного взноса, в валюте, в которой заключена сделка РЕПО;*

Колонка 14 - Сумма выплаченного эмитентом дохода, подлежащая передаче покупателем по первой части РЕПО продавцу по первой части РЕПО, согласно п. 2.9.11. настоящих Правил.*

Колонка 15 – Валюта, в которой передается доход;*

Колонка 16 – Код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг)).

* - расчет и предоставление показателей осуществляется по решению Биржи.

ПРИЛОЖЕНИЕ №7

к Правилам проведения торгов по ценным бумагам в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»

Форма сводного реестра заявок

День недели, дата

ЗАО «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 расчетов	НКД	Клиент	Ссылка	Примечание	Дополнительная информация	Доходность	Итого бумаг (нарастающим итогом)	Итого объем (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 ЗАО «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;

Колонка 6 – Направленность заявки (покупка/продажа);

Колонка 7 – Цена за одну ценную бумагу;

Колонка 8 – Количество ценных бумаг, выраженное в лотах, либо расчетное количество ценных бумаг (для заявок, поданных с указанием объема денежных средств, предназначенных для покупки ценных бумаг);

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. 1.1.1.20. настоящих 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 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 №7А
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
ЗАО «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, в валюте, в которой заключена сделка РЕПО	Объем заявок нарастающим итогом, в в валюте, в которой заключена сделка РЕПО	Сумма обязательств по 2 части сделки РЕПО, в валюте, в которой заключена сделка РЕПО	Средневзвешенная ставка РЕПО, %

Итого
Количество Участников торгов
Количество заявок

Маклер ЗАО «ФБ ММВБ» **(подпись)**

ПРИЛОЖЕНИЕ №8
к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»

Форма сводного реестра заявок (Тип № 2)

Дата формирования

ЗАО «ФБ ММВБ»

Торговый код ценной бумаги

Режим торгов

Дата исполнения

Объявленный объем размещения

Доля неконкурентных заявок по отношению к общему объему заявок, поданных Участником торгов

Заявка			Конкурентные заявки, поданные на аукционе		Неконкурентные заявки, подлежащие удовлетворению		Конкурентные и неконкурентные заявки, подлежащие удовлетворению.		Цена удовлетворения неконкурентных заявок	
Цена, в % от номинала	Доходность, в % годовых	Кол-во конкурентных заявок, шт.	Сумма к погашению, (нарастающим итогом), руб	Сумма выручки (нарастающим итогом), руб	Сумма к погашению, руб	Сумма выручки, руб	Сумма к погашению, (нарастающим итогом), руб	Сумма выручки (нарастающим итогом), руб	Цена, в % от номинала	Доходность, в % годовых

Данные рассчитаны с учетом объявленного объема размещения

--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

Данные рассчитаны без учета объявленного объема размещения

--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

Маклер ЗАО «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 уплате возмещения	“В”	Текстовый формат	Приложение № 4 к настоящим Правилам
5. Уведомление Участника торгов о необходимости внесении компенсационного взноса	“В”	Текстовый формат	Приложение № 6 к настоящим Правилам
6. 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 № 6А к настоящим Правилам
7. Сводный реестр заявок	“В”	Текстовый формат	Приложение № 7 к настоящим Правилам
8. Сводный реестр заявок (Аукцион РЕПО)	“В”	Текстовый формат	Приложение № 7А к настоящим Правилам
9. Сводный реестр заявок (Тип № 2)	“В”	Текстовый формат	Приложение № 8 к настоящим Правилам
10. Уведомление об ошибке	“В”	Текстовый формат	Приложение № 10 к настоящим Правилам
11. Запрос на активацию идентификатора после исправления ошибки программного обеспечения	“В”	Текстовый формат	Приложение № 10А 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 №10А
к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»

Форма запроса на активацию идентификатора после исправления ошибки
программного обеспечения

Настоящим уведомляем, что (дата) в программном обеспечении, использовавшемся для подачи заявок и заключения сделок с использованием Торгового идентификатора (Наименование Участника торгов, Торговый идентификатор), была устранена ошибка, приводящая к нарушению критериев, установленных п. 1.4.3. Правил проведения торгов по ценным бумагам в ЗАО «Фондовая биржа ММВБ».

Программное обеспечение протестировано и введено в эксплуатацию с (дата, время).

Прошу возобновить возможность осуществления операций в Системе торгов ЗАО «Фондовая биржа ММВБ» с использованием Торгового идентификатора (Торговый идентификатор).

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	Видимое количество ценных бумаг, выраженное в лотах
8	Цена за одну ценную бумагу
9	Торгово-клиринговый счет
10	Код расчетов
11	Время активации заявки (для лимитных заявок на продажу в Режиме торгов «Размещение: Аукцион»)
12	Дата активации (для заявок в Режиме торгов «Размещение: Аукцион», «Выкуп: Аукцион»)
13	Краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг))
14	АСП Участника торгов

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 за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг))
11	АСП Участника торгов

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 Режимх торгов «Размещение: Аукцион», «Выкуп: Аукцион»)
10	Краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг))
11	АСП Участника торгов

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-В30)
11	Торгово-клиринговый счет
12	Код расчетов
13	Краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг))
14	АСП Участника торгов

Заявка КП

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (заявка КП)
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	Направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу)
6	Наименование ценной бумаги
7	Количество ценных бумаг, выраженное в лотах
8	Торгово-клиринговый счет
9	Код расчетов
10	Краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг))
11	АСП Участника торгов

Адресная заявка РЕПО (акции)

№ 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 валюте, в которой заключается сделка РЕПО)
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 за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг))
19	АСП Участника торгов

Адресная заявка РЕПО (облигации)

№ 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 за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг))

19	АСП Участника торгов
----	----------------------

Адресная заявка РЕПО (корзина)

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (адресная заявка РЕПО (облигации));
2	Идентификатор Участника торгов, подавшего заявку;
3	Краткое наименование Участника торгов, подавшего заявку;
4	Краткое наименование или идентификатор Участника торгов, которому адресована заявка;
5	Направленность заявки (заявка на покупку или заявка на продажу по первой части сделки РЕПО);
6	Ставка РЕПО в процентах годовых;
7	Срок сделки РЕПО (в календарных днях, для внутрисдневной сделки РЕПО срок сделки РЕПО равен нулю);
8	Наименование (код) Списка ценных бумаг;
9	Тип расчетов (DVP1 или DVP3, в соответствии с Правилами клиринга);
10	Сумма РЕПО, включая НКД;
	АСП Участника торгов.

Безадресная заявка на заключение сделок в Режиме «Размещение: Адресные заявки»

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (безадресная заявка Режим «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	АСП Участника торгов

Адресная заявка на заключение сделок в Режиме «Размещение: Адресные заявки»

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (адресная заявка Режим «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, или объем денежных средств, предназначенных для покупки ценных бумаг (включая НКД на Дату исполнения и комиссионное вознаграждение)
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 за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг))
14	Дата активации заявки

15	АСП Участника торгов
----	----------------------

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	АСП Участника торгов

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 за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг))
14	Дата активации заявки
15	АСП Участника торгов

Лимитная заявка РЕПО (ЦК)

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (лимитная заявка РЕПО (ЦК))
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 привлечение денежных средств или заявка на размещение денежных средств);
5	Наименование ценной бумаги;
6	Количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
7	Сумма РЕПО;
8	Ставка РЕПО (минимальная ставка размещения/максимальная ставка привлечения денежных средств);
9	Код расчетов (Y0/Y1, если иной код расчетов не установлен в соответствии с п. 1.1.1.20. настоящих Правил);
10	Дисконт (возможное значение дисконта устанавливается Биржей);
11	Торгово-клиринговый счет;

12	Краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиентов (в том числе, эмитентов ценных бумаг));
13	АСП Участника торгов.

Совокупная заявка РЕПО (ЦК)

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (совокупная заявка РЕПО (ЦК));
2	Идентификатор Участника торгов;
3	Направленность заявки (заявка на привлечение денежных средств или заявка на размещение денежных средств);
4	Торгово-клиринговый счет;
5	Наименование (код) Списка ценных бумаг
6	Сумма РЕПО;
7	Ставка РЕПО (минимальная ставка размещения/максимальная ставка привлечения денежных средств);
8	АСП Участника торгов.

Рыночная заявка РЕПО (ЦК)

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (рыночная заявка РЕПО (ЦК));
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 привлечение денежных средств или заявка на размещение денежных средств);
5	Наименование ценной бумаги;
6	Количество ценных бумаг, выраженное в лотах;
7	Сумма РЕПО;
8	Торгово-клиринговый счет;
9	Код расчетов (Y0/Y1, если иной код расчетов не установлен в соответствии с п. 1.1.1.20. Настоящих Правил);
10	Дисконт (возможное значение дисконта устанавливается Биржей);
11	Краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиентов (в том числе, эмитентов ценных бумаг));
12	АСП Участника торгов.

Адресная заявка РЕПО (ЦК)

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (адресная заявка РЕПО (ЦК));
2	Идентификатор Участника торгов, подавшего заявку;
3	Код Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки от своего имени и за счет средств, находящихся в доверительном управлении);
4	Краткое наименование Участника торгов, подавшего заявку;
5	Краткое наименование или идентификатор Участника торгов, заявка которого может быть признана допустимой встречной;
6	Направленность заявки (заявка на привлечение или заявка на размещение денежных средств);
7	Ставка РЕПО в процентах годовых;
8	Наименование (торговый код) ценной бумаги либо наименование (код) Списка

	ценных бумаг;
9	Торгово-клиринговый счет;
10	Краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиентов (в том числе эмитентов ценных бумаг));
11	Код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п. 1.1.1.20. Настоящих правил);
12	Дисконт;
13	Сумма РЕПО;
14	Количество ценных бумаг в лотах (для заявок, поданных с указанием наименования (торгового кода) ценной бумаги);
15	АСП Участника торгов;

Лимитная заявка (А3)

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (лимитная заявка (А3));
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	Минимальная цена продажи/максимальная цена покупки за одну ценную бумагу;
8	Торгово-клиринговый счет;
9	Код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п. 1.1.1.20. Настоящих правил);
10	Краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиентов (в том числе, эмитентов ценных бумаг));
11	АСП Участника торгов.

Рыночная заявка (А3)

№ п/п	Реквизиты
1	вид заявки (рыночная заявка (А3) с указанием количества ценных бумаг или рыночная заявка (А3) 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 (который включает НКД на Дату исполнения и комиссионное вознаграждение Биржи, Клиринговой организации и Технического центра);
7	торгово-клиринговый счет;
8	код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п. 1.1.1.20. настоящих Правил);
9	краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиентов (в том числе, эмитентов ценных бумаг));

10	АСП Участника торгов.
----	-----------------------

Заявка ИСК

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (заявка ИСК);
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;
8	Торгово-клиринговый счет;
9	Код расчетов (Т0, если иной код расчетов не установлен в соответствии с п. 1.1.1.20. Настоящих Правил);
10	Краткий код клиента Участника торгов (при подаче Участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиентов (в том числе, эмитентов ценных бумаг));
11	АСП Участника торгов.

Заявка по цене аукциона закрытия

№ п/п	Реквизиты
1	Вид заявки (заявка по цене аукциона закрытия);
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 аукциона закрытия;
8	Торгово-клиринговый счет;
9	Код расчетов (допустимый перечень кодов расчетов по ценной бумаге устанавливается в соответствии с п. 1.1.1.20. настоящих правил);
10	Краткий код клиента участника торгов (при подаче участником торгов заявки на совершение сделки за счет клиентов (в том числе, эмитентов ценных бумаг));
11	АСП участника торгов.

ПРИЛОЖЕНИЕ №12

**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»**

Процедура урегулирования взаимных требований по сделкам

1. Урегулирование вопросов, связанных с выплатой доходов по ценным бумагам, являющимся предметом сделки РЕПО.

1.1. В случае неисполнения эмитентом своих обязательств по выплате доходов (процентного или купонного дохода, частичного погашения части основного долга) или иных выплат в виде денежных средств или другого имущества по ценным бумагам, 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) излишне уплаченных сумм Участниками торгов – сторонами по сделке РЕПО осуществляется в следующем порядке:

1.1.1. Участник торгов - продавец по первой части сделки РЕПО осуществляет возврат излишне уплаченных сумм 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 ненадлежащего исполнения Участником торгов требований, предусмотренных в п. 1.1 настоящего Приложения №12 к Правилам и/или п. 2.9.6.3. – 2.9.6.4. настоящих Правил, 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 или ненадлежащим исполнением обязательств по второй части сделок РЕПО (за исключением случая досрочного погашения облигаций, составляющих предмет обязательств по сделке РЕПО).

2.1. В случае неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником торгов (далее – Нарушившая сторона) обязательств по второй части сделки РЕПО другой Участник торгов, являющийся стороной такой сделки РЕПО (далее – Ненарушившая сторона), вправе по своему выбору:

2.1.1. Требовать от Нарушившей стороны исполнения обязательств по сделке РЕПО. Процедура урегулирования, предусмотренная в п.п. 2.2 настоящего Приложения №12 к Правилам, в этом случае не проводится. До направления уведомления о процедуре урегулирования в соответствии с п.п. 2.2 настоящего Приложения №12 к Правилам Ненарушившая сторона признается требующей от Нарушившей стороны исполнения обязательств по сделке РЕПО.

2.1.2. Требовать проведения процедуры урегулирования взаимных требований в порядке, предусмотренном в п.п. 2.2 настоящего Приложения №12 к Правилам.

2.2. В случае принятия решения Ненарушившей стороной о проведении процедуры урегулирования взаимных требований согласно п.п. 2.1.2 настоящего Приложения №12 к Правилам, Ненарушившая сторона в течение 25 (Двадцати пяти) календарных дней с

Даты исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО направляет Нарушившей стороне уведомление о процедуре урегулирования, содержащее: (а) решение об урегулировании взаимных требований в соответствии с п.п. 2.2 настоящего Приложения №12 к Правилам, (б) информацию о размере остаточных обязательств по сделке РЕПО (включая расчет их суммы), определенных как разница между суммой денежных средств / стоимостью ценных бумаг, не переданных Нарушившей стороной по второй части сделки РЕПО, и стоимостью ценных бумаг / суммой денежных средств, не переданных Ненарушившей стороной по второй части сделки РЕПО. В Режимы торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» и «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» расчет остаточных обязательств осуществляется в порядке, установленном нормативными актами и / или иными актами Банка России.

2.2.1. Остаточные обязательства по сделке РЕПО определяются в денежном выражении.

2.2.2. Сумма остаточных обязательств перечисляется Участником торгов, имеющим положительную величину остаточных обязательств по соответствующей сделке РЕПО.

2.2.3. Сумма остаточных обязательств по сделке РЕПО должна быть перечислена соответствующим Участником торгов не позднее 4 (Четырех) рабочих дней с даты направления уведомления об урегулировании взаимных требований в соответствии с настоящим п.п. 2.2 Приложения №12 к Правилам, но в любом случае не позднее 30 (Тридцати) календарных дней с Даты исполнения второй части соответствующей сделки РЕПО.

2.2.4. После направления уведомления о процедуре урегулирования исполнение обязательств в натуре не допускается, если иное не согласовано сторонами в письменной форме.

2.2.5. В сумму остаточных обязательств по сделке РЕПО Ненарушившая сторона вправе включить невыплаченное Нарушившей стороной переменное и фиксированное возмещение.

2.2.6. Обязательство по уплате суммы, составляющей остаточные обязательства по сделке РЕПО, признается исполненным с момента зачисления соответствующих денежных средств в полном объеме на счет Участника торгов – получателя суммы остаточных обязательств по сделке РЕПО, указанный в уведомлении о процедуре урегулирования.

2.2.7. Ненарушившая сторона вправе по своему усмотрению:

2.2.7.1. Начиная с рабочего дня, следующего за Датой исполнения второй части сделки РЕПО, но в срок, не превышающий 25 (Двадцати пяти) календарных дней с Даты исполнения второй части сделки РЕПО - осуществить продажу в полном объеме ценных бумаг, полученных по первой части сделки РЕПО от Нарушившей стороны, или покупку в полном объеме ценных бумаг, эквивалентных ценным бумагам, переданным по первой части сделки РЕПО Нарушившей стороне, и осуществить расчет суммы остаточных обязательств; или

2.2.7.2. Отказаться от продажи/покупки ценных бумаг, полученных / переданных по первой части сделки РЕПО от Нарушившей стороны, и осуществить расчет суммы остаточных обязательств.

2.3. Для целей расчета остаточных обязательств по сделке РЕПО стоимость ценных бумаг, не переданных по второй части сделки РЕПО, определяется следующим образом по выбору Ненарушившей стороны:

2.3.1. В случае реализации (приобретения) ценных бумаг – как фактическая стоимость реализованных ценных бумаг или как фактическая стоимость приобретенных ценных бумаг, эквивалентных ценным бумагам, переданным по первой части сделки РЕПО. При определении фактической стоимости реализации или приобретения ценных бумаг учитываются также расходы, понесенные Ненарушившей стороной в связи с

заключением и (или) исполнением соответствующих сделок покупки или продажи.

2.3.2. В случае отказа от реализации (приобретения) ценных бумаг Ненарушившая сторона вправе самостоятельно рассчитать величину остаточных обязательств, используя для определения стоимости ценных бумаг расчетную стоимость, определенную на основании среднего арифметического не менее чем 5 (Пяти) котировок Участников торгов, полученных Ненарушившей стороной не ранее, чем за 5 (Пять) рабочих дней до даты направления уведомления о процедуре урегулирования на объем ценных бумаг, соответствующий количеству ценных бумаг, не переданных по второй части сделки РЕПО. При этом Ненарушившая сторона самостоятельно определяет Участников торгов, котировки которых она использует для расчета остаточных обязательств. Также Ненарушившая сторона вправе рассчитать остаточные обязательства самостоятельно, используя в качестве расчетной стоимости ценных бумаг цену Ценового центра НФА на Дату исполнения второй части соответствующей сделки РЕПО, либо расчетную цену ценных бумаг на день, следующий за Датой исполнения второй части сделки РЕПО, либо, при её отсутствии – на дату ближайших торгов, состоявшихся в течение последних 12 месяцев до Даты исполнения второй части данной сделки РЕПО.

Ненарушившая сторона также вправе обратиться за расчетом остаточных обязательств по сделкам РЕПО (за исключением сделок РЕПО, заключенных в Режимах торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» и «РЕПО с Банком России: фикс.ставка») на Биржу. Биржа осуществляет расчет остаточных обязательств, используя в качестве расчетной стоимости ценных бумаг цену Ценового центра НФА на Дату исполнения второй части соответствующей сделки РЕПО, а при ее отсутствии расчетную цену ценных бумаг на день, следующий за Датой исполнения второй части сделки РЕПО, либо, при её отсутствии – на дату ближайших торгов, состоявшихся в течении последних 12 месяцев до Даты исполнения второй части данной сделки РЕПО. По итогам расчета остаточных обязательств Биржа предоставляет Ненарушившей стороне Отчет о величине остаточных обязательств.

2.4. В случае неисполнения обязательств по сделкам РЕПО, которые были включены Ненарушившей стороной в требование о досрочном исполнении сделок РЕПО в соответствии с п.п. 1.13.6. настоящих Правил, остаточные обязательства по таким сделкам суммируются.

3. Урегулирование вопросов, связанных с неисполнением обязательств по второй части сделок РЕПО в случае досрочного погашения облигаций, составляющих предмет обязательств по сделке РЕПО.

3.1. В случае досрочного погашения облигаций, составляющих предмет обязательств по сделке РЕПО, и невозможности исполнения обязательств по сделке РЕПО в Клиринговой системе, в дату досрочного погашения обязательства по второй части сделки РЕПО прекращаются. На дату досрочного погашения контрагенты осуществляют расчет суммы остаточных обязательств путем определения разницы между стоимостью обратного выкупа по сделке РЕПО (с учетом уплаченных/полученных компенсационных взносов и выплат произведенных эмитентом в течение Срока РЕПО до даты досрочного погашения) и стоимостью ценных бумаг, определенной как сумма денежных средств, уплаченных эмитентом в счет досрочного погашения облигаций и иных выплат произведенных эмитентом по облигациям в дату досрочного погашения. Участник торгов вправе обратиться на Биржу за расчетом остаточных обязательств. Биржа вправе произвести расчет остаточных обязательств только в случае наличия у нее информации о величине выплат, произведенных эмитентом. По итогам расчета остаточных обязательств Биржа предоставляет Участнику торгов Отчет о величине остаточных обязательств.

3.2. Сумма остаточных обязательств перечисляется соответствующим контрагентом по сделке РЕПО в течение 30 календарных дней с даты досрочного погашения.

4. Урегулирование вопросов, связанных с неисполнением обязательств по сделкам,

обязательства по которым исполняются путем подачи Отчета на исполнение.

4.1. В случае неисполнения сделок, заключаемых на условиях отсроченного исполнения, по которым Правилами торгов не предусмотрено заполнения реквизита заявки/сделки «фиксированное возмещение», а также по ценным бумагам, по которым не рассчитывается переменное возмещение, Участник торгов, который не исполнил свои обязательства, обязан уплатить своему контрагенту по сделке неустойку в размере двойной ставки рефинансирования Банка России, действующей на день неисполнения указанных требований, начисленной на сумму обязательств по сделке за каждый день просрочки исполнения, если иное не установлено двусторонними соглашениями сторон.

5. Урегулирование вопросов, связанных с выплатой доходов по ценным бумагам и неисполнением обязательств по второй части сделок РЕПО в случае возникновения обстоятельств непреодолимой силы.

5.1. В случае возникновения обстоятельств непреодолимой силы (чрезвычайные и непредотвратимые обстоятельства, возникающие после наступления Даты исполнения сделок), влияющих на способность выполнения Участником торгов требований, предусмотренных в пунктах 1, 2 настоящего Приложения №12 к Правилам и/или п. 2.9.6.3. – 2.9.6.5. настоящих Правил, 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.

5.2. 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 возбуждение процедуры банкротства.

5.3. Неисполнение требования, предусмотренного подпунктом п.5.1. настоящего Приложения №12 к Правилам, лишает Участника торгов, нарушившего данное требование, права ссылаться на обстоятельства непреодолимой силы

5.4. После прекращения действия обстоятельств непреодолимой силы Участники торгов обязаны исполнить требования, предусмотренные в пунктах 1, 2 настоящего Приложения №12 к Правилам и/или п. 2.9.6.3. – 2.9.6.5. настоящих Правил.

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.

ПРИЛОЖЕНИЕ №13

**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 законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

1.2. Текущие цены ценных бумаг рассчитываются по всем ценным бумагам, допущенным к торгам на Бирже.

2. Порядок расчета текущих цен ценных бумаг

2.1. Текущая цена ценной бумаги рассчитывается в течение Основной торговой сессии и Дополнительной торговой сессии не реже одного раза в минуту в течение времени проведения торгов в Режимх торгов/Секторах рынка, проводимых на основании заявок, адресованных всем участникам торгов (далее – безадресные заявки), начиная с десятой минуты после начала проведения торгов в соответствующем Режиме торгов/Секторе рынка.

2.2. Текущая цена ценной бумаги рассчитывается как средневзвешенная цена данной ценной бумаги за предшествующие моменту расчета десять минут в Режимх торгов/Секторах рынка, проводимых на основании безадресных заявок.

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.

ПРИЛОЖЕНИЕ №14

**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»**

Порядок использования АСП и порядок проведения технической экспертизы

1. Настоящее Приложение устанавливает порядок использования АСП и порядок проведения технической экспертизы в отношении АСП в Секторе рынка Основной рынок. Порядок присвоения и использования АСП, а также порядок проведения технической экспертизы в отношении АСП в Секторе рынка Standard регулируется Соглашением об использовании аналога собственноручной подписи в Торговых системах ООО «Технический центр РТС», указанном в Правилах допуска. Порядок присвоения и использования АСП, а также порядок проведения технической экспертизы в отношении АСП в Секторе рынка Classica регулируется Соглашением об использовании аналога собственноручной подписи в Торговых системах НП РТС, указанном в Правилах допуска.

АСП участника торгов на фондовом рынке ЗАО «Фондовая биржа ММВБ» (АСП Участника торгов) является присвоенный данному участнику торгов Торговый идентификатор, АСП организации, выполняющей функции центрального контрагента (АСП Центрального контрагента), - присвоенный ей Торговый идентификатор, который позволяет достоверно установить, что заявка или иное электронное сообщение исходит от участника торгов или Центрального контрагента, которому присвоен данный Торговый идентификатор.

Порядок использования АСП:

1.1. Аналог собственноручной подписи (АСП) используется при подаче (направлении) в Систему торгов следующих электронных сообщений и является их реквизитом:

- заявок;
- распоряжений на отзыв заявки;

Биржа, в целях обеспечения возможности проведения технической экспертизы обусловленной оспариванием Участником торгов факта регистрации распоряжения об отзыве заявки в Системе торгов, ведет реестр распоряжений на отзыв заявки.

1.2. В ходе торгов Биржа обеспечивает защищенность и целостность заявок Участников торгов и иных электронных сообщений 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) и Центрального контрагента по IP-адресу, а также защиту информации от несанкционированного доступа;
- использование Участником торгов и Центральным контрагентом Торгового идентификатора 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);
- наличие специальной процедуры передачи Участнику торгов и Центральному контрагенту сведений о присвоенном Торговом идентификаторе и пароле, обеспечивающих защиту данной информации от несанкционированного доступа.

1.3. Электронные сообщения, определенные в п.1.1. настоящего Приложения №14, считаются подписанными АСП с момента их отправки в Систему торгов при условии успешного прохождения процедуры аутентификации (процедура подтверждения

принадлежности АСП) в порядке, предусмотренном настоящим Приложением №14.

1.4. Получение электронного сообщения, подписанного АСП, приравнивается к получению идентичного по смыслу и содержанию документа, подписанного собственноручной подписью уполномоченного лица, и влечет аналогичные последствия.

1.5. Присвоение Торгового идентификатора Участнику торгов и Центральному контрагенту осуществляется Биржей в соответствии с порядком, определенным Правилами допуска. Сведения о присвоенных Торговых идентификаторах относятся к конфиденциальным. Участник торгов или Центральный контрагент обеспечивают соблюдение требований о конфиденциальности и несут риск последствий, вызванных нарушением таких требований.

1.6. Процедура аутентификации осуществляется Техническим центром с использованием Системы торгов при входе в Систему торгов через удаленное рабочее место Участника торгов или Центрального контрагента путем сопоставления введенных Торгового идентификатора и пароля данным, информация о которых содержится в базе данных Системы торгов. В случае успешного прохождения процедуры аутентификации Участник торгов или Центральный контрагент получает возможность осуществления операций в Системе торгов.

1.7. В момент формирования уполномоченным лицом сообщений, определенных в п.1.1. настоящего Приложения №14, они подписываются соответствующим АСП.

1.8. Направляемые Участнику торгов или Центральному контрагенту выписка из реестра введенных заявок и выписка из реестра Подтверждений Центрального контрагента соответственно содержат информацию о том, что заявки или Подтверждение Центрального контрагента подписаны соответствующим АСП путем проставления соответствующей отметки. Порядок формирования и передачи получателю вышеуказанных документов устанавливается в Подразделе 1.15. «Подведение итогов торгов. Биржевая информация» настоящих Правил.

1.9. Участник торгов и Центральный контрагент соглашаются с тем, что Биржей могут быть изготовлены (распечатаны) копии электронных сообщений, подписанных АСП: выписки из реестра введенных заявок и/или выписки из реестра Подтверждений Центрального контрагента, направляемых в порядке, предусмотренном в Подразделе 1.15. «Подведение итогов торгов. Биржевая информация» настоящих Правил, а также выписки из реестра распоряжений об отзыве заявки, которые удостоверяются подписью уполномоченного лица Биржи и являются бесспорным доказательством соответственно факта подачи заявки в Систему торгов и/или факта направления распоряжения об отзыве заявки в Систему торгов, а также подтверждают соответствие вышеуказанных документов в электронном виде содержанию копии таких документов, изготовленных (распечатанных) на бумажном носителе.

1.10. Участник торгов и Центральный контрагент соглашаются, что все возникшие конфликтные ситуации, связанные с использованием АСП, будут стремиться решить в досудебном порядке. В случае возникновения конфликтных ситуаций в связи с использованием АСП проводится техническая экспертиза в соответствии с п.2. настоящего Приложения №14.

2. Порядок проведения технической экспертизы:

2.1. В связи с заключением сделок с использованием АСП возможно возникновение конфликтных ситуаций, связанных с регистрацией заявок в Системе торгов, изменением информации в заявках после подачи их Участником торгов в Систему торгов, а именно:

- оспаривание Участником торгов факта регистрации заявки в Системе торгов;
- заявление Участника торгов об изменении информации в поданной им заявке при её регистрации в Системе торгов, за исключением случаев пересчета параметров поданных заявок, предусмотренных Правилами ФБ ММВБ;

- заявление Участника торгов о неисполнении поданной заявки при наступлении условий ее исполнения;
- оспаривание Участником торгов факта регистрации распоряжения об отзыве заявки в Системе торгов;
- оспаривание Центральным контрагентом факта отправки Подтверждения Центрального контрагента;
- иные случаи возникновения конфликтных ситуаций, связанных с заключением сделок (договоров) купли-продажи ценных бумаг на фондовом рынке ФБ ММВБ.

2.2. В случае возникновения конфликтной ситуации Участник торгов или Центральный контрагент (далее - заявитель) должен незамедлительно, но не позднее чем в течение трех рабочих дней или в иной более короткий срок после возникновения конфликтной ситуации, направить в адрес ФБ ММВБ уведомление о предполагаемом наличии конфликтной ситуации (далее – Уведомление).

2.3. Уведомление должно содержать информацию о существовании конфликтной ситуации и обстоятельствах, которые, по мнению заявителя, направившего Уведомление, свидетельствуют о наличии конфликтной ситуации. В Уведомлении должны быть указаны фамилия, имя и отчество, должность, контактные телефоны, факс, адрес электронной почты лица или лиц, уполномоченных вести переговоры по урегулированию конфликтной ситуации. Уведомление составляется в письменной форме и направляется с нарочным, либо иным способом, обеспечивающим подтверждение вручения корреспонденции адресату.

2.4. ФБ ММВБ совместно с Техническим центром обязаны в срок не более трех рабочих дней с даты получения Уведомления проверить наличие обстоятельств, свидетельствующих о возникновении конфликтной ситуации, и направить заявителю информацию о результатах проверки и, в случае необходимости, о мерах, принятых для разрешения возникшей конфликтной ситуации.

2.5. Конфликтная ситуация признается разрешенной в рабочем порядке в случае, если заявитель удовлетворен информацией, полученной от ФБ ММВБ. В случае если заявитель не удовлетворен полученной информацией, он сообщает об этом на ФБ ММВБ не позднее, чем в первый рабочий день, следующий за днем получения информации от ФБ ММВБ. В этом случае для рассмотрения конфликтной ситуации формируется Техническая комиссия.

2.6. Не позднее, чем на следующий рабочий день после того, как принято решение о необходимости сформировать Техническую комиссию, но не позднее, чем на шестой рабочий день после получения Уведомления, в случае, если конфликтная ситуация не была урегулирована в рабочем порядке, Техническая комиссия должна быть сформирована.

2.7. Если стороны в конфликтной ситуации не договорятся об ином, в состав Технической комиссии входит равное количество, но не менее чем по одному уполномоченному представителю каждой из конфликтующих сторон и Технического центра. Право представлять в Технической комиссии соответствующую сторону должно подтверждаться доверенностью, выданной каждому представителю на срок работы Технической комиссии.

2.8. Сформированная Техническая комиссия при рассмотрении конфликтной ситуации устанавливает на технологическом уровне наличие или отсутствие фактических обстоятельств, свидетельствующих о факте и времени формирования и ввода документа заявителем, его регистрации в Системе торгов и отсутствии изменений после его регистрации в Системе торгов.

2.9. Проведение технической экспертизы при разрешении подобных конфликтных ситуаций в соответствии с особенностями функционирования Системы

торгов осуществляется с применением специального программного и информационного обеспечения Технического центра, необходимого для выполнения требуемых проверок и документирования данных, используемых при выполнении необходимых проверок.

2.10. По результатам выполнения необходимых проверок составляется протокол, который является основным документом работы Технической комиссии и должен быть подписан всеми членами комиссии.

2.11. Для проведения технической экспертизы необходимы:

- информация от заявителя претензии о параметрах заявки или распоряжения об отзыве заявки, в отношении которой(ого) проводится техническая экспертиза:

- дата и время формирования;
- номер;
- иные реквизиты;

- архив регистрации транзакций в Системе торгов на указанную дату (файл TransLog и начальные файлы данных Системы торгов на указанную дату торгов);

- рабочее место, позволяющее просматривать и распечатывать информацию из файла TransLog в удобном для восприятия членами Технической комиссии виде;

- документы, подтверждающие направление в установленном порядке уведомления о присвоении Торгового идентификатора.

2.12. Проведение технической экспертизы включает в себя выполнение следующих действий:

- распечатку на бумажном носителе электронного документа, содержащего параметры заявки или распоряжения об отзыве заявки, в отношении которой(ого) проводится техническая экспертиза;

- повтор (имитацию) технологического процесса торгов на указанную дату путем «прогона» файла TransLog на рабочем месте, имеющем доступ к текущей версии программного обеспечения Системы торгов, с целью получения результатов, подтверждающих целостность файла TransLog и соответствие результатов «прогона» результатам торгов на указанную дату;

- проверку соответствия результатов повтора (имитации) торгов на указанную дату информации, содержащейся в реестре заявок, выписка из которого (выписка из реестра заявок) предоставляется по требованию Участника торгов или выписке из реестра Подтверждений Центрального контрагента, предоставляемой по требованию Центрального контрагента;

- фиксирование результатов «прогона» в протоколе работы Технической комиссии;

- фиксирование результатов проверки в протоколе работы Технической комиссии;

- проверку соответствия АСП в копии электронного документа на бумажном носителе, который содержит параметры заявки или распоряжения об отзыве заявки, Торговому идентификатору Участника торгов в установленном Правилами допуска порядке;

- фиксирование результатов проверки в протоколе работы Технической комиссии.

2.13. В случае, если:

- заявка или распоряжение об отзыве заявки, в отношении которой(ого) проводится техническая экспертиза, найдена в файле TransLog;

- результаты повтора (имитации) торгов на указанную дату путем "прогона" файла TransLog через Систему торгов соответствуют информации, содержащейся в реестре заявок, выписка из которого (выписка из реестра заявок) предоставляется по требованию

Участника торгов или выписке из реестра Подтверждений Центрального контрагента, представленной по требованию Центрального контрагента;

- установлено соответствие АСП в копии электронного документа на бумажном носителе, который содержит параметры заявки или распоряжения об отзыве заявки, Торговому идентификатору, присвоенному Участнику торгов в установленном Правилами допуска порядке,

считается установленным, что:

- заявка или распоряжение об отзыве заявки, в отношении которой(ого) возникла конфликтная ситуация, была сформирована Участником торгов или Центральным контрагентом в Системе торгов в соответствии с настоящими Правилами;

- после подачи в Систему торгов указанного электронного сообщения, подписанного АСП, не было изменено ни одного параметра электронного сообщения, и (при наличии такого факта) в Системе торгов зарегистрирована сделка в соответствии с настоящими Правилами.

2.14. Все действия, предпринимаемые Технической комиссией для выяснения фактических обстоятельств, а также выводы, сделанные комиссией, заносятся в Протокол работы Технической комиссии. Протокол работы Технической комиссии должен содержать следующие данные:

- состав Технической комиссии с указанием сведений о должности и месте работы каждого из членов Технической комиссии;

- краткое изложение обстоятельств возникшей конфликтной ситуации;

- мероприятия, проводимые Технической комиссией для установления причин и последствий возникшей конфликтной ситуации, с указанием даты, времени и места их проведения;

- выводы, к которым пришла Техническая комиссия в результате проведенных мероприятий;

- подписи всех членов Технической комиссии.

Протокол составляется на бумажном носителе в количестве экземпляров, равном количеству организаций, уполномоченные представители которых принимали участие в работе Технической комиссии, по одному экземпляру для заявителя, ФБ ММВБ и Технического центра.

2.15. В случае, если по результатам рассмотрения Технической комиссией конфликтная ситуация остается неурегулированной, то такая конфликтная ситуация подлежит рассмотрению в порядке, предусмотренном в Подразделе 1.16. «Порядок разрешения споров» настоящих Правил.

ПРИЛОЖЕНИЕ №15

**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»**

Порядок письменного оформления сделок, заключенных в Секторе рынка Classica

Статья 1. Общие правила оформления сделок, заключенных в Секторе рынка Classica.

1.1. Сделка, заключенная в Секторе рынка Classica, должна быть письменно оформлена путем подписания договора по форме Приложения №2 к Торговому соглашению ЗАО «ФБ ММВБ» (далее – Договор), если иное не предусмотрено настоящими Правилами.

1.2. Положения Договора приоритетны по отношению к предшествующим договоренностям. Договор должен содержать условия сделки, заключенной в Секторе рынка Classica в установленном порядке.

1.3. За исключением случаев, установленных настоящим Приложением или соглашением сторон, Договор должен быть подписан в электронном виде при помощи подсистемы электронного документооборота Биржи. Технические требования к форматам Подтверждений сделки и Договоров, заключаемых в электронном виде, требования к последовательности полей электронных сообщений, иные аналогичные требования, связанные с электронным документооборотом, устанавливаются организацией, обеспечивающей функционирование системы электронного документооборота.

1.4. Участник торгов вправе отказаться от подписания Договора в электронном виде. В этом случае он осуществляет подготовку Договора на бумажном носителе.

1.5. Если обе стороны отказались или не имеют возможности подписать Договор в электронном виде, подготовка Договора на бумажном носителе осуществляется Продавцом.

1.6. Договор на бумажном носителе может быть заключен при помощи средств факсимильной связи.

Статья 2. Подписание Договора в электронном виде

2.1. В случае заключения сделки в ходе Основной торговой сессии подписание Договора в электронном виде производится в следующем порядке:

- до 19 часов дня заключения сделки Покупатель готовит, подписывает электронной подписью и направляет Продавцу Подтверждение сделки;
- до 14 часов рабочего дня, следующего за днем получения Подтверждения сделки, Продавец в соответствии с полученным Подтверждением сделки готовит, подписывает электронной подписью и направляет Покупателю текст Договора;
- до конца рабочего дня, в течение которого Покупателем был получен подписанный Продавцом текст Договора, Покупатель подписывает полученный текст Договора электронной подписью и направляет его Продавцу.

2.2. В случае заключения сделки в ходе Дополнительной торговой сессии подписание Договора в электронном виде производится в том же порядке, в котором осуществляется подписание Договоров для оформления сделок, заключенных в ходе Основной торговой сессии в следующий торговый день.

Статья 3. Подписание Договора на бумажном носителе

3.1. Подписание Договора на бумажном носителе осуществляется в следующем порядке:

- в день заключения сделки, а если сделка заключена в ходе Дополнительной торговой сессии, - на следующий рабочий день, стороны обмениваются информацией и документами, необходимыми для подготовки Договора;

- до конца рабочего дня, следующего за днем обмена информацией и документами, необходимыми для подготовки Договора, Участник торговли, обязанный подготовить Договор, готовит и подписывает Договор на бумажном носителе, после чего предоставляет другой стороне для подписания 2 экземпляра данного Договора;
- в день получения подписанных экземпляров Договора получившая их сторона подписывает данные экземпляры Договора и возвращает один из них другой стороне в сроки, установленные пунктами 3.2. - 3.3. настоящего Приложения №15.

3.2. Участник торгов, получивший подписанные на бумажном носителе экземпляры Договора подписывает их в присутствии представителя контрагента в следующие сроки:

- при предоставлении не более трех комплектов Договоров – 1 час;
- при предоставлении более 3 комплектов Договоров добавляется 15 минут на подписание каждого дополнительного комплекта, при этом общий срок не должен превышать 2 часов.

3.3. В случае невозможности подписания Договоров в установленные сроки, получивший Договоры Участник торгов обязан до истечения дня их получения самостоятельно доставить подписанные Договоры контрагенту.

Статья 4. Предоставление документов по требованию одной из сторон

4.1. Если Участник торгов подписывает Договор от имени третьего лица, он обязан до подписания Договора предоставить своему контрагенту (по требованию последнего) подлинники или нотариально удостоверенные копии предусмотренных российским законодательством документов, подтверждающих его полномочия на заключение Договора.

Если документы, подтверждающие полномочия Участника торгов на заключение договора, выданы (оформлены, подписаны) не на территории Российской Федерации, оригиналы таких документов должны быть легализованы или апостилированы в установленном порядке.

Статья 5. Случаи распределения ценных бумаг

5.1. Если в период между заключением сделки и ее оформления Договором произойдет размещение ценных бумаг путем распределения среди владельцев ценных бумаг соответствующего эмитента, в Договоре указывается количество подлежащих передаче ценных бумаг с учетом ценных бумаг, полученных Продавцом в результате произошедшего распределения.

Статья 6. Правила заполнения Договора.

6.1. Договор заполняется в соответствии с нижеприведенной таблицей:

Место или № поля в «табличном» договоре	Название поля в электронном договоре	Содержание поля
№ Договора	[AGRNUM]	Указывается: RTST далее без пробелов – номер сделки в Секторе рынка Classica на Бирже, далее без пробелов – буква латинского алфавита, порядковый номер которой в алфавите соответствует порядковому номеру данного договора среди договоров, оформляющих одну сделку. Буква не указывается, если одна сделка оформляется одним Договором. Если в Системе торгов ФБ ММББ отсутствует соответствующий подписываемому Договору отчет о сделке, указывается: код, присвоенный Участнику

		торгов, направившему Подтверждение сделки, далее без пробелов – присвоенный данным Участником торгов номер Договора, ранее не использовавшийся при заключении Договоров в электронном виде.
Номер Продавца	SREFER	По усмотрению Продавца в данном поле может быть указан номер Договора, используемый Продавцом для внутреннего учета.
Номер Покупателя	BREFER	По усмотрению Покупателя в данном поле может быть указан номер Договора, используемый Покупателем для внутреннего учета.
отсутствует	VERNUM	Указывается порядковый номер версии Договора. При каждой последующей отправке Договора для подписания Покупателем (в случае внесения в него изменений) номер, указанный в поле VERNUM , увеличивается на единицу.
Преамбула и предмет Договора	AGRTXT	<i>Если договор(ы) поручительства по договору купли-продажи не заключается, указывается следующий текст:</i> “Настоящий договор (далее – Договор) составлен в соответствии с Торговым соглашением ЗАО «ФБ ММВБ» (далее – Соглашение), действующим на момент подписания Договора. Стороны согласились ко всем отношениям, вытекающим из Договора, применять условия и принципы Соглашения. Значение полей Договора определяется в соответствии с Приложением №2 к Соглашению. Любой спор по Договору подлежит рассмотрению в Третьей суду НАУФОР в соответствии с его Регламентом, действующим на момент подачи искового заявления.* <i>Предмет Договора:</i> Продавец обязуется передать Пакет ЦБ лицу, указанному в Договоре, а Покупатель обязуется оплатить Пакет ЦБ.” *В случае подписания договора купли-продажи без договора(ов) поручительства в электронном виде преамбула может быть изложена в редакции, определенной форматом электронного документа, установленным организацией, обеспечивающей функционирование системы электронного документооборота. <i>Если заключается договор(ы) поручительства по договору купли-продажи, указывается следующий текст:</i> “Нижеследующие договор купли-продажи и договор(ы) поручительства (далее – Договоры) составлены в соответствии с Торговым соглашением ЗАО «ФБ ММВБ» (далее – Соглашение), действующим на момент подписания Договоров. Стороны согласились ко всем отношениям, вытекающим из Договоров, применять условия и

		принципы Соглашения. Значение полей Договоров определяется в соответствии с Приложением №2 к Соглашению. Любой спор по Договорам подлежит рассмотрению в Третейском суде НАУФОР в соответствии с его Регламентом, действующим на момент подачи искового заявления.* Предмет договора купли-продажи: Продавец обязуется передать Пакет ЦБ лицу, указанному в Договоре, а Покупатель обязуется оплатить Пакет ЦБ.” *В случае подписания договора купли-продажи вместе с договором(ами) поручительства в электронном виде преамбула может быть изложена в редакции, определенной форматом электронного документа, установленным организацией, обеспечивающей функционирование системы электронного документооборота.
1.1.	SPARNM	Указывается имя (наименование) Продавца по Договору, а в случае подписания Договора в электронном виде при помощи подсистемы электронного документооборота Биржи - его код. В случае, если отчуждаются ценные бумаги, находящиеся в доверительном управлении Продавца, после имени (наименования) Продавца или его кода указывается символ Д.У.
1.2.	SRTSCD	Указывается наименование Участника торгов, заключающего Договор от имени Продавца (поверенного; агента, действующего от имени принципала), а в случае подписания Договора в электронном виде при помощи подсистемы электронного документооборота Биржи - код, присвоенный данной организации-Участнику торгов. Если Договор заключается организацией от своего имени в настоящем поле и поле 1.1. / SPARNM указывается одно и то же лицо.
1.3.	SCLICD	Может указываться код, присвоенный Клиринговой организацией или лицом, указанным в поле 1.2. / SRTSCD , лицу, за счет которого исполняются обязательства Продавца по Договору.
1.3.1	SCLIST	Указывается трехбуквенный код страны регистрации лица, за счет которого исполняются обязательства Продавца по Договору, в соответствии с кодировкой, установленной общероссийским классификатором стран мира, действующим на дату оформления Договора.
1.4.	SCLAGR	Указываются сведения о документах, на основании которых лицо, указанное в поле 1.2. / SRTSCD , действует от имени лица, указанного в поле 1.1. / SPARNM . - соответствующий клиентский договор (поручения, агентский и т.д.), его наименование, номер и дата

		заклучения; и (или) - иной документ (м.б. распоряжение, инструкция, приказ, поручение и т.д.), его наименование, номер и дата; и (или) - доверенность, ее номер и дата выдачи. Поле не заполняется, если в полях 1.1. / SPARNM , 1.2. / SRTSCD указывается одно и то же лицо.
2.1.	BPARNM	Указывается имя (наименование) Покупателя по Договору, а в случае подписания Договора в электронном виде при помощи подсистемы электронного документооборота Биржи - его код. В случае, если ценные бумаги приобретаются по Договору за счет средств, находящихся в доверительном управлении Покупателя, после имени (наименования) Покупателя или его кода указывается символ Д.У.
2.2.	BRTSCD	Указывается наименование Участника торгов, заключающего Договор от имени Покупателя (поверенного; агента, действующего от имени принципала), а в случае подписания Договора в электронном виде при помощи подсистемы электронного документооборота Биржи - код, присвоенный данной организации – Участнику торгов. Если Договор заключается организацией от своего имени в настоящем поле и поле 2.1. / BPARNM указывается одно и то же лицо.
2.3.	BCLICD	Может указываться код, присвоенный Клиринговой организацией или лицом, указанным в поле 2.2. / BRTSCD , лицу, за счет которого исполняются обязательства Покупателя по Договору.
2.3.1	BCLIST	Указывается трехбуквенный код страны регистрации лица, за счет которого исполняются обязательства Покупателя по Договору, в соответствии с кодировкой, установленной общероссийским классификатором стран мира, действующим на дату оформления Договора.
2.4.	BCLAGR	Указываются сведения о документах, на основании которых лицо, указанное в поле 2.2. / BRTSCD , действует от имени лица, указанного в поле 2.1. / BPARNM : - соответствующий клиентский договор (поручения, агентский и т.д.), его наименование, номер и дата заключения; и (или) - иной документ (м.б. распоряжение, инструкция, приказ, поручение и т.д.), его наименование, номер и дата; и (или) - доверенность, ее номер и дата выдачи. Поле не заполняется, если в полях 2.1. / BPARNM и 2.2. / BRTSCD указывается одно и то же лицо.
3.1.	ISSUEC	Указывается код ценной бумаги .

3.2.	UNITSN	Указывается количество ценных бумаг, передаваемых по Договору.*
3.3.	UNITPR	<i>Для акций и инвестиционных паев:</i> указывается цена одной ценной бумаги с точностью до <u>восьмого</u> знака после запятой. <i>Для облигаций:</i> указывается цена ценной бумаги в процентах от номинальной стоимости с точностью до <u>четвертого</u> знака после запятой.
3.4.	DEALPR	Указывается сумма сделки с точностью до <u>второго</u> знака после запятой. В случае купли продажи облигаций сумма сделки: а) включает в себя при наличии таковых суммы, указываемые в полях 3.4.1. / BONDPR , 3.4.2. / ACCINT Договора; б) Указывается в валюте платежа (поле 3.6. / PAYCUR Договора). Для определения суммы сделки в иностранной валюте суммы, указываемые в полях 3.4.1. / BONDPR , 3.4.2. / ACCINT Договора складываются и делятся на курс соответствующей валюты, установленный на день заключения сделки.
3.4.1.	BONDPR	Данное поле используется в случае купли-продажи купонных облигаций. С точностью до <u>второго</u> знака после запятой указывается цена Пакета ЦБ в рублях РФ без учета накопленного купонного дохода (НКД), рассчитываемая как произведение: а) количества ценных бумаг (поле 3.2. / UNITSN Договора); б) выраженной в процентах цены ценных бумаг (поле 3.3. / UNITPR Договора); в) номинальной стоимости одной ценной бумаги.
3.4.2.	ACCINT	Данное поле используется в случае купли-продажи купонных облигаций. С точностью до <u>второго</u> знака после запятой указывается размер НКД в рублях РФ по всему Пакету ЦБ на дату перерегистрации ценных бумаг (поля 4.1. / DELDAT и 4.1.1. / DELFR0 Договора).
3.5.	TRDCUR	Указывается валюта, в которой выражена сумма сделки и <i>(для акций и инвестиционных паев)</i> цена одной ценной бумаги (USD – доллары США; RUR – рубли РФ)
3.6.	PAYCUR	Указывается валюта платежа по Договору(USD – доллары США; RUR – рубли РФ).
4.1.	DELDAT	Указывается дата или срок перерегистрации ценных бумаг. В случае заключения Договора в электронном виде заполняется в следующем порядке: а) Если перерегистрация ценных бумаг должна быть осуществлена в определенную дату, указывается символ <d> . Далее без пробела указывается число,

		первые четыре цифры которого означают год, следующие две цифры – месяц указанного года, следующие две цифры – число указанного месяца; б) Если перерегистрация ценных бумаг должна быть осуществлена в течение определенного срока, указывается символ <t>. Далее без пробела цифрой указывается соответствующее количество рабочих дней. При купле-продаже облигаций ОАО “Газпром” указываемый срок или дата перерегистрации ценных бумаг не должен превышать 5 (пяти) рабочих дней после заключения сделки.
4.1.1.	DELFRO	Указывается: - символ A(в электронном виде) или текст “с даты заключения Договора” (на бумажном носителе) – если срок для перерегистрации ценных бумаг исчисляется с даты заключения Договора; - символ P (в электронном виде) или текст “с даты оплаты” (на бумажном носителе) – если срок для перерегистрации ценных бумаг исчисляется с даты оплаты; - символ N (в электронном виде) или текст “см. пункт 7.2. Договора” (на бумажном носителе) – если срок дней для перерегистрации ценных бумаг исчисляется в ином порядке. В этом случае, соответствующий порядок указывается в поле 7.2. / ANOTES Договора. Данное поле не заполняется, если в поле 4.1. / DELDAT указана дата.
4.2.	PAYDAT	Указывается дата или срок оплаты ценных бумаг. В случае заключения Договора в электронном виде заполняется в следующем порядке: а) Если оплата ценных бумаг должна быть осуществлена в определенную дату, указывается символ <d>. Далее без пробела указывается число, первые четыре цифры которого означают год, следующие две цифры – месяц указанного года, следующие две цифры – число указанного месяца; б) Если оплата ценных бумаг должна быть осуществлена в течение определенного срока, указывается символ <t>. Далее без пробела цифрой указывается соответствующее количество рабочих дней.
4.2.1.	PAYFRO	Указывается: - символ A(в электронном виде) или текст “с даты заключения Договора” (на бумажном носителе) – если количество дней для оплаты ценных бумаг исчисляется с даты заключения Договора; - символ D (в электронном виде) или текст “с даты перерегистрации ценных бумаг” (на бумажном носителе) – если количество дней для оплаты ценных бумаг исчисляется с даты перерегистрации

		ценных бумаг; - символ N (в электронном виде) или текст “см. пункт 7.2. Договора” (на бумажном носителе) – если количество дней для оплаты ценных бумаг исчисляется в ином порядке. В этом случае, соответствующий порядок указывается в поле 7.2. / ANOTES Договора. Данное поле не заполняется, если в поле 4.2. / PAYDAT указана дата.
5.1.	REGIST	Указывается символ R(в электронном виде) или текст “Держатель реестра” (на бумажном носителе), если перерегистрация ценных бумаг производится в реестре владельцев именных ценных бумаг или код или наименование депозитария, если перерегистрация ценных бумаг производится в депозитарии.
5.2.	REGPAR	Указывается один из следующих символов: - символ B (в электронном виде) или слово “Покупатель” (на бумажном носителе) – если ответственным за перерегистрацию является Покупатель; - символ S (в электронном виде) или слово “Продавец” (на бумажном носителе)– если ответственным за перерегистрацию является Продавец; - символ D(в электронном виде) или текст “в соответствии с правилами РДО, указанной в поле 5.1. / REGIST ”(на бумажном носителе) – если действия по перерегистрации должны быть осуществлены в соответствии с правилами РДО, указанной в поле 5.1. / REGIST .
5.3.1.	SRACCT	Указывается: - символ OW(в электронном виде) или текст “счет собственника” (на бумажном носителе) – если ценные бумаги должны быть списаны со счета собственника; - символ NM(в электронном виде) или текст “счет номинального держателя”(на бумажном носителе)– если ценные бумаги должны быть списаны со счета номинального держателя; - символ TR (в электронном виде) или текст “счет ДУ”(на бумажном носителе)– если ценные бумаги должны быть списаны со счета доверительного управляющего; - символ OT(в электронном виде) или текст “см. пункт 7.2. Договора” (на бумажном носителе) – если ценные бумаги должны быть списаны со счета иного типа (в этом случае тип счета указывается в поле 7.2. / ANOTES Договора).
5.3.2.	SRGACC	Указывается номер счета, с которого должны быть списаны ценные бумаги. Поле может не заполняться, если номер счета не является информацией, необходимой для перерегистрации ценных бумаг или

		идентификации полученных ценных бумаг Покупателем.
5.3.3.	SREGNM	Указывается код или наименование (имя) зарегистрированного лица / депонента, являющегося владельцем счета, с которого должны быть списаны ценные бумаги, ведущегося регистратором или депозитарием, указанным поле 5.1. / REGIST Договора.
5.3.4.	SRGDOC	Указывается наименование документа лица, указанного в поле 5.3.3. / SREGNM и информация об этом документе, необходимая для заполнения передаточного распоряжения в соответствии с требованиями нормативных правовых актов Российской Федерации (свидетельство о регистрации или паспорт; номер; серия; дата выдачи (регистрации); наименование органа, осуществившего выдачу (регистрацию).
5.3.5.	SRGAGR	Указываются данные о договоре, заключенном лицом, указанным в поле 5.3.3. / SREGNM , необходимые для заполнения Подраздела передаточного распоряжения “ОСНОВАНИЕМ ДЛЯ ВНЕСЕНИЯ ЗАПИСИ В РЕЕСТР ЯВЛЯЕТСЯ СЛЕДУЮЩИЙ ДОКУМЕНТ:” (Депозитарный договор, договор номинального держания между данным лицом и его клиентом и т.д., номер, дата заключения).
5.4.1.	BRACCT	Указывается один из следующих символов: - символ OW (в электронном виде) или текст “счет собственника” (на бумажном носителе) если ценные бумаги должны быть зачислены на счет собственника; - символ NM(в электронном виде) или текст “счет номинального держателя”(на бумажном носителе) – если ценные бумаги должны быть зачислены на счет номинального держателя; - символ TR (в электронном виде) или текст “счет ДУ” (на бумажном носителе) – если ценные бумаги должны быть зачислены на счет доверительного управляющего; - символ OT(в электронном виде) или текст “см. пункт 7.2. Договора” (на бумажном носителе) – если ценные бумаги должны быть зачислены на счет иного типа (в этом случае тип счета указывается в поле 7.2. / ANOTES Договора).
5.4.2.	BRGACC	Указывается номер счета, на который должны быть зачислены ценные бумаги. Поле может не заполняться, если номер счета не является информацией, необходимой для перерегистрации ценных бумаг.
5.4.3.	BREGNM	Указывается код или наименование (имя) зарегистрированного лица / депонента, являющегося владельцем счета, на который должны быть зачислены ценные бумаги, ведущегося регистратором или депозитарием, указанным поле 5.1. / REGIST

		Договора.
5.4.4.	BRGDOC	Указывается наименование документа лица, указанного в поле 5.4.3. / BREGNM и информация об этом документе, необходимая для заполнения передаточного распоряжения в соответствии с требованиями нормативных правовых актов Российской Федерации (свидетельство о регистрации или паспорт; номер; серия; дата выдачи (регистрации); наименование органа, осуществившего выдачу (регистрацию).
5.4.5.	BRGAGR	Указываются данные о договоре, заключенном лицом, указанным в поле 5.4.3. / BREGNM , необходимые для заполнения Подраздела передаточного распоряжения “ОСНОВАНИЕМ ДЛЯ ВНЕСЕНИЯ ЗАПИСИ В РЕЕСТР ЯВЛЯЕТСЯ СЛЕДУЮЩИЙ ДОКУМЕНТ:” (Депозитарный договор, договор номинального держания между данным лицом и его клиентом и т.д., номер, дата заключения).
6.1.	BACCOW	Указывается код или наименование (имя) плательщика по Договору.
6.2.	BBANKN	Указывается код или наименование кредитной организации (филиала), ведущей счет, с которого должны быть списаны денежные средства для оплаты ценных бумаг.
6.3.	BACCNB	Указывается номер счета с которого должны быть списаны денежные средства для оплаты ценных бумаг.
6.4.	BBINFO	Указываются иные платежные реквизиты плательщика по Договору.
6.5.	SACCOW	Указывается код или наименование (имя) получателя платежа по Договору.
6.6.	SBANKN	Указывается код или наименование кредитной организации (филиала), ведущей счет, на который должны быть зачислены денежные средства для оплаты ценных бумаг.
6.7.	SACCNB	Указывается номер счета на который должны быть зачислены денежные средства для оплаты ценных бумаг.
6.8.	SBINFO	Указываются иные платежные реквизиты получателя платежа по Договору.
7.1.	SETTYP	Если обязательства по Договору должны быть исполнены: В соответствии с технологией «поставка против платежа» без предварительного обеспечения, указывается символ DVP ; С использованием блокировки Пакета ЦБ на специальном Подразделе счета списания ценных бумаг в РДО, указывается символ BLC ; В порядке, предусмотренном документами указываемой в поле 5.1. / REGIST РДО, для исполнения поручений депонентов на условиях «Гарантированной поставки», указывается символ GRN .

		В противном случае поле не заполняется.
7.2.	ANOTES	Заполняется, в случаях, установленных документами Биржи, а также, если из документов Биржи или соглашения сторон вытекает необходимость внесения в Договор информации или условий, для которых не предусмотрены иные поля.
8.1. (Продавец)	SADDRS	Указывается адрес для предоставления документов в бумажном виде Продавцу. Телефон, факс.
8.1. (Покупатель)	BADDRS	Указывается адрес для предоставления документов в бумажном виде Покупателю. Телефон, факс.
8.2. (Место нахождения Продавца)	SLADDR	Указывается: - место нахождения Продавца, указанное в его учредительных документах (если Продавец – юридическое лицо); - место жительства Продавца (если Продавец – физическое лицо).
8.2. (Место нахождения Покупателя)	BLADDR	Указывается: - место нахождения Покупателя, указанное в его учредительных документах (если Покупатель – юридическое лицо); - место жительства Покупателя (если Покупатель – физическое лицо).
Преамбула договора поручительства за Продавца	SSURTX	В случае заключения договора поручительства, обеспечивающего исполнение обязательств Продавца, указывается: “Поручитель за Продавца обязуется отвечать перед Покупателем за исполнение Продавцом обязательств по вышеприведенному договору купли-продажи.”
Преамбула договора поручительства за Покупателя	BSURTX	В случае заключения договора поручительства, обеспечивающего исполнение обязательств Покупателя, указывается: “Поручитель за Покупателя обязуется отвечать перед Продавцом за исполнение Покупателем обязательств по вышеприведенному договору купли-продажи.”
9.1.	SSURCD	Указывается код лица, поручающегося за исполнение Продавцом его обязательств по вышеприведенному договору купли-продажи. (всегда лицо, указанное в поле 1.2. / SRTSCD Договора)
9.2.	SCRENM	Указывается код или наименование кредитора по договору поручительства за Продавца. (всегда лицо, указанное в поле 2.1. / BPARNM Договора)
9.3.	SDEBNM	Указывается код или наименование должника по договору поручительства за Продавца. (всегда лицо, указанное в поле 1.1. / SPARNM Договора)
10.1.	BSURCD	Указывается код лица, поручающегося за исполнение Покупателем его обязательств по вышеприведенному договору купли-продажи. (всегда лицо, указанное в поле 2.2. / BRTSCD Договора)
10.2	BCRENM	Указывается код или наименование кредитора по договору поручительства за Покупателя. (всегда лицо, указанное в поле 1.1. / SPARNM Договора)

10.3.	BDEBNM	Указывается код или наименование должника по договору поручительства за Покупателя. (всегда лицо, указанное в поле 2.1. / BPARNM Договора).
11.1. (поручитель за Продавца)	SSURAD	Указывается адрес для предоставления документов в бумажном виде поручителю за Продавца. Телефон, факс.
11.2. (поручитель за Продавца)	SSURLA	Указывается место нахождения поручителя за Продавца, указанное в его учредительных документах.
11.1. (поручитель за Покупателя)	BSURAD	Указывается адрес для предоставления документов в бумажном виде поручителю за Покупателя. Телефон, факс.
11.2. (Место нахождения Поручителя за Продавца)	SSURLA	Указывается место нахождения поручителя за Продавца, указанное в его учредительных документах.
11.2. (Место нахождения Поручителя за Покупателя)	BSURLA	Указывается место нахождения поручителя за Покупателя, указанное в его учредительных документах;
12.1. (Покупатель/ поручитель за Покупателя)	отсутствует	Указывается фамилия, имя и отчество лица, подписывающего Договор со стороны Покупателя / поручителя за Покупателя.
12.2. (Покупатель/ поручитель за Покупателя)	отсутствует	Указывается должность физического лица, подписывающего Договор со стороны Покупателя / поручителя за Покупателя, в организации, указанной в поле 2.2. Договора.
12.3. (Покупатель/ поручитель за Покупателя)	отсутствует	Указывается документ, служащий основанием полномочий лица, подписывающего Договор со стороны Покупателя / поручителя за Покупателя. Если основанием полномочий на подписание договора купли-продажи и поручительства служат разные документы, указывается каждый из них.
12.1. (Покупатель/ поручитель за Продавца)	отсутствует	Указывается фамилия, имя и отчество лица, подписывающего Договор со стороны Продавца / поручителя за Продавца.
12.2. (Покупатель/ поручитель за Продавца)	отсутствует	Указывается должность физического лица, подписывающего Договор со стороны Продавца / поручителя за Продавца, в организации, указанной в поле 1.2. Договора.
12.3. (Покупатель/ поручитель за Продавца)	отсутствует	Указывается документ, служащий основанием полномочий лица, подписывающего Договор со стороны Продавца/ поручителя за Продавца. Если основанием полномочий на подписание договора купли-продажи и поручительства служат разные документы, указывается каждый из них.

6.2. Если иное прямо не следует из документов Биржи или не установлено соглашением сторон, стороны руководствуются следующими правилами:

6.2.1. Если по условиям сделки перерегистрация ценных бумаг предшествует оплате:

- в поле 4.1. / |DEL DAT| указывается количество рабочих дней для перерегистрации ценных бумаг и предоставления соответствующего документа Покупателю, определяемое в соответствии с Правилами перерегистрации или по соглашению сторон;
- в поле 4.2. / |PAY DAT| указывается срок оплаты, определяемый как количество дней, отведенных на перерегистрацию ценных бумаг плюс 2 (два) дня;
- в полях 4.1.1. / |DEL FRO| и 4.2.1. / |PAY FRO| указывается символ А (в электронном виде) или текст “с даты заключения Договора” (на бумажном носителе).

6.2.2. Если по условиям сделки оплата предшествует перерегистрации ценных бумаг:

- в поле 4.1. / |DEL DAT| указывается количество дней, отведенных для перерегистрации ценных бумаг и предоставления соответствующего документа Покупателю, определяемое в соответствии с Правилами о сроках перерегистрации или по соглашению сторон;
- в поле 4.1.1. / |DEL FRO| указывается символ Р (в электронном виде) или текст “с даты оплаты” (на бумажном носителе);
- в поле 4.2. / |PAY DAT| указываются следующие сроки оплаты:
 - а) 2 (два) дня, если расчеты осуществляются в пределах субъекта Российской Федерации;
 - б) 5 (пять) дней, если расчеты осуществляются в пределах Российской Федерации.¹
- в поле 4.2.1. / |PAY FRO| указывается символ А (в электронном виде) или текст “с даты заключения Договора” (на бумажном носителе).

6.3. Если иное прямо не следует из документов Биржи или не установлено соглашением сторон, в качестве стороны, ответственной за Перерегистрацию, указывается Продавец.

6.4. Если по какой-либо причине одно из полей Договора не заполняется, в нем указывается символ Х. Если договор поручительства не заключается, соответствующие поля в Договоре не указываются.

При заключении Договора в электронном виде, не заполняемые поля в Договоре не указываются.

6.5. Общие правила использования символов для заполнения различных полей Договора, заключаемого в электронном виде:

СИМВОЛ	В КАКИХ СЛУЧАЯХ ИСПОЛЬЗУЕТСЯ
//	Помещается в начале строки в случае, если содержание данной строки является продолжением содержания предыдущей строки
<n>	Всегда указывается перед наименованием организации (без последующего пробела) при заполнении соответствующего поля
<c>	Всегда указывается перед кодом организации (без последующего пробела) при заполнении соответствующего поля (не указывается при заполнении полей SRTSCD ,

¹ Если расчеты осуществляются в иностранной валюте на условиях предоплаты, срок оплаты, указываемый в Договоре, составляет 3 (три) дня.

	BRTSCD , ISSUEC , SCLICD , BCLICD , BSURCD и SSURCD .
--	---

6.6. Наименования организаций, имена, названия документов и ценных бумаг указываются в именительном падеже.

6.7. Если обязательства по оплате и перерегистрации по Договору должны быть исполнены на условиях «поставка против платежа», в соответствии с положениями Правил клиринга, Договор заключается только в электронном виде, при этом поля заполняются с соблюдением следующих требований:

- в полях |DELDAT| и |PAYDAT| указывается дата, являющаяся третьим рабочим днем после заключения Договора;
- в поле |REGIST| – указывается код РДО;
- в поле |REGPAR| – символ **D**;
- в полях |BBANKN| и |SBANKN| - коды или наименования кредитных организаций, осуществляющих расчеты в соответствии с Правилами клиринга;
- в поле |SETTYP| указывается символ **DVP**;
- в поле |PAYCUR| указывается символ **USD** или **RUR**;
- поле |ANOTES| не заполняется.

Иные поля Договора заполняются в обычном порядке.

6.8. Если обязательства по Договору должны быть исполнены с использованием блокировки Пакета ЦБ на специальном Подразделе счета списания ценных бумаг в РДО, то:

- в поле 7.1./|SETTYP| указывается символ BLC;
- в полях 5.1./|REGIST| и 5.2./|REGPAR| указывается символ D.

Иные поля Договора заполняются в обычном порядке.

6.9. Если обязательства по Договору должны быть исполнены в порядке, предусмотренном документами РДО для исполнения поручений депонентов на условиях «Гарантированной поставки» то:

- в поле 7.1./|SETTYP| указывается символ GRN;
- в поле 5.1./|REGIST| указывается код РДО;
- в поле 5.2./|REGPAR| указывается символ D.

Иные поля Договора заполняются в обычном порядке.

6.10. При заполнении полей Договора в бумажном виде в соответствующих полях указываются наименования организаций и ценных бумаг.

При заполнении полей Договора в электронном виде в соответствующих полях указываются коды организаций и ценных бумаг. Если код какой-либо организации или ценной бумаги не установлен, указывается ее наименование.

Коды, которые могут быть использованы при заполнении Договора, за исключением кодов, используемых в полях 1.3.1./|SCLICD| и 2.3.1./|BCLICD|, раскрывается Биржей в сети Интернет по адресу: <http://moex.com/s160>.

Статья 7. Правила заполнения Подтверждения сделки

7.1. Подтверждение сделки составляется путем заполнения следующих полей:

AGRNUM	
BREFER	заполняется по усмотрению Покупателя
SRTSCD	

[BPARNM]	
[BRTSCD]	
[BCLICD]	
[BCLIST]	
[BCLAGR]	
[ISSUEC]	
[UNITSN]	
[UNITPR]	
[DEALPR]	
[BONDPR]	для купонных облигаций
[ACCINT]	для купонных облигаций
[TRDCUR]	
[PAYCUR]	
[DELDAT]	
[DELFRO]	
[PAYDAT]	
[PAYFRO]	
[REGIST]	
[REGPAR]	
[BRACCT]	
[BRGACC]	
[BREGNM]	
[BRGDOC]	
[BRGAGR]	
[BACCOW]	
[BBANKN]	
[BACCNB]	
[BBINFO]	
[SETTYP]	
[ANOTES]	
[BADDRS]	
[BLADDR]	
[SSURCD]	в случае заключения договора поручительства за Продавца
[BSURCD]	в случае заключения договора поручительства за Покупателя
[BSURAD]	в случае заключения договора поручительства за Покупателя
[BSURLA]	в случае заключения договора поручительства за Покупателя

7.2. При подготовке Подтверждения сделки применяются правила заполнения полей, установленные статьей 6 настоящего Порядка.

Статья 8. Ответственность за нарушение порядка подписания Договора

8.1. В случае задержки подписания договоров, вызванной нарушением одной из сторон сроков подписания или предоставления документов или иной информации, другая сторона сделки вправе потребовать выплаты пени в размере 0,2 (две десятых) процента от суммы сделки за каждый календарный день просрочки.

8.2. В случае задержки подписания договоров более чем на 5 (пять) рабочих дней, вызванной нарушением одной из сторон сроков подписания или предоставления документов или иной информации, другая сторона имеет право отказаться от заключенной сделки и потребовать выплаты штрафа в размере 10 (десяти) процентов от суммы сделки.

8.3. В случае задержки подписания договоров более чем на 30 (тридцать) календарных дней, вызванной нарушением одной из сторон сроков подписания или предоставления документов или иной информации, другая сторона имеет право

отказаться от заключенной сделки и потребовать выплаты штрафа в размере 100 (ста) процентов от суммы сделки.

ПРИЛОЖЕНИЕ №16

**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»**

**Условия сделок, заключаемых с Центральным контрагентом в Секторе рынка
Standard**

Настоящие Условия сделок, заключаемых с Центральным контрагентом в Секторе рынка Standard (далее – «Условия»), определяют условия сделок купли-продажи ценных бумаг, заключаемых с Центральным контрагентом Секторе рынка Standard в соответствии с Правилами проведения торгов по ценным бумагам в ЗАО «ФБ ММВБ» (далее – «Сделки»).

ОСНОВНЫЕ ТЕРМИНЫ И ПОНЯТИЯ

При заключении Сделки и исполнении обязательств по Сделке Стороны руководствуются нижеприведенными терминами:

Биржа	Закрытое акционерное общество «Фондовая биржа ММВБ».
Правила	Правила проведения торгов по ценным бумагам в ЗАО «ФБ ММВБ».
Клиринговая организация	Клиринговая организация, осуществляющая клиринг в Секторе рынка Standard, в соответствии с решением Биржи об определении Клиринговой организации.
ЦБ	ценные бумаги в соответствии с законодательством страны государственной регистрации или местонахождения эмитента или лица выпустившего данные ценные бумаги.
Дата заключения Сделки	дата, в которую на основании заявок, поданных в Систему торгов Биржи в соответствии с Правилами, была заключена Сделка.
Дата исполнения Сделки	день, в который должны быть исполнены обязательства по Сделке.
Пакет ЦБ	совокупность ЦБ, в отношении которых заключается Сделка.
Участник торгов	Лицо, от имени которого на торгах Биржи была подана Заявка на покупку ЦБ или

	Заявка на продажу ЦБ, на основании которой заключена Сделка.
Покупатель	Участник торгов, если Сделка была заключена на основании поданной от имени Участника торгов заявки на покупку ЦБ, или Центральный контрагент, если Сделка была заключена на основании поданной от имени Участника торгов заявки на продажу ЦБ.
Продавец	Участник торгов, если Сделка была заключена на основании поданной от имени Участника торгов заявки на продажу ЦБ, или Центральный контрагент, если Сделка была заключена на основании поданной от имени Участника торгов заявки на покупку ЦБ.
Стороны	Покупатель и Продавец.
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.
Перерегистрация	осуществление юридических и фактических действий, необходимых для фиксации перехода прав на ЦБ в соответствии с условиями Сделки.
Расчетная цена	Выраженная в российских рублях или долларах США цена одной ценной бумаги, рассчитываемая в соответствии с Правилами клиринга.

Все термины и понятия, применяемые в настоящих Условиях, трактуются согласно российскому законодательству и иным нормативным актам Российской Федерации, если их иная трактовка не предусмотрена настоящими Условиями или Правилами. Термины специально не определенные в настоящем приложении используются в значениях, установленных Правилами, иными внутренними документами Биржи, Правилами клиринга, а также законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

Статья 1. Предмет Сделки

1.1 Продавец обязуется передать Пакет ЦБ в собственность Покупателю, а Покупатель обязуется принять в собственность и оплатить Пакет ЦБ в соответствии с настоящими Условиями.

1.2 Дата заключения Сделки, коды Сторон Сделки, код Участника торгов,

заключившего Сделку, наименование (код) ЦБ, в отношении которых заключена Сделка, количество ЦБ в Пакете ЦБ и цена за одну ЦБ определяются в соответствии с Правилами в момент заключения Сделки на торгах Биржи и учитываются Биржей в Реестре сделок.

1.3 Условия заключенной Сделки не могут быть изменены.

Статья 2. Обязательства Сторон

2.1 В Дату исполнения Сделки Продавец обязан исполнить свои обязательства по Перерегистрации Пакета ЦБ, а Покупатель обязан исполнить свои обязательства по Перерегистрации и оплате Пакета ЦБ.

2.2 Если решением Биржи не определен иной срок, то датой исполнения Сделки является 2 (Второй) Рабочий день срока исполнения сделки, указанного в безадресной заявке, а если Сделка заключена на торгах Биржи в Секторе рынка Standard на основании адресной заявки, - последний Рабочий день срока исполнения сделки, указанного в такой заявке.

Предусмотренный настоящим пунктом срок исполнения Сделки исчисляется с Даты заключения Сделки, а если Сделка заключена в ходе вечерней Дополнительной торговой сессии - с даты, на которую приходится Рабочий день, следующий за днем проведения указанной Дополнительной торговой сессии.

2.3 Исполнение обязательств Сторон по оплате и Перерегистрации Пакета ЦБ осуществляется в порядке, установленном Правилами клиринга. При этом:

2.3.1. Участник торгов, являющийся Продавцом, обязан до определенного в соответствии с Правилами торгов и Правилами клиринга момента времени Даты исполнения Сделки обеспечить наличие на Подразделе счета депо, используемом для проведения расчетов по Сделке, ЦБ в количестве, достаточном для проведения указанных расчетов;

2.3.2. Участник торгов, являющийся Покупателем, обязан до определенного в соответствии с Правилами торгов и Правилами клиринга момента времени Даты исполнения Сделки перечислить на счет, используемый для расчетов по Сделке, денежные средства в сумме, достаточной для проведения указанных расчетов;

2.3.3. Стороны обязаны осуществлять иные действия и соблюдать иные требования, необходимые для проведения расчетов по Сделке в соответствии с Правилами клиринга.

2.3.4. Каждая из Сторон самостоятельно несет расходы, связанные с исполнением обязательств по Сделке.

Статья 3. Гарантии

3.1 Продавец гарантирует, что на момент Перерегистрации Пакета ЦБ он имеет все права, необходимые для передачи Покупателю прав на Пакет ЦБ, не обремененный залогом или иными правами третьих лиц, препятствующими передаче прав на Пакет ЦБ Покупателю.

3.2 В случае если Дата заключения Сделки приходится на период времени с даты принятия эмитентом решения о реорганизации в форме выделения по дате государственной регистрации юридического лица, образовавшегося в результате такой реорганизации, включая указанные даты, то это означает, что Стороны заключили:

1. Сделку купли-продажи ЦБ эмитента;

2. Предварительный договор о заключении в будущем (в срок не позднее 1 месяца с даты регистрации отчета об итогах выпуска ЦБ эмитента, образовавшегося в результате реорганизации) дополнительного соглашения к Сделке о дополнении Сделки обязанностью Продавца передать Покупателю дополнительно в счет уплаченной суммы Сделки ценные бумаги эмитента, образовавшегося в результате реорганизации, в

количестве, которое в соответствии с решением о реорганизации приходится на ЦБ реорганизованного эмитента, являющиеся предметом Сделки. Передача ЦБ эмитента, образовавшегося в результате реорганизации, должна быть осуществлена Продавцом в течение 10 (десяти) рабочих дней с даты получения соответствующих ЦБ Продавцом. При этом все расходы, связанные с передачей ЦБ эмитента, образовавшегося в результате реорганизации, несет Продавец.

Обязательство Продавца по передаче Покупателю ЦБ эмитента, образовавшегося в результате реорганизации в форме выделения, возникает в случае получения Продавцом, соответствующего количества ЦБ эмитента, образовавшегося в результате реорганизации.

3.3 Сумма Сделки включает в себя стоимость ЦБ эмитента, а также стоимость соответствующего количества ЦБ эмитента, образовавшегося в результате реорганизации эмитента.

3.4 Положения пункта 3.2 настоящих Условий распространяются на случаи реорганизации в форме выделения, когда размещение ЦБ эмитентов, образовавшихся в результате такой реорганизации, осуществляется путем распределения акций созданного при выделении акционерного общества среди акционеров акционерного общества, реорганизованного путем такого выделения.

Статья 4. Конфиденциальность

4.1 Продавец и Покупатель обязаны сохранять конфиденциальность условий Сделки для третьих лиц, кроме Биржи, Клиринговой организации, Технического(их) центра(ов) и органов, имеющих право требовать раскрытия информации об условиях Сделки в соответствии с российским законодательством.

4.2 Стороны вправе раскрыть информацию о виде ЦБ, объеме и цене Сделки в соответствии с правилами саморегулируемых организаций, членами которых они являются.

Статья 5. Обеспечение исполнения Сделки

5.1 В случае нарушения Продавцом гарантий, установленных пунктом 3.1. настоящих Условий, Продавец обязан выплатить Покупателю штраф в размере 10 (десяти) процентов от суммы Сделки.

5.2 Исполнение обязательств по Сделке обеспечивается в соответствии с Правилами клиринга.

5.3 Стороны не вправе в одностороннем порядке отказаться от исполнения обязательств по оплате и Перерегистрации Пакета ЦБ.

Статья 6. Обстоятельства непреодолимой силы

6.1 Ни одна из Сторон не несет ответственности в случае неисполнения или ненадлежащего исполнения ею какого-либо ее обязательства по Сделке, если указанные неисполнение или ненадлежащее исполнение обусловлены исключительно наступлением и/или действием обстоятельств непреодолимой силы.

6.2 Затронутая обстоятельствами непреодолимой силы Сторона без промедления, но не позднее, чем через 3 (три) рабочих дня после наступления обстоятельств непреодолимой силы, в письменной форме информирует другую Сторону об этих обстоятельствах и об их последствиях (с обратным уведомлением о получении сообщения) и принимает все возможные меры с целью максимально ограничить отрицательные последствия, вызванные указанными обстоятельствами непреодолимой силы.

6.3 Сторона, для которой создались обстоятельства непреодолимой силы, должна также без промедления, но не позднее, чем через 3 (три) рабочих дня известить в письменной форме другую Сторону о прекращении этих обстоятельств.

6.4 Неизвещение или несвоевременное извещение другой Стороны Стороной, для которой создалась невозможность исполнения обязательства по Сделке, о наступлении обстоятельств непреодолимой силы влечет за собой утрату права ссылаться на эти обстоятельства.

6.5 Освобождение обязанной Стороны от ответственности за неисполнение или ненадлежащее исполнение какого-либо неисполнимого обязательства по Сделке не влечет освобождение этой Стороны от ответственности за исполнение иных ее обязательств, не признанных Сторонами неисполнимыми по Сделке.

6.6 Наступление обстоятельств непреодолимой силы не влечет прекращения обязательств по Сделке.

Статья 7. Прочие условия

7.1 Расторжение Сделки, заключенной в Секторе рынка Standard, не допускается.

7.2 Истечение срока исполнения обязательств по Сделке влечет прекращение обязательств по такой Сделке.

7.3 Любой спор по Сделке подлежит рассмотрению в Третейском суде НАУФОР в соответствии с его Регламентом, действующим на момент подачи искового заявления. Решение Третейского суда НАУФОР будет являться для Сторон окончательным и обязательным и будет исполнено ими в сроки и в порядке, указанными в решении Третейского суда НАУФОР.

7.4 Все вопросы, не урегулированные настоящими Условиями, разрешаются в соответствии с гражданским законодательством Российской Федерации, иными нормативными правовыми актами Российской Федерации и внутренними нормативными документами Биржи.

ПРИЛОЖЕНИЕ №17

**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»**

**Условия сделок РЕПО, заключаемых с Центральным контрагентом в Секторе
рынка Standard**

Настоящие Условия сделок РЕПО, заключаемых с Центральным контрагентом в Секторе рынка Standard (далее – Условия), определяют условия Сделок РЕПО, заключаемых с Центральным контрагентом в Секторе рынка Standard в соответствии с настоящими Правилами, а также сделок РЕПО, заключаемых с Клиринговой организацией при осуществлении клиринга в случаях и порядке, предусмотренных Правилами клиринга (далее – Сделка).

Статья 1. Термины и определения

1.1 При заключении Сделки и исполнении обязательств по Сделке Стороны руководствуются нижеприведенными терминами и определениями:

Биржа – Закрытое акционерное общество «Фондовая биржа ММВБ».

Валюта сделки – валюта, в которой выражены обязательства по уплате Суммы покупки и Суммы обратного выкупа.

Дата исполнения второй части Сделки - дата, в которую Первоначальный продавец должен уплатить Первоначальному покупателю Сумму обратного выкупа, а Первоначальный покупатель должен передать Первоначальному продавцу Пакет ЦБ.

Дата исполнения первой части Сделки - дата, в которую Первоначальный покупатель должен уплатить Первоначальному продавцу Сумму покупки, а Первоначальный продавец должен передать Первоначальному покупателю Пакет ЦБ.

Доход - дивиденды, проценты, доход или иное распределение на ценные бумаги, составляющие Пакет ЦБ.

Клиринговая организация - Клиринговая организация, осуществляющая клиринг в Секторе рынка Standard, в соответствии с решением Биржи об определении Клиринговой организации.

Пакет ЦБ - совокупность ЦБ, в отношении которых заключена Сделка.

Первоначальный покупатель – Участник торгов или Центральный контрагент, обязанный в Дату исполнения первой части Сделки уплатить соответственно Центральному контрагенту или Участнику торгов, являющемуся Первоначальным продавцом, Сумму покупки.

Первоначальный продавец – Участник торгов или Центральный контрагент, обязанный в Дату исполнения первой части Сделки передать соответственно Центральному контрагенту или Участнику торгов, являющемуся Первоначальным покупателем, Пакет ЦБ.

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.

Правила торгов – Правила проведения торгов по ценным бумагам Закрытого акционерного общества «Фондовая биржа ММВБ».

Средства связи - Система электронного документооборота ОАО Московская Биржа, телекс, факс, системы S.W.I.F.T. или иные средства доставки информации, позволяющие достоверно установить, что документ исходит от соответствующей Стороны.

Срок Сделки – количество календарных дней, составляющих период с Даты исполнения первой части Сделки до Даты исполнения второй части Сделки, исключая Дату исполнения первой части Сделки, но включая Дату исполнения второй части Сделки.

Сторона, Стороны – Первоначальный покупатель или Первоначальный продавец.

Сумма обратного выкупа – сумма, подлежащая уплате Первоначальным продавцом Первоначальному покупателю в Дату исполнения второй части Сделки и определяемая в порядке, установленном настоящими Условиями.

Сумма покупки – сумма, подлежащая уплате Первоначальным покупателем Первоначальному продавцу в Дату исполнения первой части Сделки и определяемая в порядке, установленном Правилами торгов.

Ценные бумаги (ЦБ) - ценные бумаги в соответствии с законодательством страны государственной регистрации или местонахождения эмитента.

1.2 Любая ссылка в Условиях на письменное сообщение или сообщение в письменной форме означает документ или информацию, направленные с курьером, по почте или с использованием Средств связи.

1.3 Термины специально не определенные в настоящем приложении используются в значениях, установленных Правилами торгов, иными внутренними документами Биржи, Правилами клиринга, а также законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

Статья 2. Предмет Сделки

1.4 В Дату исполнения первой части Сделки Первоначальный продавец обязуется передать Первоначальному покупателю Пакет ЦБ, а Первоначальный покупатель обязуется принять Пакет ЦБ и уплатить Сумму покупки.

1.5 В Дату исполнения второй части Сделки Первоначальный покупатель обязуется передать Первоначальному продавцу Пакет ЦБ, а Первоначальный продавец обязуется принять и уплатить Первоначальному покупателю Сумму обратного выкупа. При этом указанные обязательства возникают при условии исполнения обязательств Сторон в Дату исполнения первой части Сделки.

1.6 Дата исполнения первой части Сделки, Дата исполнения второй части Сделки, наименование (код) ЦБ, в отношении которых заключена Сделка, количество ценных бумаг в Пакете ЦБ, Сумма покупки, Сумма обратного выкупа и Валюта сделки определяются в соответствии с Правилами торгов или Правилами клиринга.

Статья 3. Оплата и передача Пакета ЦБ

3.1 Передача Пакета ЦБ и уплата Суммы покупки и Суммы обратного выкупа осуществляются в соответствии с Правилами клиринга. При этом:

3.1.1. Участник клиринга, являющийся Первоначальным продавцом, обязан в Дату исполнения первой части Сделки до определенного в соответствии с Правилами торгов и Правилами клиринга момента времени обеспечить на торговом счете депо наличие Пакета ЦБ в количестве, достаточном для проведения указанных расчетов;

3.1.2. Участник клиринга, являющийся Первоначальным покупателем, обязан в Дату исполнения первой части Сделки до определенного в соответствии с Правилами торгов и Правилами клиринга момента времени обеспечить на денежном торговом счете (денежном клиринговом регистре) наличие денежных средств в сумме, достаточной для проведения указанных расчетов;

3.1.3. Участник клиринга, являющийся Первоначальным покупателем, обязан в Дату исполнения второй части Сделки до определенного в соответствии с Правилами торгов и Правилами клиринга момента времени обеспечить на торговом счете депо наличие Пакета ЦБ в количестве, достаточном для проведения указанных расчетов;

3.1.4. Участник клиринга, являющийся Первоначальным продавцом, обязан в Дату исполнения второй части Сделки до определенного в соответствии с Правилами торгов и Правилами клиринга момента времени обеспечить на денежном торговом счете (денежном клиринговом регистре) наличие денежных средств в сумме, достаточной для проведения указанных расчетов;

3.1.5. Стороны обязаны осуществлять иные действия и соблюдать иные требования, необходимые для проведения расчетов по Сделке в соответствии с Правилами клиринга и условиями осуществления депозитарной деятельности Расчетного депозитария.

3.2 Каждая из Сторон самостоятельно несет расходы, связанные с исполнением обязательств по Сделке.

3.3 Досрочное исполнение обязательств по Сделке не допускается.

Статья 4. Заверения и гарантии Сторон

4.1 Каждая Сторона считается предоставившей другой Стороне заверения и гарантии, что:

4.1.1. Ценные бумаги, передаваемые ею по Сделке, не являются предметом спора или каких-либо требований, не арестованы, не заложены и иным образом не обременены; и

4.1.2. она является добросовестным продавцом Ценных бумаг, передаваемых ею по Сделке, и ей неизвестно об обстоятельствах, указанных в пункте 4.1.1 настоящих Условий.

Статья 5. Выплата дохода и случаи реорганизации эмитента ценных бумаг

5.1 В случае если с Даты исполнения первой части Сделки (включая эту дату) до Даты исполнения второй части Сделки (не включая эту дату) составляется список лиц, имеющих право на получение Дохода, Первоначальный покупатель обязуется передать Первоначальному продавцу сумму, равную сумме Дохода, приходящейся на Пакет ЦБ (передать ценные бумаги, составляющие Доход, в количестве, приходящемся на Пакет ЦБ) при условии раскрытия эмитентом ЦБ информации о факте исполнения своих обязательств по выплате Дохода. Порядок и сроки передачи Дохода в форме денежных средств, а также сумма такого Дохода, подлежащая передаче, определяются Правилами клиринга. Иной Доход Первоначальный покупатель передает Первоначальному продавцу в течение 10 (десяти) рабочих дней, следующих за днем получения Первоначальным покупателем такого Дохода.

5.2 В случае если с Даты исполнения первой части Сделки (включая эту дату) до Даты исполнения второй части Сделки (не включая эту дату) эмитентом ЦБ принято

решение о реорганизации в форме выделения, то это означает, что Стороны одновременно со Сделкой заключили предварительный договор о заключении в будущем (в срок не позднее 1 месяца с даты регистрации отчета об итогах выпуска ценных бумаг эмитента, образовавшегося в результате реорганизации эмитента ЦБ) соглашения, в соответствии с которым Первоначальный покупатель обязан передать Первоначальному продавцу дополнительно в счет уплаченной Суммы обратного выкупа ценные бумаги эмитента (эмитентов), образовавшегося в результате реорганизации, в количестве, которое в соответствии с решением о реорганизации приходится на Пакет ЦБ реорганизованного эмитента. Передача ценных бумаг эмитента (эмитентов), образовавшегося в результате реорганизации, должна быть осуществлена Первоначальным покупателем в течение 10 (десяти) рабочих дней с даты получения им соответствующих ценных бумаг. При этом все расходы, связанные с передачей ценных бумаг эмитента, образовавшегося в результате реорганизации, несет Первоначальный покупатель.

Статья 6. Обстоятельства непреодолимой силы

6.1 Ни одна из Сторон не несет ответственности в случае неисполнения или ненадлежащего исполнения ею какого-либо ее обязательства по Сделке, если указанные неисполнение или ненадлежащее исполнение обусловлены обстоятельствами непреодолимой силы.

6.2 Затронутая обстоятельствами непреодолимой силы Сторона без промедления, но не позднее, чем через 3 (три) рабочих дня, в соответствии с нормативными правовыми актами Российской Федерации, после наступления обстоятельств непреодолимой силы, в письменной форме информирует другую Сторону об этих обстоятельствах и об их последствиях (с обратным уведомлением о получении сообщения) и принимает все возможные меры с целью ограничения отрицательных последствий, вызванных указанными обстоятельствами непреодолимой силы.

6.3 Сторона, для которой создались обстоятельства непреодолимой силы, должна также без промедления, но не позднее, чем через 3 (три) рабочих дня в соответствии с нормативными правовыми актами Российской Федерации известить в письменной форме другую Сторону о прекращении этих обстоятельств.

6.4 Неизвещение или несвоевременное извещение другой Стороны Стороной, для которой создавалась невозможность исполнения обязательства по Сделке, о наступлении обстоятельств непреодолимой силы влечет за собой утрату права ссылаться на эти обстоятельства.

Статья 7. Применимое право и порядок разрешения споров

7.1 Все вопросы, не урегулированные Условиями, разрешаются в соответствии с нормативными правовыми актами Российской Федерации, а также документами Биржи и Клиринговой организации.

7.2 Споры, возникающие из Сделок или в связи с ними, в том числе касающиеся их исполнения, нарушения, прекращения или недействительности, подлежат разрешению в Третейском суде НАУФОР в соответствии с его Регламентом, действующим на момент подачи искового заявления. Решение Третейского суда НАУФОР будет являться для Сторон окончательным и обязательным и будет исполнено ими в сроки и в порядке, указанными в решении Третейского суда НАУФОР.

Статья 8. Иные положения

8.1 Расторжение и изменение условий Сделки не допускается.

Стороны согласились, что в Условия могут быть внесены изменения и/или дополнения в одностороннем порядке по решению Биржи. Указанные изменения и/или дополнения вступают в силу в сроки, установленные таким решением.

ПРИЛОЖЕНИЕ №18

**к Правилам проведения торгов по ценным бумагам
в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ»**

Методика определения цен закрытия ценных бумаг

1. Общие положения

1.1. Настоящая Методика определяет правила и порядок определения Биржей цен закрытия ценных бумаг, требования к которым установлены законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

1.2. Цены закрытия ценных бумаг определяются по всем ценным бумагам, допущенным к торгам на Бирже.

2. Порядок определения цен закрытия ценных бумаг

2.1. Цена закрытия ценной бумаги определяется по состоянию на момент окончания Основной торговой сессии один раз в течение торгового дня.

2.2. В случае если по ценной бумаге проводится аукцион закрытия, цена закрытия приравнивается к цене аукциона закрытия, проводимого по окончании торгового периода, либо по окончании послеторгового периода.

2.3. В случае если по ценной бумаге проводится аукцион закрытия, и цена аукциона закрытия по ценной бумаге не определена, то цена закрытия не определяется.

2.4. Если по ценной бумаге не проводится аукцион закрытия, цена закрытия приравнивается к последней рассчитанной текущей цене на момент окончания Основной торговой сессии.