

ПРАВИЛА ТОРГОВ

Оглавление

Глава I. Общие положения	3
Статья 1. Термины и определения	3
Статья 2. Общие положения	5
Глава II. Допуск к Торгам	8
Статья 3. Допуск Qualified Investments к Торгам	8
Статья 4. Допуск Участников торгов к участию в Торгах	8
Глава III. Маркет-мейкеры	8
Статья 5. Требования к Маркет-мейкерам	8
Статья 6. Порядок осуществления функций и обязанностей Маркет-мейкеров	9
Глава IV. Общие положения о порядке проведения Торгов	9
Статья 7. Время проведения Торгов	9
Статья 8. Заявки	10
Статья 9. Условия и порядок подачи Заявок	10
Статья 10. Реестр Заявок	13
Статья 11. Порядок заключения и исполнения Договоров	14
Статья 12. Ведение реестра Договоров	16
Статья 13. Порядок взаимодействия Компании и Клиринговой организации	17
Глава V. Проведение Торгов в Режиме основных торгов	17
Статья 14. Котировки	18
Статья 15. Порядок подачи Заявок в периоде непрерывного аукциона	19
Статья 16. Порядок заключения Договоров в периоде непрерывного аукциона	24
Статья 17. Порядок подачи Заявок и заключения Договоров в периоде аукциона закрытия	27
Глава VI. Проведение Торгов в Режиме торгов RFQ	29
Статья 18. Запросы на котировку	29
Статья 19. Порядок подачи Заявок	31
Статья 20. Порядок заключения Договоров	32
Глава VII. Проведение Торгов в Режиме переговорных сделок	33
Статья 21. Порядок подачи Заявок	33
Статья 22. Порядок заключения Договоров	33
Глава VIII. Проведение Торгов в Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом»	34
Статья 23. Порядок подачи Заявок репо	34
Статья 24. Порядок заключения Договоров репо	35
Глава IX. Проведение Торгов в Режиме торгов «Безадресное репо с Центральным контрагентом»	37
Статья 25. Порядок подачи Заявок	37
Статья 26. Порядок заключения Договоров	38
Глава X. Проведение Торгов в Режиме торгов «Адресные валютные свопы с Центральным контрагентом»	39
Статья 27. Порядок подачи Заявок валютный своп	39
Статья 28. Порядок заключения Валютных свопов	40
Глава XI. Проведение Торгов в Режиме торгов «Безадресные валютные свопы с Центральным контрагентом»	42
Статья 29. Порядок подачи Заявок	42
Статья 30. Порядок заключения Валютных свопов	42
Глава XII. Иные положения	43
Статья 31. Приостановка, возобновление и прекращение Торгов	43
Статья 32. Информация, связанная с ходом и итогами Торгов	44
Статья 33. Информация о Торгах	45
Статья 34. Определение тарифов Компании	45
Статья 35. Порядок оплаты услуг Компании	45
Статья 36. Порядок осуществления контроля за Участниками торгов и контроля за операциями	46
Статья 37. Ответственность	46
Статья 38. Порядок разрешения споров и применимое законодательство.	47
Статья 39. Правила предотвращения, выявления и пресечения случаев неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком	47
Приложение №1	48
Приложение №2	49

Глава I. Общие положения

Статья 1. Термины и определения

Аналог собственноручной подписи/АСП – реквизит Заявки или иного электронного сообщения, направляемого в Систему проведения торгов, позволяющий 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.

Группа инструментов – совокупность Qualified Investments, формируемая Компанией в соответствии с настоящими Правилами в целях подачи Заявок и заключения Договоров.

Дата исполнения – Торговый день, в который в соответствии с условиями заключенного Договора, Правилами клиринга и настоящими Правилами обязательства по указанному Договору подлежат исполнению.

Договор – договор, заключаемый на Торгах.

Договор купли-продажи – Договор, являющийся договором купли-продажи Qualified Investments.

Валютный своп – два связанных между собой договора купли-продажи Qualified Investments, являющихся валютами, входящими в валютную пару, которые соответствуют одновременно следующим условиям:

- оба договора заключаются между одними и теми же Участниками торгов;
- в соответствии с условиями первого договора купли-продажи одна сторона (продавец по валютному свопу) обязуется в срок, установленный этим договором, передать в собственность другой стороне (покупателю по валютному свопу) Qualified Investments, а покупатель по валютному свопу обязуется принять Qualified Investments и уплатить за них определенную сумму в валюте, за которую происходит покупка или продажа Qualified Investments (первая часть валютного свопа);
- в соответствии с условиями второго договора купли-продажи покупатель по валютному свопу обязуется в срок, установленный этим договором, передать Qualified Investments в собственность продавца по валютному свопу, а продавец по валютному свопу обязуется принять Qualified Investments и уплатить за них определенную сумму в валюте, за которую происходит покупка или продажа Qualified Investments по первой части Валютного свопа (вторая часть валютного свопа).

Договор репо – договор, по которому одна сторона (продавец по договору репо) обязуется в срок, установленный этим договором, передать в собственность другой стороне (покупателю по договору репо) Qualified Investments, не являющимися валютой, входящей в валютную пару, а покупатель по договору репо обязуется принять Qualified Investments, не являющимися валютой, входящей в валютную пару, и уплатить за них определенную денежную сумму (первая часть договора репо) и по которому покупатель по договору репо обязуется в срок, установленный этим договором, передать Qualified Investments, не являющимися валютой, входящей в валютную пару, в собственность продавца по договору репо, а продавец по договору репо обязуется принять Qualified Investments, не являющимися валютой, входящей в валютную пару, и уплатить за них определенную денежную сумму (вторая часть договора репо).

Заявка – предложение и (или) принятие предложения заключить один или несколько Договоров на Торгах.

Заявка на покупку – Заявка, представляющая собой предложение и (или) принятие предложения заключить один или несколько Договоров купли-продажи, в которых Участник торгов, объявивший Заявку, является покупателем.

Заявка на продажу – Заявка, представляющая собой предложение и (или) принятие предложения заключить один или несколько Договоров купли-продажи, в которых Участник торгов, объявивший Заявку, является продавцом.

Заявка валютный своп – Заявка, представляющая собой предложение и (или) принятие предложения заключить один или несколько Валютных свопов.

Заявка валютный своп на покупку – Заявка валютный своп, представляющая собой предложение и (или) принятие предложения заключить один или несколько Валютных свопов, в которых Участник торгов, объявивший Заявку, является покупателем по Валютному свопу.

Заявка валютный своп на продажу – Заявка Валютный своп, представляющая собой предложение и (или) принятие предложения заключить один или несколько Валютных свопов, в которых Участник торгов, объявивший Заявку, является продавцом по Валютному свопу.

Заявка репо – Заявка, представляющая собой предложение и (или) принятие предложения заключить один или несколько Договоров репо.

Заявка репо на покупку – Заявка репо, представляющая собой предложение и (или) принятие предложения заключить один или несколько Договоров репо, в которых Участник торгов, объявивший Заявку, является покупателем по Договору репо.

Заявка репо на продажу – Заявка репо, представляющая собой предложение и (или) принятие предложения заключить один или несколько Договоров репо, в которых Участник торгов, объявивший Заявку, является продавцом по Договору репо.

Запрос на котировку – подаваемое в установленном настоящими Правилами порядке приглашение делать оферты в Режиме торгов RFQ.

Идентификатор адресных сделок – Идентификатор адресных сделок, присвоенный Участнику торгов в соответствии с Правилами допуска и (или) внутренними документами Компании.

Идентификатор Участника торгов – Идентификатор Участника торгов, присвоенный Участнику торгов в соответствии с Правилами допуска и (или) внутренними документами Компании.

Имя – пользовательское имя (логин), представляющее собой уникальное условное обозначение, однозначно определяющее Участника торгов, присвоенное Участнику торгов для доступа к Системе проведения торгов.

Клиент – клиент Участника торгов и/или иное лицо, в интересах которого Участник торгов заключает Договор, зарегистрированное Компанией в установленном порядке.

Код расчетов – код, устанавливаемый Компанией и определяющий условия регистрации Заявки в реестре Заявок, Дату исполнения, порядок и условия исполнения Договора, предусмотренные Правилами клиринга.

Компания – International Trading System Limited ("ITS Ltd."), лицензированная AFSA для осуществления деятельности в качестве оператора многосторонней торговой платформы.

Котировка – подаваемое в установленном настоящими Правилами порядке приглашение делать оферты в Режиме основных торгов.

Краткий код Клиента – краткий код клиента, присваиваемый Клиенту в соответствии с Правилами допуска и (или) внутренними документами Компании.

Лот – количество Qualified Investments, установленное Компанией для каждой Qualified Investment, которому должно быть кратно количество Qualified Investments, указанное в Заявке.

Маркет-мейкер – Участник торгов, который на основании договора, одной из сторон которого является Компания, принимает на себя обязательства по поддержанию цен, спроса, предложения и (или) объема торгов Qualified Investments на Торгах на условиях, установленных таким договором.

Обрабатываемая Заявка – Объявленная Заявка до момента ее постановки в Очередь заявок.

Объявленная Заявка – Поданная Заявка, зарегистрированная в реестре Заявок.

Объявленная Котировка – Котировка, зарегистрированная в реестре Котировок.

Очередь заявок – упорядоченная последовательность Объявленных Заявок одинаковой направленности, формируемая в порядке, определенном настоящими Правилами.

Очередь котировок – упорядоченная последовательность Объявленных Котировок одинаковой направленности, формируемая в порядке, определенном настоящими Правилами.

Пароль – уникальная последовательность случайных букв, и (или) чисел, и (или) иных символов, используемая для аутентификации Участника торгов, присвоенная Участнику торгов для доступа к Системе проведения торгов.

Поданная Заявка – Заявка, зафиксированная с использованием Системы проведения торгов в соответствии с пунктом 9.2. настоящих Правил, но не зарегистрированная в реестре Заявок.

Правила допуска – внутренний документ ITS Ltd. , определяющий условия и порядок допуска к участию в Торгах, приостановления, возобновления и прекращения допуска к участию в Торгах, требования к Участникам торгов, требования к способам и периодичности идентификации Участников торгов, порядок ведения Компанией реестра Участников торгов и реестра Клиентов.

Правила клиринга – внутренний документ Центрального контрагента, в котором установлен порядок определения, учета и исполнения обязательств по Договорам.

Правила допуска Qualified Investments к торгам – внутренний документ Компании, устанавливающий правила допуска Qualified Investments к Торгам.

Режим торгов – совокупность условий и порядка проведения Торгов, установленная настоящими Правилами.

Рутинговый агент – Центральный контрагент, Участник торгов, действующий от своего имени и за свой счёт, заключивший с Компанией договор на оказание услуг по подаче Заявок дополнительной ликвидности, и/или Участник торгов, действующий от своего имени и за счёт Клиента, заключившего с Компанией договор на оказание услуг по подаче Заявок дополнительной ликвидности за счёт указанного Клиента, или Клиент, заключивший с Компанией договор,

предметом которого является оказание услуг по подаче указанным лицом или за счёт указанного лица Заявок дополнительной ликвидности (как они определены настоящими Правилами).

Система проведения торгов – совокупность вычислительных средств, программного обеспечения, баз данных, телекоммуникационных средств и другого оборудования, обеспечивающих возможность поддержания, хранения, обработки и раскрытия информации, необходимой для проведения Торгов.

Система электронного документооборота – организационно-техническая система технического центра, определенного Компанией, информация о котором раскрыта на сайте Компании в сети Интернет, представляющая собой совокупность программного обеспечения, баз данных и вычислительных средств, обеспечивающая обмен Электронными документами, подписанными Электронной подписью.

Список – список Qualified Investments, допущенных к Торгам в порядке, предусмотренном Правилами допуска Qualified Investments к Торгам.

Ставка репо – положительная, отрицательная или равная нулю величина, выраженная в процентах годовых, указываемая Участником торгов в Заявке репо, и используемая для расчета цены второй части Договора репо или суммы второй части Договора репо.

Торги – торги Qualified Investments, проводимые Компанией в соответствии с требованиями настоящих Правил и Правил клиринга.

Торговый день – период времени, в течение которого в соответствии с настоящими Правилами Компания проводит Торги.

Торгово-клиринговый счет – Торгово-клиринговый счет в значении, установленном Правилами клиринга.

Участник торгов – юридическое лицо, с которым у Компании заключен и действует договор об оказании услуг по проведению торгов.

Цена Валютного свопа - положительное, отрицательное или равное нулю количество Шагов цены Валютного свопа, указываемое Участником торгов в Заявке валютный своп, и используемая для расчета цены второй части Валютного свопа или суммы второй части Валютного свопа.

Центральный контрагент – International Trading System Limited («ITS Ltd.»), лицензированная AFSA для осуществления рыночной деятельности по управлению клиринговой организацией, действующей в качестве Центрального контрагента («ЦК»).

Шаг цены – значение, которому должна быть кратна цена, указанная в Заявке на покупку/Заявке на продажу, или значение, которому должна быть кратна цена первой части Договора репо, указываемая в Заявках репо на покупку/Заявках репо на продажу, или значение, которому должна быть кратна цена первой части Валютного свопа, указываемая в Заявках валютный своп на покупку/Заявках валютный своп на продажу.

Шаг цены Валютного свопа – количество пунктов изменения цены Qualified Investments, являющихся валютами, входящими в валютную пару.

Шаг ставки репо – значение, которому должна быть кратна Ставка репо, указываемая в Заявках репо на покупку/Заявках репо на продажу.

Электронный документ – документированная информация, представленная в электронной форме, то есть в виде, пригодном для восприятия с использованием электронных вычислительных машин, а также для передачи по информационно-телекоммуникационным сетям или обработки в Системе электронного документооборота.

Электронная подпись – информация в электронной форме, которая присоединена к другой информации в электронной форме (подписываемой информации) или иным образом связана с такой информацией и которая используется для определения лица, подписывающего информацию.

Термины, специально не определенные в настоящих Правилах, используются в значениях, установленных иными внутренними документами Компании, Правилами допуска, Правилами допуска Qualified Investments к торгам, Правилами клиринга, а также Правилами и Положениями AIFC.

Статья 2. Общие положения

2.1. Настоящие Правила приняты в соответствии с положениями нормативных документов и правил Международного финансового центра «Астана» (далее – МФЦА), а также устава и иных документов Компании.

2.2. Настоящие Правила устанавливают условия и порядок проведения Торгов.

2.3. Компания вправе в одностороннем порядке вносить изменения в настоящие Правила. Изменения в настоящие Правила вступают в силу в порядке и сроки, установленные в настоящей статье.

Настоящие Правила утверждаются Советом директоров Компании после прохождения процедуры, описанной в настоящей статье.

Если иное не определено решением МФЦА, до вступления в силу изменений в настоящие Правила, данные изменения должны:

- быть доступны для публичных консультаций; и
- быть одобрены МФЦА.

В соответствии с решением МФЦА публичные консультации могут не проводиться в случаях чрезвычайной ситуации, форс-мажорных обстоятельств, типографских ошибок, незначительных административных вопросов или для соблюдения применимых законов. В данном случае Компания публикует на сайте Компании в сети Интернет новую редакцию настоящих Правил после ее утверждения Советом директоров Компании в течение 2 (двух) Торговых дней.

Публичные консультации проводятся по следующим правилам:

- 1) Компания должна на своем сайте в сети Интернет опубликовать консультационный документ, в котором изложены:
 - как текст предлагаемых изменений, так и текст Правил торгов, которые должны быть изменены;
 - причины предложенных изменений;
 - приемлемый период консультаций, который должен составлять не менее 30 (тридцати) календарных дней после даты публикации на сайте Компании в сети Интернет, в течение которого могут быть предоставлены комментарии (замечания, предложения);
 - адрес обратной связи, который будет использоваться Компанией для получения комментариев (замечаний, предложений) по консультационному документу.
- 2) В тот же день, когда консультационный документ будет опубликован на сайте Компании в сети Интернет, Компания представит такой же консультационный документ в МФЦА.
- 3) По окончании приемлемого периода консультаций, Компания обрабатывает все поступившие комментарии (замечания, предложения) в течение не более 20 (двадцати) календарных дней.
- 4) На разумных основаниях Компания может продлить приемлемый период консультаций и период времени, в течение которого Компания обрабатывает все поступившие комментарии (замечания, предложения). Компания размещает информацию о продлении сроков на сайте Компании в сети Интернет и одновременно с таким размещением информирует МФЦА об указанном решении.
- 5) Компания рассматривает комментарии (замечания, предложения) по консультационному документу только в случае, если указанные комментарии (замечания, предложения) пришли на адрес обратной связи, указанный в консультационном документе.
- 6) Компания не ограничивает круг лиц, которые могут прислать свои комментарии (замечания, предложения) к изменениям в Правила торгов. При этом Компания в приоритетном порядке рассматривает комментарии (замечания, предложения) к изменениям в Правила торгов, предоставленные Участниками торгов и МФЦА. Комментарии (замечания, предложения), предоставленные иными лицами, рассматриваются Компанией в случае наличия обоснованных комментариев (замечаний, предложений). Компания публикует причину отказа от внесения комментария (замечания, предложения) только в случае их направлений Участниками торгов.
- 7) Компания на своем сайте в сети Интернет публикует мотивированное решение по итогам рассмотрения комментариев (замечаний, предложений) о необходимости внесения изменений в настоящие Правила и итоговую редакцию настоящих Правил с учетом принятых комментариев (замечаний, предложений), отраженных в мотивированном решении.
- 8) В дату публикации мотивированного решения на сайте Компании в сети Интернет Компания направляет указанное мотивированное решение в МФЦА.
- 9) В случае существенности планируемых изменений в настоящие Правила, и (или) по решению Компании и (или) МФЦА мотивированное решение может содержать срок для повторных публичных консультаций, общий срок которых с учетом срока для имплементации новых комментариев (замечаний, предложений) и размещения нового мотивированного решения не должен превышать 20 календарных дней.
- 10) Компания может до момента утверждения настоящих Правил Правлением Компании рассмотреть данные Правила в Комитете по рискам.
- 11) Настоящие Правила в новой редакции, с учетом мотивированного решения, указанного в настоящем подпункте 7 или 9, направляются на рассмотрение Советом директоров Компании.

Если необходимо безотлагательно внести изменения в Правила торгов, чтобы обеспечить непрерывное соблюдение требований к авторизации или других правовых обязательств, Компания публикует на сайте Компании в сети Интернет новую редакцию настоящих Правил после ее утверждения Советом директоров Компании в течение 2 (двух) Торговых дней.

Компания вправе проводить публичные консультации исключительно с членами Комитета по рискам в случае внесения ограниченных технических изменений в настоящие Правила торгов.

Компания вправе проводить неформальное обсуждение на ранней стадии с членами Комитета по рискам, чтобы обсудить предлагаемые изменения в настоящие Правила. В случае проведения неформального обсуждения на ранней стадии Компания совместно с Комитетом по рискам принимают решение о готовности направления настоящих Правил на публичные консультации.

2.4. Компания оказывает услуги по проведению Торгов, которые включают в себя:

- предоставление возможности заключения Договоров в соответствии с требованиями нормативных документов и правил МФЦА;

обмен информацией и обеспечение взаимодействия с Центральным контрагентом, необходимые для проведения торгов и исполнения обязательств по заключенным Договорам.

- контроль за выполнением Участниками торгов требований настоящих Правил и иных внутренних документов Компании, регулирующих порядок оказания услуг по проведению Торгов.

2.5. Компания проводит Торги, клиринг по итогам которых осуществляется с участием Центрального контрагента в следующих Режимх торгов:

1) Режим основных торгов;

2) Режим торгов RFQ;

3) Режим переговорных сделок;

4) Адресное репо с Центральным контрагентом;

5) Безадресное репо с Центральным контрагентом;

6) Адресные валютные свопы с Центральным контрагентом;

7) Безадресные валютные свопы с Центральным контрагентом.

2.6. Режим основных торгов и Режим безадресных торгов могут состоять из непрерывного аукциона и аукциона закрытия. При проведении Торгов в рамках непрерывного аукциона возможность подачи Заявок и заключения Договоров существует в течение всего времени проведения непрерывного аукциона, с учетом особенностей, установленных настоящими Правилами. При проведении Торгов в рамках аукциона закрытия возможность подачи Заявок и заключения Договоров ограничена временем проведения соответствующих последовательных периодов, определенных настоящими Правилами.

В рамках одного или нескольких Режимов торгов Компанией могут быть установлены один или несколько периодов проведения торгов. Компания вправе устанавливать период (периоды) проведения торгов по одной или нескольким Qualified Investments, и (или) по одной или нескольким Группам инструментов, и (или) по одному или нескольким Кодам расчетов. При этом может быть установлен период (периоды), в ходе которого допускается объявление только Заявок определенного вида (направленности).

2.7. Для целей заключения Договоров Компания вправе устанавливать Шаг цены и (или) Шаг ставки репо и (или) Шаг цены Валютного свопа для отдельных Режимов торгов, и (или) Qualified Investments, и (или) Групп инструментов.

Если иное не установлено решением Компании, Шаг цены в отношении Qualified Investments, являющихся облигациями, равен 0,01 (ноль целых одной сотой) процента от номинальной стоимости Qualified Investments.

Если иное не установлено решением Компании, Шаг ставки репо равен 0,01 (ноль целых одной сотой) процента годовых.

Если иное не установлено решением Компании, Шаг цены Валютного свопа равен 0,0001 единицы цены Qualified Investments, являющихся валютами, входящими в валютную пару.

2.8. Решением Компании по Qualified Investments и (или) Группе инструментов может быть ограничена (возобновлена) возможность заключения Договоров в одном или нескольких Режимх торгов, одной или нескольких торговых сессиях, и (или) в отдельных периодах проведения торгов, и (или) возможность заключения Договоров с указанием одного или нескольких Кодов расчетов.

2.9. Раскрытие информации в Системе проведения торгов и (или) на сайте Компании в сети Интернет считаются надлежащими способами информирования Участников торгов.

2.10. В случае если в соответствии с настоящими Правилами Заявка/Заявка репо/Котировка/Запрос на котировку удаляются Компанией по окончании Торгового дня и при этом такой Торговый день включает в себя один или несколько календарных дней, в течение которых проводится дополнительная торговая сессия данного Торгового дня без проведения основной торговой сессии в течение указанных календарных дней, то указанные Заявки/Заявки репо/Котировки/Запросы на котировку удаляются Компанией по окончании проведения Торгов в

рамках каждого указанного календарного дня, в течение которых проводится дополнительная торговая сессия.

Глава II. Допуск к Торгам

Статья 3. Допуск Qualified Investments к Торгам

3.1. Договоры на Торгах заключаются в отношении Qualified Investments, включенных в Список.

3.2. Qualified Investments, включенные в Список, допускаются к Торгам в одном или нескольких Режимов торгов по решению Компании.

3.3. Компания вправе приостановить или прекратить допуск к торгам Qualified Investments, заключение сделок с которым не соответствует требованиям настоящих Правил. Указанные в настоящем пункте положения не применяются в случаях, если такой шаг может нанести значительный ущерб интересам инвесторов или устойчивому функционированию соответствующего рынка.

3.4. В случае получения соответствующего предписания от Комитета МФЦА Компания обязана приостановить или прекратить допуск Qualified Investments.

3.5. При приостановке или прекращении допуска к торгам Qualified Investments по основаниям, указанным в пунктах 3.3 и 3.4 настоящих Правил Компания предоставляет Участникам торгов возможность закрытия позиций, если иного прямо не предусмотрено в предписании Комитета МФЦА.

Статья 4. Допуск Участников торгов к участию в Торгах

4.1. Возможность подавать Заявки на Торгах и заключать Договоры предоставляется Участникам торгов, допущенным к торгам в соответствии с Правилами членства. Центральный контрагент вправе подавать Заявки в случаях, предусмотренных в настоящих Правилах.

4.2. Участники торгов в ходе Торгов обязаны соблюдать требования нормативных документов и правил МФЦА, регулирующего порядок проведения Торгов, настоящих Правил и Правил клиринга.

4.3. Участники торгов должны добросовестно осуществлять деятельность на Торгах, при этом воздерживаться от действий, влекущих за собой негативные последствия как для других Участников торгов и их Клиентов, так и для Компании.

4.4. При возникновении конфликтных ситуаций Участники торгов должны предпринимать все возможные действия для разрешения их путём переговоров, не допуская предвзятости, а также публичного распространения сведений, порочащих деловую репутацию партнёров.

4.5. Участник торгов вправе устанавливать лимит доступных денежных средств (лимит на объем обеспечения в денежном эквиваленте), лимит по Qualified Investments и (или) лимит по объему обязательств по Qualified Investments. Указанные лимиты (ограничения) могут быть установлены в отношении:

- Краткого кода Клиента, в том числе в отношении краткого кода Маркет-мейкера;
- группы Кратких кодов Клиента;
- Торгово-клирингового счета.

В случае установления лимитов, указанных в настоящем пункте, Участник торгов передаёт Компании указанную информацию. Компания имеет право передавать информацию о лимитах, полученную от Участника торгов, Центральному контрагенту.

Глава III. Маркет-мейкеры

Статья 5. Требования к Маркет-мейкерам

5.1. Участник торгов, желающий выполнять обязанности Маркет-мейкера, обязан заключить с Компанией договор провайдера ликвидности.

5.2. Договор провайдера ликвидности может быть заключен, если лицо, желающее выполнять указанные обязательства, надлежащим образом зарегистрировано в качестве Участника торгов, а также соблюдает требования, предъявляемые к Участникам торгов в соответствии с Правилами допуска.

5.3. Компания осуществляет контроль за деятельностью Маркет-мейкеров.

5.4. При заключении Участником торгов договора провайдера ликвидности в указанном договоре указывается Краткий код Клиента, в интересах и за счет которого (которых) Участник торгов выполняет обязательства Маркет-мейкера (в случае если Участник торгов выполняет обязательства Маркет-мейкера в интересах и за счет Клиента), либо Краткий код Участника торгов (в случае если выполнение обязательств Маркет-мейкера осуществляется за счет данного Участника торгов) (далее совместно именуемые - краткий код Маркет-мейкера).

Статья 6. Порядок осуществления функций и обязанностей Маркет-мейкеров

6.1. Маркет-мейкер при исполнении договора провайдера ликвидности может заключать Договоры от своего имени и за свой счет либо от своего имени и в интересах и за счет Клиента (Клиентов) Маркет-мейкера.

6.2. Исполнение договора провайдера ликвидности осуществляется в соответствии с требованиями настоящих Правил и договора провайдера ликвидности.

6.3. В договоре провайдера ликвидности устанавливаются требования, в том числе требования к спреду двусторонней котировки, к минимальному объему подаваемых Маркет-мейкером Заявок на покупку (Заявок на продажу), периоду времени, в течение которого Маркет-мейкер обязан подавать соответствующие Заявки, к порядку определения минимальной цены предложения на продажу и (или) максимальной цены предложения на покупку по подаваемым Маркет-мейкером Заявкам на покупку (Заявкам на продажу) соответственно.

6.4. Компания вправе освободить Маркет-мейкера от исполнения обязательств по договору провайдера ликвидности, в том числе в случае достижения Маркет-мейкером максимального объема Договоров, заключенных на основании Заявок на покупку (Заявок на продажу), поданных указанным Маркет-мейкером, или в случае достижения Маркет-мейкером максимального размера нетто-позиций, которые могут возникать в результате заключения Договоров на основании Заявок на покупку (Заявок на продажу), поданных указанным Маркет-мейкером.

6.5. Компания вправе осуществлять ежедневный контроль за деятельностью Маркет-мейкеров в ходе Торгового дня на предмет выполнения Маркет-мейкером обязательств, установленных договора провайдера ликвидности, в частности по следующим параметрам:

- спред двусторонней котировки;
- объем двусторонней котировки;
- период Торгового дня/торговой сессии, в ходе которого Маркет-мейкер выполняет обязательства;
- прочие параметры, установленные договором провайдера ликвидности.

6.6. Компания вправе посредством Системы проведения торгов информировать Маркет-мейкера о текущих обязательствах по каждой Qualified Investments в отдельности, включая, но не ограничиваясь параметрами, перечисленными в пункте 6.5. настоящих Правил, а также о статусе выполнения обязательств в текущий момент и продолжительности выполнения обязательств за Торговый день/торговую сессию по каждой Qualified Investments в долях от общей продолжительности установленного договором провайдера ликвидности периода выполнения обязательств.

Глава IV. Общие положения о порядке проведения Торгов

Статья 7. Время проведения Торгов

7.1. Компания проводит Торги ежедневно, если иное не установлено настоящими Правилами.

Компания вправе принять решение об отмене проведения Торгов в одном или нескольких Режимов торгов, в одной или нескольких торговых сессиях, и (или) в одном или нескольких периодах, и (или) Торгов по одной или нескольким Qualified Investments, и (или) Торгов по одной или нескольким Группам инструментов, и (или) Торгов по одному или нескольким Кодам расчетов.

7.2. Торговый день состоит из основной торговой сессии и одной или нескольких дополнительных торговых сессий (в случае их проведения).

Основная торговая сессия проводится с 13.00 до 22.00 по казахстанскому времени. Решением Компании может быть установлено иное время проведения основной торговой сессии, в том числе для отдельных Режимов торгов, для одной или нескольких Qualified Investments и (или) для одной или нескольких Групп инструментов.

Период времени, в течение которого проводится дополнительная торговая сессия, не может приходиться на период времени, в течение которого проводится основная торговая сессия.

Компания вправе устанавливать Торговые дни в отношении одной или нескольких Qualified Investments, одной или нескольких Групп инструментов для одного или нескольких Режимов торгов, для одной или нескольких торговых сессиях, и (или) для одного или нескольких периодов проведения торгов.

7.3. Компания устанавливает время начала и время окончания проведения Торгов или порядок определения указанного времени для каждого Режимов торгов, каждой торговой сессии и каждого периода проведения торгов. При этом указанное время может различаться для одной или нескольких Qualified Investments, одной или нескольких Групп инструментов и (или) одного или нескольких Кодов расчетов.

7.4. Информация о времени проведения Торгов, об изменении времени проведения Торгов раскрывается в Системе проведения торгов и (или) на сайте Компании в сети Интернет не менее чем за 1 (один) Торговый день до установленного времени. Положения настоящего пункта не

распространяются на случаи продления основной торговой сессии и досрочного прекращения Торгов в соответствии с пунктами 31.8 и 31.12 настоящих Правил.

Статья 8. Заявки

8.1. В случаях, установленных настоящими Правилами, Договоры могут заключаться:

8.1.1. на основании адресных и безадресных Заявок. Заявки, адресованные (информация о которых раскрывается) всем Участникам торгов, признаются безадресными. Все иные Заявки признаются адресными;

8.1.2. на основании анонимных и неанонимных Заявок. В случае если информация, позволяющая идентифицировать Участника торгов, подавшего Заявку, раскрывается в ходе Торгов всем Участникам торгов, такая Заявка признается неанонимной. Все иные Заявки признаются анонимными.

8.2. Настоящими Правилами устанавливаются виды Заявок, на основании которых могут заключаться Договоры в отдельных Режимов торгов.

8.3. Все Заявки, указанные в настоящих Правилах, являются Заявками, цена по которым не может быть изменена.

8.4. Компания вправе ограничить (в том числе установить условия, при которых Заявки могут подаваться, и (или) условия, при которых Заявки не могут подаваться) или запретить подачу Заявок. Указанное решение может быть принято в отношении любых Заявок, в том числе:

- Заявок определенного вида (направленности); и (или)
- Заявок, подаваемых в одном или нескольких Режимов торгов; и (или)
- Заявок, подаваемых в одной или нескольких торговых сессиях; и (или)
- Заявок, подаваемых в одном или нескольких периодах; и (или)
- Заявок, подаваемых с одним или несколькими Кодов расчетов; и (или)
- Заявок, подаваемых в отношении одной или нескольких Групп инструментов; и (или)
- Заявок, подаваемых в отношении одной или нескольких Qualified Investments; и (или)
- Заявок, подаваемых одним или несколькими Участниками торгов (в том числе Заявок, подаваемых по поручению или в интересах одного или нескольких Клиентов).

Статья 9. Условия и порядок подачи Заявок

9.1. Заявки на Торгах вправе подавать Участники торгов.

9.2. Компания осуществляет фиксацию всех подаваемых Заявок с использованием Системы проведения торгов. При фиксации Заявки отражается следующая информация:

- уникальный код Заявки, присвоенный компании при ее фиксации (в случае регистрации Заявки в реестре Заявок указанный код совпадает с идентификационным номером Заявки, присвоенным компанией при ее регистрации);
- дата и время фиксации Заявки;
- статус Заявки (зарегистрирована в реестре Заявок / не зарегистрирована в реестре Заявок);
- причина отказа в регистрации Заявки в реестре Заявок.

9.3. Исполнением Заявки считается заключение на ее основании одного или нескольких Договоров. При этом если Договор (Договоры) заключены в отношении всего количества Qualified Investments, указанного в Заявке, она считается исполненной полностью (в полном объеме), в ином случае она считается исполненной частично.

9.4. Участник торгов вправе отозвать Заявку, объявленную на Торгах, в любое время до момента полного исполнения указанной Заявки в порядке, установленном настоящим пунктом (в случае частичного исполнения указанной Заявки она может быть отозвана в неисполненной части), за исключением Заявки, содержащей Инструкцию, указанную в пункте 15.11.1. настоящих Правил. При этом Договоры, заключенные на основании такой Заявки до ее отзыва, сохраняют силу.

Заявки, содержащие Инструкцию, предусмотренную в пункте 15.11.1. настоящих Правил, могут быть отозваны в случае получения Компанией информации о возможности отзыва таких Заявок в соответствии с пунктом 9.5. настоящих Правил.

Отзыв Заявки осуществляется посредством направления в Компанию запроса на отзыв Заявки. Запрос на отзыв Заявки передается в Компанию посредством Системы проведения торгов, Системы электронного документооборота или по телефону.

В случае направления запроса на отзыв Заявки, подписанного Электронной подписью, посредством Системы электронного документооборота, Компания извещает Участника торгов об отзыве Заявки посредством Системы электронного документооборота.

Для целей передачи запроса на отзыв Заявки по телефону Компания присваивает Участнику торгов идентификационные коды. Компания информирует Участника торгов о присвоенных ему идентификационных кодах посредством Системы электронного документооборота. Участник торгов вправе предоставить Компании заявления об изменении

идентификационных кодов. Компания осуществляет обработку запроса на отзыв Заявки, переданного по телефону, только в том случае если лицо, подавшее указанный запрос, правильно назовет одновременно следующие реквизиты:

- наименование Участника торгов;
- количество договоров об оказании торговых услуг
- код Участника торгов;
- идентификационный код, присвоенный Участнику торгов.

Компания вправе осуществлять запись телефонных переговоров Компании и лица, подавшего запрос на отзыв Заявки, на цифровом носителе. Компания и Участники торгов подтверждают, что признают указанную запись в качестве доказательства при разрешении спорных ситуаций.

В течение 3 (трех) рабочих дней после передачи Компании по телефону запроса на отзыв Заявки, Участник торгов обязан представить Компании указанный запрос посредством Системы электронного документооборота. В случае непредставления Участником торгов запроса на отзыв Заявки, Компания вправе приостановить Участнику торгов допуск к участию в Торгах до момента предоставления запроса на отзыв Заявки.

Компания не несет ответственности за убытки, которые могут возникнуть у Участника торгов в случае исполнения Компанией запроса на отзыв Заявок или неисполнения указанного запроса, поданного по телефону, в случае если идентификационные номера Заявок, указанные в запросе на отзыв Заявки, не совпадают с находящимися в Системе проведения торгов, или реквизиты запроса на отзыв Заявки некорректны.

Участник торгов самостоятельно обеспечивает защиту от несанкционированного доступа к информации об идентификационных кодах и несет ответственность в случае ее разглашения.

9.5. Компания обязана уведомить Центральный контрагент о подаче Заявки в соответствии с порядком, установленным Договором с Клиринговой организацией и Правилами клиринга.

После подачи Заявки Компания направляет Центральному контрагенту информацию о поданной Заявке. Центральный контрагент в соответствии с порядком и в сроки, установленные Правилами клиринга, проверяет возможность объявления Заявки, о которой он был уведомлен Компанией.

Центральный контрагент по результатам проверки возможности объявления Заявки в соответствии с Правилами клиринга уведомляет Компанию о возможности или невозможности объявления Заявки. В случае получения Компанией информации о невозможности объявления Заявки такая Заявка не регистрируется в Реестре заявок.

Если иное не указано в настоящих Правилах, в случае отзыва Объявленной заявки в соответствии с пунктом 9.4 настоящих Правил или отмены Объявленной заявки в соответствии с пунктом 9.13 настоящих Правил, Компания уведомляет Центральный контрагент о факте отзыва или отмены Объявленной заявки.

При подаче запроса на отзыв Заявки, содержащей Инструкцию, указанную в подпункте 15.11.1 настоящих Правил, Компания направляет Рутинговому агенту информацию о поданном запросе на отзыв Заявки, содержащей Инструкцию, указанную в подпункте 15.11.1 настоящих Правил, в соответствии с порядком, установленным Правилами клиринга и/или Договором с Рутинговым агентом. Рутинговый агент проверяет возможность отзыва Заявки, содержащей Инструкцию, указанную в подпункте 15.11.1 настоящих Правил, в порядке и в сроки, установленные Правилами клиринга и/или Договором с Рутинговым агентом.

По результатам проверки возможности отзыва Заявки, содержащей Инструкцию, указанную в подпункте 15.11.1 настоящих Правил, Рутинговый агент уведомляет Компанию о возможности или невозможности отзыва такой Заявки в соответствии с Правилами клиринга и/или Договором с Рутинговым агентом. В случае получения Компанией информации о невозможности отзыва Заявки, содержащей Инструкцию, указанную в подпункте 15.11.1 настоящих Правил, такая Заявка не может быть отозвана. В случае получения Компанией информации о возможности отзыва Заявки, содержащей Инструкцию, указанную в подпункте 15.11.1 настоящих Правил, Компания уведомляет Рутингового агента об отзыве Заявок, содержащих Инструкцию, указанную в подпункте 15.11.1 настоящих Правил.

9.6. Компания вправе отказать в регистрации Заявок в реестре Заявок, если Клиенту или Участнику торгов запрещено совершение операций с Qualified Investments, которые указаны в поданных Заявках.

В случаях, установленных нормативными документами и правилами МФЦА и (или) документами эмитента для отдельной Qualified Investments или категории (типа) Qualified Investments, Компанией может быть установлено ограничение на возможность заключения Договоров определёнными категориями Участников торгов и (или) за счет определенных категорий Клиентов, а также на возможность заключения Участниками торгов Договоров за счет своих Клиентов и (или) за счет средств, находящихся в доверительном управлении.

9.7. Заявка не регистрируется в реестре Заявок в случае, если:

- Заявка не соответствует требованиям настоящих Правил; и (или)
- не подтверждена возможность регистрации указанной Заявки в реестре Заявок в соответствии с Правилами клиринга; и (или)
- ; и (или)
- подача Заявок нарушает установленные Компанией ограничение или запрет на подачу Заявок; и (или)
- Заявка подана с нарушением документов технического центра, определенного Компанией, информация о котором раскрыта на сайте Компании в сети Интернет и/или
- Заявка подана Участником торгов от своего имени и за счёт Клиента, который не был зарегистрирован Компанией в порядке, установленном Правилами членства; и/или
- Заявка подана с нарушением настоящих Правил или решений Компании, принятых в соответствии с настоящими Правилами.

9.8. Заявка считается объявленной с момента ее регистрации в реестре Заявок.

9.9. В Режиме основных торгов, Режиме торгов «Безадресное репо с Центральным контрагентом» и Режиме торгов «Безадресные Валютные свопы с Центральным контрагентом», объявленные Заявки образуют Очередь заявок. При постановке Заявки в Очередь заявок ее место в Очереди заявок определяется ценой, указанной в Заявке.

Первой в Очереди заявок находится лучшая Заявка. Под лучшей Заявкой на покупку понимается Заявка с наибольшей ценой, под лучшей Заявкой на продажу понимается Заявка с наименьшей ценой.

Первой в Очереди заявок репо находится лучшая Заявка репо. Под лучшей Заявкой репо на покупку понимается Заявка репо с наименьшей Ставкой репо, под лучшей Заявкой репо на продажу понимается Заявка репо с наибольшей Ставкой репо.

Первой в Очереди заявок валютный своп находится лучшая Заявка валютный своп. Под лучшей Заявкой валютный своп на покупку понимается Заявка валютный своп с наименьшей Ставкой Валютного свопа, под лучшей Заявкой валютный своп на продажу понимается Заявка валютный своп с наибольшей Ставкой Валютного свопа.

Если иное не установлено положениями настоящих Правил, место Заявок с равной ценой (с равной Ставкой репо, с равной ставкой Валютного свопа) в Очереди заявок определяется временем регистрации в реестре Заявок (первыми в Очереди заявок находятся Заявки, ранее зарегистрированные в реестре Заявок).

В Режиме основных торгов Заявки с одинаковыми ценами распределяются в Очереди заявок с учётом особенностей, установленных статьей 16 настоящих Правил.

9.10. подача Заявок в Систему проведения торгов осуществляется путем направления в Систему проведения торгов электронных сообщений, подписанных АСП. Заявки, подписанные АСП, полученным Участником торгов на основании договора (соглашения), заключенного между Участником торгов и техническим центром, определенным Компанией, информация о котором раскрыта на сайте Компании в сети Интернет, считаются поданными данным Участником торгов. Порядок использования АСП предусмотрен в Приложении №2 к настоящим Правилам.

подача Заявок в Систему проведения торгов может также осуществляться путем направления Электронного документа, подписанного Электронной подписью, посредством Системы электронного документооборота. Заявки, подписанные Электронной подписью уполномоченного лица Участника торгов, считаются поданными от имени Участника торгов. В этом случае Компания извещает Участника торгов о регистрации Заявки посредством Системы электронного документооборота.

Порядок использования Электронной подписи определяется договором (соглашением), заключённым, в том числе Участником торгов и Компанией с техническим центром, определённым Компанией, информация о котором раскрыта на сайте Компании в сети Интернет.

9.11. Заявки, поданные с нарушением настоящих Правил, в том числе в результате сбоев и (или) ошибок программно-технических средств, сбоев в работе информационно-коммуникационных средств связи, с помощью которых обеспечивается проведение Торгов, не регистрируются в реестре Заявок, если иное не предусмотрено решением Компании. В случае если такие Заявки зарегистрированы в реестре Заявок, такие Заявки и заключённые на их основании Договоры сохраняют силу, если иное не предусмотрено решением Компании.

9.12. Заявки, поданные Участником торгов за счет одного и того же лица (в соответствии с кодом этого лица), не являются основанием для заключения Договоров. Компания вправе принять решение, что Заявки, подаваемые Участниками торгов за счет одного и того же лица (в соответствии с кодом этого лица) могут являться основанием для заключения Договоров, за исключением исполнения Заявок Участников против собственного капитала, или участвовать в согласованной основной торговле.

9.13. Компания вправе аннулировать Заявки, зарегистрированные в реестре Заявок. Аннулирование Компанией Заявок осуществляется в случаях, указанных в настоящих Правилах.

Аннулирование Компанией Заявки осуществляется путем исключения информации об указанной Заявке из Системы проведения торгов. Аннулирование Компанией Заявки не влечёт удаление информации об аннулированной Заявке из реестра Заявок.

Компания аннулирует Заявки в случае нарушения Участником торгов, являющимся Участником клиринга, Маржинального требования (как оно определено Правилами клиринга).

9.14. В течение первого дня обращения Qualified Investments на Торгах не допускается объявление Заявок, цена которых выходит за пределы установленных Компанией предельных отклонений цен Заявок на покупку/Заявок продажу по сравнению с начальной ценой данной Qualified Investments в первый день ее обращения. Начальная цена Qualified Investments в первый день обращения на торгах Компании определяется в соответствии с Правилами клиринга.

9.15. Компания вправе устанавливать ограничения цен (ценовой коридор) или порядок их определения в ходе Торгов, по которым Участником торгов может быть подана Заявка или заключен Договор. В соответствии с решением Компании Заявка, в которой указана цена, выходящая за пределы ценового коридора, не может быть объявлена, и (или) на основании такой Заявки не может быть заключен Договор, условием которого является цена, выходящая за пределы ценового коридора.

Статья 10. Реестр Заявок

10.1. Компания осуществляет ведение реестра Заявок.

10.2. Реестр Заявок включает в себя следующие сведения:

- идентификационный номер Заявки, присвоенный Компанией при ее регистрации в реестре Заявок;
- уникальный код Заявки, присвоенный Компанией при ее фиксации (совпадает с ее идентификационным номером);
- Режим торгов, в котором подана Заявка;
- код Участника торгов, подавшего Заявку, включая Краткий код (коды) Клиента (Клиентов), по поручению или в интересах которого (которых) подана Заявка;
- идентификационный код Qualified Investments, являющейся предметом Договора, наименование эмитента или лица, обязанного по Qualified Investments, вид, категорию (тип), серию Qualified Investments;
- Идентификатор Участника торгов, подавшего Заявку;
- Идентификатор адресных сделок, присвоенный Участнику торгов, которому адресована Заявка (для Заявок, подаваемых в Режиме переговорных сделок, Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» и Режиме торгов «Адресные свопы с Центральным контрагентом»);
- Идентификатор адресных сделок, присвоенный Участнику торгов, подавшему Заявку (для Заявок, подаваемых в Режиме переговорных сделок, Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» и Режиме торгов «Адресные свопы с Центральным контрагентом»);
- указание на то, что Заявка подана во исполнение обязательств Маркет-мейкера, если такая Заявка подана во исполнение указанных обязательств;
- вид Заявки;
- направленность Заявки (Заявка на покупку или Заявка на продажу – для Заявок на покупку/Заявок на продажу; Заявка репо на покупку или Заявка репо на продажу – для Заявок репо; Заявка валютный своп на покупку или Заявка валютный своп на продажу – для заявок валютный своп);
- указанную в Заявке цену одной Qualified Investments (в отношении Заявки на покупку/Заявки на продажу);
- указанную в Заявке цену одной Qualified Investments по первой части Договора репо (в отношении Заявки репо);
- указанную в Заявке цену одной Qualified Investments по первой части Валютного свопа (в отношении Заявки валютный своп);
- указание на валюту, в которой выражается цена Qualified Investments или цена Qualified Investments по первой части Договора репо или цена Qualified Investments по первой части Валютного свопа (далее – валюта цены);
- указание на валюту, в которой производятся денежные расчеты по Договору (далее – валюта расчетов);
- количество Qualified Investments, выраженное в Лотах, в отношении которого подана Заявка, а в случае если Заявка исполнена частично, указывается количество Qualified Investments, выраженное в Лотах, составляющее неисполненную часть Заявки (количество Qualified Investments, в отношении которых подана Заявка для каждого Клиента, если Заявка подана по поручению или в интересах нескольких Клиентов);
- количество Qualified Investments, содержащееся в Лотах, в отношении которого подана Заявка, выраженное в штуках, а в случае если Заявка исполнена частично, указывается количество Qualified Investments, выраженное в штуках, составляющее неисполненную часть

Заявки (количество Qualified Investments, в отношении которых подана Заявка для каждого Клиента, если Заявка подана по поручению или в интересах нескольких Клиентов);

- дату и время регистрации Заявки в реестре Заявок;
- дату и время исполнения (отзыва, аннулирования) Заявки;
- результат подачи Заявки (на исполнении, исполнена частично, исполнена, отозвана, аннулирована и тому подобное);
- причина аннулирования Заявки;
- Ставку репо (в отношении Заявки репо);
- сумму репо (в отношении Заявки репо);
- Ставку Валютного свопа (в отношении Заявки валютный своп);
- сумму Валютного свопа (в отношении Заявки валютный своп).

10.3. Реестр Заявок может содержать иные сведения, предусмотренные Компанией.

10.4. Компания ведет реестр Поданных Заявок и реестр Заявок в электронной форме.

10.5. Компания представляет Участникам торгов выписки из реестра Заявок на основании заявления Участника в течение месяца, со дня получения указанного заявления.

Компания вправе взимать плату за предоставление выписок из реестра Заявок при условии раскрытия сведений о порядке, условиях и размере такой платы на сайте Компании в сети Интернет.

10.6. Компания хранит данные реестра Заявок в течение не менее 6 лет с даты включения Заявки в реестр Заявок.

Статья 11. Порядок заключения и исполнения Договоров

11.1. Договор на Торгах заключается на основании двух Объявленных разнонаправленных Заявок, полное или частичное соответствие которых друг другу установлено и зафиксировано в реестре Договоров Компании в порядке, определённом настоящими Правилами, за исключением случаев, предусмотренных пунктом 11.4 настоящих Правил.

При этом разнонаправленными Заявками являются Заявки, содержащие встречные по отношению друг к другу волеизъявления на заключение Договора, а именно:

- в отношении Договора купли-продажи разнонаправленными Заявками являются Заявка на покупку и Заявка на продажу;
- в отношении Договора репо разнонаправленными Заявками являются Заявка репо на покупку и Заявка репо на продажу;
- в отношении Валютного свопа разнонаправленными Заявками являются Заявка валютного свопа на покупку и Заявка валютного свопа на продажу.

Договор на торгах может быть заключён на основании Заявки, содержащей Инструкцию, указанную в подпункте 15.11.1 настоящих Правил, и на основании встречной Заявки — Заявки на дополнительную ликвидность. Такой Договор считается заключённым в момент объявления Заявки на дополнительную ликвидность.

11.2. Соответствие Объявленных Заявок друг другу устанавливается по следующим признакам: две разнонаправленные Заявки соответствуют друг другу в случае, если они являются встречными. Если иное не предусмотрено настоящими Правилами, в целях заключения Договоров две разнонаправленные Заявки считаются встречными при условии совпадения следующих сведений, содержащихся в указанных Заявках:

11.2.1. идентификационного кода Qualified Investments;

11.2.2. Кода расчетов;

11.2.3. Режима торгов, в котором поданы Заявки.

Настоящими Правилами могут быть предусмотрены иные и (или) дополнительные условия, при которых Заявки являются встречными.

11.3. Договоры заключаются между Центральным контрагентом и каждым из Участников торгов, соответствие объявленных которыми друг другу разнонаправленных Заявок установлено Компанией, за исключением случаев, предусмотренных пунктом 11.4 настоящих Правил. При этом подача Заявки Центральным контрагентом не требуется, а каждый из указанных Договоров считается заключённым в момент фиксации Компанией соответствия Заявок, поданных Участниками торгов, путем внесения в реестр Договоров записи о заключении Договоров с Центральным контрагентом.

В Режиме основных торгов, Режиме торгов RFQ и Режиме переговорных сделок Центральный контрагент вправе заключать Договоры на Торгах на основании Заявок, подаваемых Центральным контрагентом. В этом случае Договор считается заключённым в момент фиксации Компанией соответствия разнонаправленных Заявок друг другу путем внесения в реестр Договоров записи о заключении соответствующего Договора.

В случаях, предусмотренных настоящим пунктом, составление одного документа, подписанного сторонами, не осуществляется, и простая письменная форма Договора считается соблюденной.

11.4. В Режиме переговорных сделок, Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» и Режиме торгов «Адресное свопы с Центральным контрагентом» Договоры с участием Центрального контрагента могут заключаться без подачи Заявок.

11.5. Условия Договоров содержатся в Заявках, настоящих Правилах и (или) Правилах клиринга, либо определяются в соответствии с указанными документами.

Порядок заключения и порядок исполнения Договоров определяются настоящими Правилами и Правилами клиринга.

11.6. Договоры, заключённые с нарушением настоящих Правил, в том числе в результате сбоя и (или) ошибок программно-технических средств, сбоя в работе информационно-коммуникационных средств связи, с помощью которых обеспечивается проведение Торгов, не регистрируются в реестре Договоров, за исключением случаев, предусмотренных решением Компании. В случае если такие Договоры зарегистрированы в реестре Договоров, такие Договоры сохраняют силу, если иное не предусмотрено решением Компании.

11.7. Заключение Договора подтверждается выпиской из реестра Договоров.

11.8. Центральный контрагент в случаях, указанных в Правилах клиринга, вправе заключать Договоры от имени Участника клиринга в отношении себя лично без специального полномочия (доверенности), а также без согласия данного Участника торгов.

11.9. Для целей заключения Договоров решением Компании могут быть сформированы Группы инструментов, а также скорректированы сформированные Группы инструментов. Соответствующее решение раскрывается на сайте Компании в сети Интернет не позднее 1 (одного) дня до даты его вступления в силу.

11.10. Валюта цены Qualified Investments, не являющихся валютными парами, за исключением облигаций, выражается в долларах США или иной валюте. Валюта цены Qualified Investments, являющихся облигациями, выражается в процентах от непогашенной на момент заключения Договора номинальной стоимости таких Qualified Investments .

Для целей заключения Договоров по Qualified Investments и (или) по Группе инструментов, не являющихся валютой, входящей в валютную пару, Компания вправе устанавливать:

- перечни допустимых валют цены;
- перечни допустимых валют расчетов.

Компания раскрывает информацию об установленных Компанией перечнях допустимых валют цены и допустимых валют расчетов на сайте Компании в сети Интернет не позднее 1 (одного) дня до даты его вступления в силу.

В случае если Компанией установлены разные валюта цены и валюта расчетов в отношении одной Qualified Investments и (или) одной Группы инструментов, порядок определения курсов валют, используемых для определения и исполнения обязательств, возникших из Договоров, устанавливается Центральным контрагентом

11.11. Компания вправе устанавливать Коды расчетов, предусмотренные настоящим пунктом. При этом могут быть установлены разные Коды расчетов для разных Режимов торгов, торговых сессий, периодов проведения торгов, Групп инструментов, Qualified Investments.

Допускается установление следующих виды Кодов расчетов:

11.11.1. **Код расчетов Tn** – Код расчетов, который может быть указан в Заявках при заключении Договоров купли-продажи и который предусматривает, что:

- величина Средств обеспечения, предоставленных Участником торгов, должна быть не меньше величины, требуемой Центральным контрагентом в соответствии с Правилами клиринга;
- исполнение обязательств из Договоров, заключённых на основании Заявок, в которых указан данный Код расчетов, осуществляется по счетам, открытым в Расчетной организации и Расчетном депозитарии;
- Дата исполнения обязательств из Договора, заключённого на основании Заявки, в которой указан данный Код расчетов, определяется по формуле T+n, где:

T - дата заключения Договора;

n – число Торговых дней, значение которого устанавливается решением Компании.

11.11.2. **Код расчетов TkTn** – Код расчетов, который может быть указан в Заявках репо и Заявках валютный своп при заключении Договоров репо и Валютных свопов, который предусматривает, что:

- величина Средств обеспечения, предоставленных Участником торгов, должна быть не меньше величины, требуемой Центральным контрагентом в соответствии с Правилами клиринга;
- исполнение обязательств из Договоров, заключённых на основании Заявок, в которых указан данный Код расчетов, осуществляется по счетам, открытым в Расчетной организации и Расчетном депозитарии;
- Дата исполнения первой части Договора репо/Валютного свопа, заключенного на основании Заявки репо/Заявки валютный своп, в которой указан данный Код расчетов, определяется как T+k, а Дата исполнения второй части указанного Договора репо/Валютного свопа определяется как T+n, где:

Т - дата заключения Договора репо/Валютного свопа;

к и п – число Торговых дней, значение которого устанавливается решением Компании, причем значение «к» не должно превышать значение «п».

В случае если Дата исполнения, определенная в соответствии с Кодом расчетов, совпадает с днем, который для Центрального контрагента не является Расчетным днем, то обязательства по Договору с такой Датой исполнения подлежат исполнению в первый, следующий за этим днём, Расчетный день. При этом размер обязательств по Договору пересчитывается с учетом указанного изменения, если решением Компании и Центрального контрагента не установлено иное.

Обязательства по заключённым Договорам подлежат исполнению в Даты исполнения, соответствующие Коду расчётов, указанному в этих Договорах, если иное не предусмотрено документами Центрального контрагента и (или) не определено решением Компании.

11.12. Если иное не предусмотрено Правилами клиринга, покупатель по первой части Договора репо, заключённого в Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом», Режиме торгов «Безадресное репо с Центральным контрагентом» обязан передать продавцу по первой части Договора репо денежные средства, а также иное имущество, в том числе в виде дивидендов и процентов (далее - Доход) по Qualified Investments, в отношении которых заключён Договор репо, в течение 30 (тридцати) календарных дней, следующих за днем выплаты/передачи эмитентом или лицом, обязанным по Qualified Investments, Дохода, если список лиц, имеющих право на получение от эмитента или лица, обязанного по Qualified Investments, Дохода, определяется в период после исполнения обязательств по передаче Qualified Investments по первой части Договора репо и до исполнения обязательств по передаче Qualified Investments по второй части Договора репо.

Статья 12. Ведение реестра Договоров

12.1. Компания осуществляет ведение реестра Договоров.

12.2. Реестр Договоров включает в себя следующие сведения:

- стандартные условия Договоров (за исключением цены);
- идентификационные номера Заявок, на основании которых заключен Договор (за исключением случаев, когда Договор заключен без подачи Заявок);
- идентификационный номер Договора;
- Режим торгов, в котором заключён Договор;
- указание на то, что Договор заключен на основании Заявки, поданной во исполнение обязательств Маркет-мейкера, если Договор заключен на основании такой Заявки;
- дату и время регистрации Договора в реестре Договоров;
- коды Участников торгов, подавших Заявки, на основании которых заключается Договор, включая Краткие коды Клиентов, по поручению или в интересах которых заключен Договор;
- Краткий код Клиента (при подаче Участником торгов Заявки на заключение Договора по поручению и за счет Клиента);
- Идентификатор Участника торгов, на основании Заявок которого заключен Договор;
- Идентификатор адресных сделок Участника торгов, которому адресована Заявка (для Режимы переговоров сделок, Режимы торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом», Режимы торгов «Адресные свопы с Центральным контрагентом»);
- Идентификатор адресных сделок Участника торгов, подавшего Заявку (для Режимы переговоров сделок, Режимы торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом», Режимы торгов «Адресные свопы с Центральным контрагентом»);
- идентификационный код Qualified Investments, являющейся предметом Договора, наименование эмитента или лица, обязанного по Qualified Investments, вид, категорию (тип), серию Qualified Investments, являющейся предметом Договора;
- цену одной Qualified Investments, являющейся предметом Договора (в отношении Договора купли-продажи);
- цену одной Qualified Investments по первой части Договора репо (в отношении Договора репо);
- цену одной Qualified Investments по второй части Договора репо (в отношении Договора репо);
- Ставку репо (в отношении Договора репо);
- цену одной Qualified Investments по первой части Валютного свопа (в отношении Валютного свопа);
- цену одной Qualified Investments по второй части Валютного свопа (в отношении Валютного свопа);
- Ставку Валютного свопа (в отношении Валютного свопа);
- Дату исполнения (для Договора купли-продажи);
- Дату исполнения первой части Договора репо (в отношении Договора репо);

- Дату исполнения второй части Договора репо (в отношении Договора репо);
- Дату исполнения первой части Валютного свопа (в отношении Валютного свопа);
- Дату исполнения второй части Валютного свопа (в отношении Валютного свопа);
- валюту цены;
- валюту расчётов;
- количество Qualified Investments, выраженное в Лотах, являющихся предметом Договора, в том числе количество Qualified Investments для каждого Клиента, если Договор заключен по поручению или в интересах нескольких Клиентов;
- размер Лота;
- количество Qualified Investments, содержащееся в Лотах, являющихся предметом Договора, выраженное в штуках, в том числе количество Qualified Investments для каждого Клиента, если Договор заключен по поручению или в интересах нескольких Клиентов;
- указание на Торгово-клиринговый счет;
- Код расчетов;
- сумму Договора (указывается в валюте цены или в валюте номинальной стоимости Qualified Investments, являющихся облигациями) (для Договора купли-продажи). При этом сумма Договора, предметом которого являются Qualified Investments, являющихся облигациями, решением о выпуске (дополнительном выпуске) которых предусмотрена выплата купонного дохода, включает в себя накопленный купонный доход, рассчитываемый в соответствии с решением о выпуске таких Qualified Investments эмитента;
- сумму репо (указывается в валюте цены) (в отношении Договора репо);
- сумму второй части Договора репо (указывается в валюте цены) (в отношении Договора репо);
- сумму Валютного свопа (указывается в валюте цены) (в отношении Валютного свопа);
- сумму второй части Валютного свопа (указывается в валюте цены) (в отношении Валютного свопа).

Сведения о Договоре репо/Валютном свопе могут указываться в реестре Договоров посредством внесения в указанный реестр отдельно сведений о первой части Договора репо/Валютного свопа и о второй части Договора репо/Валютного свопа с присвоением им единого идентификационного номера Договора.

12.3. Реестр Договоров может содержать иные сведения, предусмотренные Компанией.

12.4. Компания ведет реестр Договоров в электронной форме.

12.5. Компания предоставляет Участникам торгов выписки из реестра Договоров.

Выписки из реестра Договоров, содержащие информацию о Договорах, заключённых Участником торгов на Торгах в течение текущего Торгового дня, предоставляются указанному Участнику торгов в порядке, указанном в статье 33 настоящих Правил.

Компания вправе взимать плату за предоставление выписок из реестра Договоров при условии раскрытия сведений о порядке, условиях и размере такой платы на сайте Компании в сети Интернет.

12.6. Компания хранит данные реестра Договоров в течение не менее 6 лет с даты включения Договора в реестр Заявок.

Статья 13. Взаимодействие Компании и Центрального контрагента

13.1. Взаимодействие Компании и Центрального контрагента в соответствии с настоящими Правилами и Правилами клиринга осуществляется, в том числе, посредством обмена информацией между Торговой системой и Клиринговой системой (как определено в Правилах клиринга).

13.2. Обязательства по Договорам, заключённым на торгах, исполняются на основании информации, переданной Компанией Центральному контрагенту. Дополнительное оформление, подтверждение или сверка заключённых Договоров со стороны Участников торгов или Клиентов не требуется.

13.3. В случае приостановления или прекращения торгов, предусмотренных настоящими Правилами, Компания уведомляет Центрального контрагента об этом факте.

13.4. Для целей подачи Заявок, заключения и обеспечения исполнения Договоров Центральный контрагент рассчитывает параметры риска в порядке, установленном Правилами клиринга. Центральный контрагент на основе взаимодействия с Компанией передаёт Компании информацию об установленных параметрах риска, включая, но не ограничиваясь, информацию о расчётной цене Квалифицированных инвестиций, а также о верхнем и нижнем пределах колебаний цены Квалифицированных инвестиций, ежедневно до начала торгов.

Глава V. Проведение Торгов в Режиме основных торгов

Статья 14. Котировки

14.1. Участники торгов для целей объявления Заявок в Режиме основных торгов вправе подать в Систему проведения торгов Котировки. Если иное не установлено решением Компании, Котировки могут подавать только Участники торгов категории А при условии указания в такой Котировке краткого кода Маркет-мейкера.

14.2. Котировка не является Заявкой и не регистрируется в реестре Заявок. Котировка является приглашением делать оферты путем подачи Заявок на Торгах в Режиме основных торгов, которые являются встречными по отношению к Заявкам провайдера ликвидности.

14.3. В Режиме основных торгов могут подаваться следующие виды Котировок:

- Котировка на продажу;
- Котировка на покупку.

Подача Котировки на продажу Участником торгов категории А означает приглашение делать оферты путем направления Заявки на покупку с целью заключения Договора купли-продажи по цене, не ниже той, что указана в Котировке на продажу.

Подача Котировки на покупку Участником торгов категории А означает приглашение делать оферты путем направления Заявки на продажу с целью заключения Договора купли-продажи по цене, не выше той, что указана в Котировке на покупку.

14.4. Котировка содержит:

- цену за одну Qualified Investment;
- указание на Идентификатор Участника торгов, подавшего Котировку;
- указание на код Участника торгов, подавшего Котировку;
- Краткий код Клиента (при подаче Участником торгов Котировки по поручению и за счет Клиента);

- указание на идентификационный код Qualified Investments;

- указание на Код расчетов;

- количество Qualified Investments, выраженное в Лотах;

- указание на Торгово-клиринговый счет;

- указание на вид Котировки (Котировка на продажу или Котировка на покупку);

- иные сведения в случаях, предусмотренных настоящими Правилами.

14.5. Котировка допускает частичное исполнение. Котировка действует до окончания Торгового дня, в течение которого указанная Котировка была подана, или до полного исполнения Котировки. Котировка удаляется Компанией в неисполненной части в случае неполного исполнения до конца Торгового дня, в течение которого указанная Котировка была подана, либо в связи с получением Компанией уведомления о неподаче Участником торгов, подавшим указанную Котировку, Заявки провайдера ликвидности в соответствии с пунктом 14.7. настоящих Правил.

14.6. Участник торгов вправе отозвать Котировку, поданную на Торгах. Отзыв Котировки осуществляется путем подачи Участником торгов в Систему проведения торгов соответствующего запроса на отзыв Котировки. Случаи отзыва Котировок регистрируются в реестре Котировок.

14.7. При наличии обрабатываемой или объявленной Заявки, являющейся встречной по отношению к Котировке, Участник торгов, подавший Котировку, обязуется подать Заявку провайдера ликвидности, соответствующую Котировке, или предоставить Компании уведомление о неподаче Заявки провайдера ликвидности.

Уведомление о неподаче Заявки провайдера ликвидности передается Компании посредством Системы проведения торгов. Уведомление о неподаче Заявки провайдера ликвидности должно содержать указание на идентификационный номер соответствующей Котировки.

14.8. Встречными по отношению к Котировке являются Заявки, указанные в пунктах 15.2.1. – 15.2.2. настоящих Правил, с учетом особенностей, указанных в пункте 15.12 настоящих Правил, с направлением, противоположным направлению Котировки, и с ценой не хуже, чем цена, указанная в Котировке.

14.9. Котировка исполняется в полном объеме или частично в случае заключения Договора на основании Заявки провайдера ликвидности, объявленной на основании данной Котировки.

14.10. Компания осуществляет ведение реестра Котировок, поданных на Торгах (далее – реестр Котировок).

14.11. Реестр Котировок включает в себя следующие сведения:

- идентификационный номер Котировки;

- Идентификатор Участника торгов, подавшего Котировку;

- код Участника торгов, подавшего Котировку;

- Краткий код Клиента (при подаче Участником торгов Котировки по поручению и за счет Клиента);

-

- идентификационный код Qualified Investments;

- Торгово-клиринговый счет;

- Код расчетов;

- время подачи Котировки;
- цену за одну Qualified Investments;
- вид Котировки (Котировка на продажу или Котировка на покупку);
- количество Qualified Investments, выраженное в Лотах, указанное при подаче Котировки;
- количество Qualified Investments, содержащееся в Лотах, указанное при подаче Котировки, выраженное в штуках;
- время последнего изменения Котировки;
- результат подачи Котировки (исполнена, отозвана, удалена).

14.12. В реестр Котировок дополнительно может быть включена иная информация.

14.13. Компания хранит данные реестра Котировок в течение не менее 6 лет с даты включения Котировки в реестр Котировок.

14.14. Котировка считается объявленной с момента ее регистрации в реестре Котировок.

14.15. Если иное не установлено решением Компании, информация, содержащаяся в Котировке, после регистрации указанной Котировки в реестре Котировок, раскрывается всем Участникам торгов.

14.16. Если иное не установлено решением Компании, Участник торгов вправе указать в Котировке признак «Допускать пересечение цены». В случае если признак «Допускать пересечение цены» указан в подаваемой Котировке, то Котировка на покупку (Котировка на продажу) будет зарегистрирована в реестре Котировок несмотря на наличие в реестре Котировок ранее поданных Котировок на продажу (Котировок на покупку) с ценой не больше (не меньше) цены, указанной в подаваемой Котировке.

В случае если признак «Допускать пересечение цены» не указан в подаваемой Котировке, то Котировка на покупку (Котировка на продажу) не будет зарегистрирована в реестре Котировок при наличии в реестре Котировок ранее поданных Котировок на продажу (Котировок на покупку) с ценой не больше (не меньше) цены, указанной в подаваемой Котировке.

Статья 15. Порядок подачи Заявок в периоде непрерывного аукциона

15.1. В Режиме основных торгов в периоде непрерывного аукциона могут подаваться Заявки на покупку и Заявки на продажу.

15.2. В Режиме основных торгов в периоде непрерывного аукциона могут быть поданы следующие виды Заявок:

- 15.2.1. Лимитные Заявки;
- 15.2.2. Рыночные Заявки;
- 15.2.3. Заявки дополнительной ликвидности;
- 15.2.4. Заявки провайдера ликвидности.

15.3. Под Лимитной Заявкой понимается Заявка на покупку или Заявка на продажу, обладающая в совокупности следующими признаками:

- Заявка является безадресной;
- Заявка является анонимной;
- Заявка содержит цену за одну Qualified Investments;
- Заявка предусматривает заключение Договора по цене, указанной в Заявке, или по лучшей цене.

Лимитные Заявки вправе подавать все Участники торгов.

Виды Лимитных Заявок, которые могут подаваться в Режиме основных торгов, указаны в пункте 15.6. настоящих Правил.

15.4. Под Рыночной Заявкой понимается Заявка на покупку или Заявка на продажу, обладающая в совокупности следующими признаками:

- Заявка является безадресной;
- Заявка является анонимной;
- Заявка не содержит цену за одну Qualified Investments;
- Заявка предусматривает заключение Договора по лучшей цене, доступной в момент объявления Заявки, и (или) по цене, указанной во встречной по отношению к ней Заявке дополнительной ликвидности;

- Заявка допускает частичное исполнение;

- Заявка действует до момента ее полного или частичного исполнения или до момента ее удаления Компанией, в том числе в связи с получением Компанией уведомления о неподаче Центральным контрагентом/Рутинговым агентом Заявки дополнительной ликвидности в соответствии с пунктом 15.15. настоящих Правил.

Рыночные Заявки вправе подавать все Участники торгов.

15.5. Под Заявкой дополнительной ликвидности понимается Заявка на покупку или Заявка на продажу, обладающая в совокупности следующими признаками:

- Заявка является адресной. При этом информация о ней не раскрывается Участникам торгов в Очереди заявок;

- Заявка является анонимной;
- Заявка содержит указание на идентификационный номер встречной Лимитной заявки или Рыночной заявки;
- Заявка содержит цену за одну Qualified Investments;
- Заявка допускает частичное исполнение;
- Заявка подлежит немедленному исполнению в момент ее объявления, а в случае полного или частичного неисполнения в указанный момент времени немедленно удаляется Компанией.

15.6. В Режиме основных торгов в периоде непрерывного аукциона допускается подача следующих видов Лимитных Заявок:

15.6.1. Лимитная Заявка, действующая до конца Торгового дня:

- действует до окончания Торгового дня, в течение которого объявлена указанная Заявка, и по его окончании удаляется Компанией;

- может быть удалена Компанией до окончания Торгового дня, в течение которого объявлена указанная Заявка, в связи с получением Компанией уведомления о неподаче Рутинговым агентом Заявки дополнительной ликвидности в соответствии с пунктом 15.15. настоящих Правил;

- допускает частичное исполнение. В случае полного или частичного неисполнения Обрабатываемой Лимитной Заявки она подлежит выставлению в Очередь заявок в неисполненной части.

15.6.2. Лимитная Заявка, действующая до определённого времени в течение Торгового дня:

- действует до момента удаления указанной Заявки Компанией. При этом Компания удаляет такую Лимитную Заявку только в течение периода времени в рамках Торгового дня, в течение которого объявлена указанная Заявка, время начала и время окончания которого устанавливается решением Компании;

- может быть удалена Компанией в любой момент времени в связи с получением Компанией уведомления о неподаче Рутинговым агентом Заявки дополнительной ликвидности в соответствии с пунктом 15.15. настоящих Правил;

- допускает частичное исполнение. В случае полного или частичного неисполнения Обрабатываемой Лимитной Заявки она подлежит выставлению в Очередь заявок в неисполненной части.

15.6.3. Лимитная Заявка, не допускающая частичного исполнения:

- не допускает частичного исполнения. В случае неисполнения Обрабатываемой Лимитной Заявки в полном объеме она подлежит выставлению в Очередь заявок в полном объеме или немедленному удалению Компанией;

- действует до момента ее исполнения в полном объеме или до момента ее удаления Компанией, в том числе в связи с получением Компанией уведомления о неподаче Рутинговым агентом Заявки дополнительной ликвидности в соответствии с пунктом 15.15. настоящих Правил.

15.6.4. Лимитная Заявка, допускающая частичное исполнение:

- допускает частичное исполнение. В случае полного или частичного неисполнения Обрабатываемой Лимитной Заявки она подлежит выставлению в Очередь заявок или немедленному удалению Компанией в неисполненной части;

- действует до момента ее полного или частичного исполнения или до момента ее удаления Компанией, в том числе в связи с получением Компанией уведомления о неподаче Рутинговым агентом Заявки дополнительной ликвидности в соответствии с пунктом 15.15. настоящих Правил.

15.6.5. Под Заявкой провайдера ликвидности понимается Заявка на покупку или Заявка на продажу, обладающая в совокупности следующими признаками:

- Заявка является адресной. При этом информация об указанной Заявке раскрывается только Участнику торгов, подавшему Котировку, идентификационный номер которой указан в данной Заявке провайдера ликвидности;

- Заявка является анонимной;

- Заявка содержит указание на идентификационный номер соответствующей Котировки, поданной данным Участником торгов, следующим образом:

- Заявка на покупку содержит указание на идентификационный номер Котировки на покупку;

- Заявка на продажу содержит указание на идентификационный номер Котировки на продажу;

- Заявка содержит цену за одну Qualified Investments. При этом цена в Заявке провайдера ликвидности должна быть равна или лучше цены, указанной в соответствующей Котировке, идентификационный номер которой указан в Заявке провайдера ликвидности;

- Заявка допускает частичное исполнение;

- в случае неисполнения или неполного исполнения Заявка действует до конца Торгового дня, в течение которого подана указанная Заявка;

- Заявка может быть отозвана Участником торгов, объявившим данную Заявку, отзыв Заявки осуществляется путем подачи Участником торгов в Систему проведения торгов соответствующего запроса на отзыв Заявки. Случаи отзыва Заявок провайдера ликвидности регистрируются в реестре Заявок;

- Заявка действует до момента полного исполнения или до момента удаления указанной Заявки Компанией в результате неисполнения или неполного исполнения до окончания Торгового дня, в течение которого указанная Заявка была подана, либо в результате отзыва Участником торгов Котировки, идентификационный номер которой указан в Заявке;

- если иное не установлено решением Компании, Заявки могут подавать только Участники торгов категории А, при условии указания в данной Заявке краткого кода Маркет-мейкера;

- количество Qualified Investments, указанное в Заявке, должно быть не больше, чем количество Qualified Investments, указанное в Котировке, идентификационный номер которой указан в реквизитах Заявки;

- если иное не установлено решением Компании, в случае подачи двух Заявок, содержащих одинаковый идентификационный номер Котировки, Заявка, объявленная позже, удаляется Компанией.

15.7. Для целей исполнения Заявок, указанных в пункте 15.2. настоящих Правил, лучшей ценой, содержащейся в Заявках на продажу, считается наименьшая цена, а лучшей ценой, содержащейся в Заявках на покупку – наибольшая цена.

15.8. При подаче Заявки в Систему проведения торгов Заявка на покупку и Заявка на продажу должны содержать:

- указание на код Участника торгов, подавшего Заявку;

- указание на Краткий код (коды) Клиента (Клиентов), по поручению или в интересах которого (которых) подана Заявка (при подаче Участником торгов Заявки на заключение Договора по поручению и за счет Клиентов);

- указание на Идентификатор Участника торгов, подавшего Заявку;

- указание на вид Заявки;

- указание на направленность Заявки (Заявка на покупку или Заявка на продажу);

- указание на идентификационный код Qualified Investments;

- количество Qualified Investments, выраженное в Лотах;

- указание на Торгово-клиринговый счет;

- цену за одну Qualified Investments (указывается, если видом Заявки предусмотрено указание цены);

- указание на Код расчетов;

- указание на Режим торгов, в котором подается Заявка;

- указание на валюту цены;

- указание на валюту расчетов;

- иные сведения в случаях, предусмотренных настоящими Правилами.

15.9. Лимитная Заявка и Рыночная Заявка могут содержать признак, указывающий на то, что она подана Участником торгов при исполнении им обязательств Маркет-мейкера. Указание данного признака возможно только при условии, что Участником торгов, подающим Заявку, заключен договор об исполнении обязательств Маркет-мейкера, и только при условии указания в данной Заявке краткого кода Маркет-мейкера и признака, предусмотренного подпунктом 15.11.2 настоящих Правил.

15.10. Заявка может содержать признак, указывающий на то, что встречными по отношению к ней не может являться Заявка, поданная при исполнении обязательств Маркет-мейкера.

Предусмотренный настоящим пунктом признак может содержаться:

- в Лимитной Заявке, если она содержит признак, предусмотренный подпунктом 15.11.2. настоящих Правил, и указание на краткий код Маркет-мейкера;

- в Рыночной Заявке, если она содержит признак, предусмотренный подпунктом 15.11.2. настоящих Правил, и указание на краткий код Маркет-мейкера;

- в Заявке провайдера ликвидности.

15.11. Лимитная Заявка и Рыночная заявка должны содержать один из следующих признаков, определяющих то, какая Заявка может являться встречной по отношению к указанной Лимитной Заявке и Рыночной Заявке (Инструкция):

15.11.1. Сводить только с Заявками дополнительной ликвидности.

Данная Инструкция означает, что встречными по отношению к содержащей такую Инструкцию Лимитной Заявке или Рыночной Заявке могут являться только Заявки дополнительной ликвидности.

15.11.2. Не сводить с Заявками дополнительной ликвидности.

Данная Инструкция означает, что встречными по отношению к содержащей такую Инструкцию Лимитной Заявке или Рыночной Заявке не могут являться Заявки дополнительной ликвидности.

15.12. Компания вправе запретить указание в Заявках определенных Инструкций. Такое решение может распространяться на один или несколько периодов проведения торгов, одну или несколько Qualified Investments, одну или нескольких Групп инструментов и (или) один или нескольких Кодов расчетов.

15.13. В рамках Режима основных торгов могут быть установлены следующие периоды проведения торгов:

15.13.1. Период стандартной дополнительной ликвидности.

В течение указанного периода могут подаваться Заявки, указанные в пункте 15.2. настоящих Правил.

15.13.2. Период без дополнительной ликвидности.

В течение указанного периода могут подаваться Заявки, указанные в подпунктах 15.2.1. – 15.2.2. и 15.2.4. настоящих Правил, за исключением Заявок, содержащих Инструкцию, предусмотренную подпунктом 15.11.1 настоящих Правил.

15.13.3. Период с дополнительной ликвидностью.

В течение указанного периода могут подаваться только Заявки дополнительной ликвидности.

15.13.4. Период без основной ликвидности.

В течение указанного периода могут подаваться Заявки дополнительной ликвидности, Заявки провайдера ликвидности, а также Лимитные Заявки и Рыночные Заявки, за исключением Заявок, содержащих Инструкцию, предусмотренную подпунктом 15.11.2 настоящих Правил.

15.13.5. В отношении одного или нескольких периодов проведения торгов, указанных в подпунктах 15.13.1 - 15.13.4 настоящих Правил, или части соответствующего периода, по одной или нескольким Qualified Investments и (или) по одной или нескольким Группам инструментов Компания вправе дополнительно установить одно или несколько из указанных правил:

1) не допускается подача Лимитной Заявки на продажу или Рыночной Заявки на продажу, если сумма учитываемых на Торгово-клиринговом счете, указанном в такой Заявке, количества Qualified Investments и объема обязательств по ним (с учетом знака), выраженного в штуках Qualified Investments, за вычетом, если иное не установлено решением Компании, количества Qualified Investments, содержащегося суммарно в Заявках на продажу, находящихся в Очереди заявок, меньше количества Qualified Investments, указанного в такой Заявке;

2) Лимитная заявка, в которой количество Qualified Investments, умноженное на цену Qualified Investments, указанных в такой Заявке, больше размера, установленного решением Компании, считается соответственно Лимитной Заявкой, содержащей Инструкцию, предусмотренную подпунктом 15.11.1 настоящих Правил;

3) Рыночная заявка, содержащая Инструкцию, предусмотренную пунктом 15.11.2 настоящих Правил, считается соответственно Рыночной Заявкой, содержащей Инструкцию, предусмотренную подпунктом 15.11.1 настоящих Правил.

15.13.6. Правила, предусмотренные подпунктом 15.13.5 настоящих Правил, могут различаться по различным Qualified Investments и (или) Группам инструментов.

15.13.7. В случае установления правила, предусмотренного подпунктом 15.13.5 настоящих Правил, Компания вправе установить период его действия.

15.14. Ни один период проведения торгов, предусмотренный подпунктами 15.13.1. - 15.13.4. настоящих Правил, не может приходиться на другой период проведения торгов, предусмотренный указанными подпунктами.

15.15. В случае если в Обрабатываемой Рыночной Заявке или Обрабатываемой Лимитной Заявке, указанной в подпункте 15.6.4. настоящих Правил, содержится Инструкция, предусмотренная подпунктом 15.11.2. настоящих Правил, и встречными по отношению к полному объему или части объема указанной Заявки являются Лимитные Заявки, Заявки провайдера ликвидности, то данная Обрабатываемая Заявка, в случае ее полного или частичного неисполнения, подлежит удалению Компанией. Указанная Обрабатываемая Заявка не подлежит выставлению в Очередь заявок.

В случае если в Обрабатываемой Лимитной Заявке, указанной в подпункте 15.6.3. настоящих Правил, содержится Инструкция, предусмотренная подпунктом 15.11.2. настоящих Правил, и встречными по отношению к указанной Заявке являются Лимитные Заявки, Заявки провайдера ликвидности, то данная Обрабатываемая Заявка, в случае ее неисполнения в полном объеме, подлежит удалению Компанией. Указанная Обрабатываемая Заявка не подлежит выставлению в Очередь заявок.

При наличии в Очереди заявок Рыночных Заявок или Лимитных Заявок, которые указаны в подпункте 15.6.4. настоящих Правил, содержат Инструкцию, предусмотренную подпунктом 15.11.1. настоящих Правил, и в полном объеме или частично являются встречными по отношению к

Заявкам дополнительной ликвидности, Рутинговый агент обязуется подать встречные Заявки дополнительной ликвидности и/или предоставить Компании уведомление о неподаче Заявок дополнительной ликвидности в отношении неисполненной части указанных Заявок. В случае если Рутинговый агент предоставил Компании уведомление о неподаче Заявок дополнительной ликвидности, вышеуказанные Рыночные Заявки или Лимитные Заявки немедленно удаляются Компанией в полном объеме или в неисполненной части после получения Компанией указанного уведомления.

При наличии в Очереди заявок Лимитной Заявки, которая указана в подпункте 15.6.3. настоящих Правил и содержит Инструкцию, предусмотренную подпунктом 15.11.1. настоящих Правил, и является встречной по отношению к Заявкам дополнительной ликвидности, Рутинговый агент обязуется подать встречные Заявки дополнительной ликвидности с суммарным количеством Qualified Investments, которое не меньше количества Qualified Investments, указанного в Лимитной заявке, или предоставить Компании уведомление о неподаче Заявок дополнительной ликвидности в полном объеме Лимитной Заявки. В случае если Рутинговый агент предоставил Компании уведомление о неподаче Заявок дополнительной ликвидности, вышеуказанная Лимитная Заявка немедленно удаляется Компанией в полном объеме после получения Компанией указанного уведомления.

При наличии в Очереди Заявок Лимитной Заявки, которая указана в подпункте 15.6.1. или подпункте 15.6.2. настоящих Правил, содержит Инструкцию, предусмотренную подпунктом 15.11.1. настоящих Правил, и в полном объеме или частично является встречной по отношению к Заявкам дополнительной ликвидности, Рутинговый агент вправе уведомить Компанию о неподаче Заявок дополнительной ликвидности в отношении неисполненной части указанной Лимитной Заявки. В случае если Центральный контрагент предоставил Компании уведомление о неподаче Заявок дополнительной ликвидности, вышеуказанная Лимитная Заявка немедленно удаляется Компанией в полном объеме или в неисполненной части после получения Компанией указанного уведомления.

Уведомление о неподаче Заявки дополнительной ликвидности передаётся Компании посредством Системы проведения торгов.

Уведомление о неподаче Заявки дополнительной ликвидности должно содержать идентификационный номер Заявки, в отношении которой оно составлено.

15.16. Две разнонаправленные Заявки являются встречными при наличии оснований для определения встречности Заявок, предусмотренных пунктами 15.11., 15.13., 15.15. настоящих Правил, а также при соблюдении следующих условий:

15.16.1. Лимитная Заявка одной направленности и Лимитная Заявка противоположной направленности являются встречными при условии, что:

- у таких разнонаправленных Заявок совпадают признаки, указанные в пункте 11.2. настоящих Правил;

- цена, указанная в Заявке на покупку, не меньше, чем цена, указанная в Заявке на продажу.

15.16.2. Лимитная Заявка одной направленности и Рыночная Заявка противоположной направленности являются встречными при условии, что у таких разнонаправленных Заявок совпадают признаки, указанные в пункте 11.2. настоящих Правил.

15.16.3. Заявка, содержащая указание на краткий код Маркет-мейкера и содержащая признак, указанный в пункте 15.10 настоящих Правил, одной направленности и одна из Заявок противоположной направленности являются встречными при условии, что:

- у таких разнонаправленных Заявок совпадают признаки, указанные в пункте 11.2. настоящих Правил;

- Заявка противоположной направленности:

- не содержит указание на краткий код Маркет-мейкера; или
 - содержит указание на краткий код Маркет-мейкера, но не содержит признака, указывающего на то, что Заявка подана при исполнении обязательств Маркет-мейкера, и не содержит, признак, указанный в пункте 15.10. настоящих Правил;
- цена, указанная в Заявке на покупку, не меньше, чем цена, указанная в Заявке на продажу (только для Лимитной Заявки).

15.16.4. Лимитная Заявка одной направленности и Заявка дополнительной ликвидности противоположной направленности являются встречными при условии, что:

- у таких разнонаправленных Заявок совпадают признаки, указанные в пункте 11.2. настоящих Правил;

- цена, указанная в Заявке на покупку, не меньше, чем цена, указанная в Заявке на продажу;

- Заявка дополнительной ликвидности содержит указание на идентификационный номер Лимитной заявки.

15.16.5. Рыночная Заявка одной направленности и Заявка дополнительной ликвидности противоположной направленности являются встречными при условии, что:

- у таких разнонаправленных Заявок совпадают признаки, указанные в пункте 11.2. настоящих Правил;

- Заявка дополнительной ликвидности содержит указание на идентификационный номер Рыночной заявки.

15.16.6. Лимитная Заявка, Рыночная заявка, и Заявка провайдера ликвидности противоположной направленности являются встречными при условии, что:

- у таких разнонаправленных Заявок совпадают признаки, указанные в пункте 11.2. настоящих Правил;

- цена, указанная в Заявке на покупку, не меньше, чем цена, указанная в Заявке на продажу.

15.17. При наличии Обрабатываемой Заявки одной направленности, а также Заявки, находящейся в Очереди заявок, противоположной направленности (далее в настоящем пункте - «Заявка 1»), которые не являются встречными, при условии, что:

- обе Заявки содержат краткие коды Маркет-мейкера;

- цена, указанная в Заявке на покупку, не меньше чем цена, указанная в Заявке на продажу;

- хотя бы одна из указанных Заявок не содержит признак, указанный в пункте 15.10. настоящих Правил,

на основании данной Обрабатываемой Заявки и иных встречных Заявок, находящихся в Очереди заявок, может быть заключен один или несколько Договоров при условии, что цены, указанные в этих Заявках, находящихся в Очереди заявок, хуже цены, указанной в Заявке 1. Неисполненная часть Обрабатываемой Заявки подлежит удалению Компанией.

15.18. При наличии Обрабатываемой Заявки и Заявки, находящейся в Очереди заявок, поданных за счет одного и того же лица (в соответствии с кодом этого лица), если в соответствии с пунктом 9.12. настоящих Правил указанные Заявки не являются основанием для заключения Договоров, и при условии, что цена, указанная в Заявке на покупку, не меньше, чем цена, указанная в Заявке на продажу:

- Обрабатываемая Заявка в случае ее неисполнения или частичного исполнения удаляется Компанией полностью или в части соответственно.

Статья 16. Порядок заключения Договоров в периоде непрерывного аукциона

16.1. Договоры в Режиме основных торгов в периоде непрерывного аукциона заключаются в порядке, установленном в статье 11 настоящих Правил и в настоящей статье.

16.2. В Режиме основных торгов в периоде непрерывного аукциона могут заключаться только Договоры купли-продажи.

16.3. Договоры купли-продажи на основании Заявок на покупку (Заявок на продажу) заключаются по правилам двойного встречного аукциона при условии наличия для Обрабатываемой Заявки встречных Заявок, находящихся в Очереди заявок, определённых по правилам, указанным в статье 15 настоящих Правил.

16.4. Цена одной Qualified Investments по Договору, заключенному на основании Рыночной Заявки, равна цене, указанной во встречной по отношению к ней Заявке.

16.5. Цена одной Qualified Investments по Договору, заключенному на основании Лимитной Заявки, равна:

- цене, указанной во встречной по отношению к ней Заявке, находящейся в Очереди заявок (если Договор заключен на основании Обрабатываемой Лимитной Заявки);

- цене, указанной во встречной по отношению к ней Обрабатываемой Заявке дополнительной ликвидности, или, в случае наличия иных встречных Заявок, цене, указанной в данной Лимитной Заявке (если Договор заключен на основании Лимитной Заявки, находящейся в Очереди Заявок).

16.6. Цена одной Qualified Investments по Договору, заключенному на основании Обрабатываемой Заявки дополнительной ликвидности, равна цене, указанной в этой Заявке.

16.7. На основании Обрабатываемой Заявки и Заявки, находящейся в Очереди заявок, являющихся встречными, по одной цене всегда заключается один Договор.

16.8. Договор на основании Рыночной Заявки и встречной Заявки заключается в отношении количества Qualified Investments, меньшего из указанного в этих Заявках.

16.9. Договор на основании Обрабатываемой Лимитной Заявки, действующей до конца Торгового дня, Обрабатываемой Лимитной Заявки, допускающей частичное исполнение, Обрабатываемой Лимитной Заявки, действующей до определённого времени в течение Торгового дня и встречной Заявки, находящейся в Очереди заявок, заключается в отношении количества Qualified Investments, меньшего из указанного в этих Заявках.

Договор на основании Обрабатываемой Лимитной Заявки, не допускающей частичного исполнения, и встречной Заявки, находящейся в Очереди заявок, заключается в отношении количества Qualified Investments, указанного в Обрабатываемой Лимитной Заявке, если оно меньше или равно количеству Qualified Investments, указанному во встречной Заявке, или в отношении количества Qualified Investments, указанного во встречной Заявке, если количество Qualified Investments, указанное в Обрабатываемой Лимитной Заявке, превышает количество Qualified Investments, указанное во встречной Заявке, и при этом количество Qualified Investments, указанное во встречных Заявках, не меньше количества Qualified Investments, указанного в Обрабатываемой Лимитной Заявке.

16.10. Договор на основании Обрабатываемой Заявки дополнительной ликвидности и Лимитной Заявки, действующей до конца Торгового дня, Лимитной Заявки, допускающей частичное исполнение, Лимитной Заявки, действующей до определённого времени в течение Торгового дня, находящихся в Очереди заявок, заключается в отношении количества Qualified Investments, меньшего из указанного в этих Заявках.

16.11. Договор на основании Обрабатываемой Заявки дополнительной ликвидности и Лимитной Заявки, не допускающей частичного исполнения, находящейся в Очереди заявок, заключается в отношении количества Qualified Investments, меньшего из указанного в этих Заявках.

16.12. При наличии в Очереди заявок нескольких Заявок, являющихся встречными по отношению к Обрабатываемой Заявке, Договор заключается на основании указанной Обрабатываемой Заявки и встречной Заявки, находящейся в Очереди заявок, содержащей лучшую цену.

16.13. Если количество Qualified Investments, указанное в Обрабатываемой Заявке меньше, чем количество Qualified Investments, указанное во всех встречных Заявках, находящихся в Очереди заявок, то встречные Заявки исполняются по принципу пропорционального или паритетного заключения Договоров в порядке, предусмотренном пунктами 16.16. – 16.17. настоящих Правил.

16.14. Заключение Договоров на основании Заявок в соответствии с пунктом 16.13. настоящих Правил осуществляется с учетом пунктов 16.7. - 16.11. настоящих Правил.

16.15. Договоры на основании Обрабатываемой Заявки и встречных Заявок, находящихся в Очереди заявок, заключаются в порядке, определенном пунктом 16.16 или пунктом 16.17 настоящих Правил. Соответствующий порядок заключения Договора устанавливается решением Компании по Qualified Investments, в отношении которой заключается Договор, или по Группе инструментов, к которой относится эта Qualified Investments. Указанное решение подлежит раскрытию на сайте Компании в сети Интернет не позднее 1 (одного) дня до даты его вступления в силу.

16.16. Договоры на основании Обрабатываемой Заявки и встречных Заявок заключаются по принципу пропорционального заключения Договоров в следующем порядке:

1) при наличии встречных Заявок с одинаковыми ценами первой в Очереди заявок находится Заявка, содержащая большее количество Qualified Investments. Если несколько Заявок содержат одинаковое количество Qualified Investments, первой в Очереди заявок находится Заявка, объявленная ранее;

2) количество Qualified Investments, в отношении которого заключается Договор на основании Обрабатываемой Заявки и встречных по отношению к ней Заявок, объявленных ранее и распределённых в Очереди заявок в соответствии с подпунктом 1 настоящего пункта (далее – встречные Заявки), рассчитывается в следующем порядке:

$$Vi_{исп} = floor\left(\frac{Vi}{\sum_1^I Vi} * V_{акт}\right)$$

, где:

floor – округление в меньшую сторону до целого;

I – количество встречных Заявок с одинаковой ценой;

i – порядковый номер встречной Заявки;

Vi – количество Qualified Investments, выраженное в Лотах, указанное в *i*-ой встречной Заявке;

Vi_{исп} – часть количества Qualified Investments, выраженного в Лотах, указанного в *i*-ой встречной Заявке;

V_{акт} – количество Qualified Investments, выраженное в Лотах, указанное в Обрабатываемой Заявке, на основании которой может быть заключен Договор путем исполнения встречных Заявок по цене, определённой в соответствии с пунктом 16.12 настоящих Правил;

3) если в результате расчёта количества Qualified Investments в соответствии с подпунктом 2 настоящего пункта Обрабатываемая Заявка исполняется не в полном объёме, то в отношении оставшегося количества Qualified Investments такая Заявка исполняется путем исполнения встречной Заявки, находящейся первой в Очереди заявок в соответствии с подпунктом 1 настоящего пункта.

В случае если количество Qualified Investments, указанное во встречной Заявке, меньше количества Qualified Investments, оставшегося после частичного исполнения Обрабатываемой Заявки, то Договор заключается в отношении количества Qualified Investments, равного количеству Qualified Investments, указанному во встречной Заявке. Договор заключается в отношении оставшегося количества Qualified Investments на основании Обрабатываемой Заявки и каждой последующей встречной Заявки до полного исполнения указанной Обрабатываемой Заявки.

16.17. Договоры на основании Обрабатываемой Заявки и встречных Заявок заключаются по принципу паритетного заключения Договоров в следующем порядке:

1) при наличии встречных Заявок, находящихся в Очереди заявок, относящихся к одной категории и содержащих одинаковые цены, отбираются Заявки, содержащие указание на один и тот же Краткий код Клиента, если Участник торгов действует в интересах и за счет Клиента, или на один и тот же код Участника торгов, если Участник торгов действует в своих интересах и за свой счет (далее в настоящей статье – уникальный код), и рассчитывается сумма объемов Заявок (V_i), содержащих один и тот же уникальный код, выраженная в Лотах. Для целей настоящего пункта под объемом Заявки понимается количество Qualified Investments, указанное в Заявке.

2) встречные Заявки, отобранные в соответствии с подпунктом 1 настоящего пункта, содержащие один и тот же уникальный код, сортируются по убыванию рассчитанного суммарного объема (V_i) от большего значения к меньшему. В случае совпадения суммарных объемов (V_i) Заявок, содержащих один и тот же уникальный код, все Заявки, содержащие один и тот же уникальный код, становятся первыми в Очереди заявок, если хотя бы одна из них объявлена ранее Заявок, содержащих другие уникальные коды;

3) при наличии нескольких встречных Заявок, находящихся в Очереди заявок, на основании которых рассчитывается суммарный объем (V_i) Заявок, содержащих один и тот же уникальный код, указанные Заявки сортируются в Очереди заявок по времени регистрации - первой из указанных Заявок в Очереди заявок находится встречная Заявка, зарегистрированная ранее;

4) суммарное количество Qualified Investments, в отношении которых могут быть заключены Договоры (далее – «объем Договоров»), на основании Обрабатываемой Заявки и встречных Заявок, содержащих один и тот же уникальный код и находящихся в Очереди заявок, исходя из сортировки Заявок, указанной в подпунктах 1 - 3 настоящего пункта, рассчитывается в следующем порядке:

$$V_{i_{kk}} = \min(\text{floor}\left(\frac{V_{\text{акт}}}{I}\right); V_i)$$

, где:

floor – округление в меньшую сторону до целого;

min – функция, возвращающая минимальное из двух значений;

I – количество уникальных кодов, по которым просуммированы Заявки, являющиеся встречными по отношению к Обрабатываемой Заявке и находящиеся в Очереди заявок;

V_i – выраженный в Лотах суммарный объем Заявок, являющихся встречными по отношению к Обрабатываемой Заявке, находящихся в Очереди заявок и содержащих один и тот же уникальный код;

i – порядковый номер уникального кода, указанного в Заявках, находящихся в Очереди заявок;

$V_{i_{kk}}$ – часть суммарного объема, выраженного в Лотах, Заявок, являющихся встречными по отношению к Обрабатываемой Заявке, находящихся в Очереди заявок и содержащих один и тот же уникальный код;

$V_{\text{акт}}$ – выраженный в Лотах объем Обрабатываемой Заявки;

5) для каждой последующей встречной Заявки из Очереди заявок, содержащей один и тот же уникальный код, объем заключаемого Договора рассчитывается до тех пор, пока суммарный объем Договоров, подлежащих заключению на основании Заявок, содержащих этот уникальный код (с учетом объема указанной встречной Заявки), не превышает значение $V_{i_{kk}}$;

6) если суммарный объем подлежащих заключению Договоров с учетом объема встречной Заявки, указанной в подпункте 5 настоящего пункта, превышает значение $V_{i_{kk}}$, то объем Договора, подлежащего заключению путем исполнения указанной встречной Заявки, равен разности между значением $V_{i_{kk}}$ и суммарным объемом встречных Заявок, содержащих Одинаковый код, предшествующих в Очереди заявок текущей встречной Заявке;

7) если в результате расчета объемов Договоров, подлежащих заключению в соответствии с подпунктами 4 - 6 настоящего пункта, Обрабатываемая Заявка исполняется не в полном объеме, то оставшийся неисполненный объем Обрабатываемой Заявки последовательно увеличивает объем заключаемых на основании Заявок, содержащих один и тот же уникальный код, Договоров, определённый в соответствии с подпунктами 4 - 6 настоящего пункта; при этом последовательность Заявок, полученная в результате сортировки, указанной в подпунктах 2 - 3 настоящего пункта, сохраняется. Каждое такое последовательное увеличение осуществляется в объеме, равном 1 (одному) Лоту.

16.18. В целях расчета объема Заявок и объема Договоров в соответствии с пунктами 16.16. и 16.17. настоящих Правил, не учитываются Заявки, не являющиеся встречными, за исключением случая, указанного в настоящем пункте.

Заявка, указанная в пункте 15.18. настоящих Правил, находящаяся в Очереди заявок, учитывается в целях расчета объема Заявок и объема Договоров в соответствии с пунктами 16.16. и 16.17. настоящих Правил, однако Договоры на основании данной Заявки, находящейся в Очереди заявок, не подлежат заключению в соответствии с настоящими Правилами, а Обрабатываемая Заявка, указанная в пункте 15.18. настоящих Правил, не исполненная в полном объеме или частично, подлежит удалению Компанией.

Статья 17. Порядок подачи Заявок и заключения Договоров в периоде аукциона закрытия

17.1. В рамках Режима основных торгов может проводиться период аукциона закрытия. Аукцион закрытия может проводиться по одной или нескольким Qualified Investments и (или) одной или нескольким Группам инструментов, определенных в соответствии с решением Компании. Указанное решение подлежит раскрытию на сайте Компании в сети Интернет не позднее 1 (одного) дня до даты его вступления в силу.

17.2. Аукцион закрытия состоит из следующих последовательных периодов:

- период подачи Заявок;
- период определения цены, по которой заключаются Договоры;
- период заключения Договоров.

Время начала и окончания каждого из указанных периодов определяется решением Компании.

17.3. В период аукциона закрытия могут подаваться следующие виды Заявок:

- Заявка аукциона закрытия;
- Оффсетная Заявка.

17.4. Под Заявкой аукциона закрытия понимается Заявка на покупку или Заявка на продажу, обладающая одновременно следующими признаками:

- Заявка является безадресной;
- Заявка является анонимной;
- Заявка предусматривает исполнение по единой цене (далее в настоящей статье - Цена аукциона закрытия);
- Заявка допускает частичное исполнение.

Заявки аукциона закрытия могут подавать все Участники торгов, за исключением Центрального контрагента.

Под Оффсетной Заявкой понимается Заявка на покупку или Заявка на продажу, обладающая одновременно следующими признаками:

- Заявка является безадресной;
- Заявка является анонимной;
- Заявка предусматривает исполнение по Цене аукциона закрытия;
- Заявка допускает частичное исполнение.

Оффсетные Заявки вправе подавать только Рутинговый агент.

17.5. При подаче Заявок аукциона закрытия и Оффсетных Заявок в Систему проведения торгов указанные Заявки на покупку и Заявки на продажу должны содержать данные, указанные в пункте 15.8. настоящих Правил.

17.6. Цена аукциона закрытия равна цене Qualified Investments, определенной по итогам торгов указанной Qualified Investments на иностранной бирже, на которой указанная Qualified Investments прошла процедуру листинга. В случае если Qualified Investments прошла процедуру листинга на нескольких иностранных биржах, Цена аукциона закрытия равна цене Qualified Investments по итогам торгов на одной из указанных иностранных бирж, определенной решением Компании.

17.7. Заявки аукциона закрытия могут быть поданы Участниками торгов исключительно в течение периода подачи Заявок. Оффсетные Заявки могут быть поданы Рутинговым агентом в течение периода подачи Заявок и в течение периода определения цены, по которой заключаются Договоры.

17.8. Заявки аукциона закрытия и Оффсетные Заявки являются Заявками, действующими до конца периода аукциона закрытия. По окончании периода аукциона закрытия неисполненные Заявки аукциона закрытия и Оффсетные Заявки удаляются Компанией.

17.9. Если иное не определено решением Компании, для целей заключения Договоров в рамках аукциона закрытия в Очередь заявок, помимо Заявок аукциона закрытия и Оффсетных Заявок, включаются Лимитные Заявки, действующие до конца Торгового дня, Лимитные Заявки, действующие до определенного времени в течение Торгового дня, находящиеся в Очереди заявок на момент времени начала периода заключения Договоров, цена которых не ниже (для Заявок на покупку) или не выше (для Заявок на продажу) Цены аукциона закрытия. При этом Заявки распределяются в Очереди заявок в следующем порядке:

- Заявки аукциона закрытия;
- Оффсетные Заявки;
- иные Заявки, включенные в Очередь заявок, для целей заключения Договоров в рамках аукциона закрытия.

При распределении Заявок в указанном порядке приоритет имеет Заявка, объявленная ранее.

17.10. В целях заключения Договоров в рамках аукциона закрытия Компания в ходе Торгов рассчитывает для каждой Qualified Investments значение показателя «Дисбаланс заявок» (далее – «Дисбаланс»). Информация о значении данного показателя раскрывается Рутинговому агенту. Период Торгов, в течение которого раскрывается указанная информация, и порядок ее раскрытия, включая периодичность ее раскрытия, устанавливаются Компанией. Компания вправе раскрывать всем Участникам торгов информацию о значении Дисбаланса по каждой Qualified Investments.

Дисбаланс по Qualified Investments рассчитывается по формуле:

$$\text{Дисбаланс} = \text{Abs}(V_{\text{buy}} - V_{\text{sell}}),$$

где:

Abs – функция, возвращающая абсолютное значение числа (модуль числа);

V_{sell} – общее количество Qualified Investments (в Лотах), указанных в Заявках аукциона закрытия, являющихся Заявками на продажу;

V_{buy} – общее количество Qualified Investments (в Лотах), указанных в Заявках аукциона закрытия, являющихся Заявками на покупку.

При этом:

- если $V_{\text{sell}} > V_{\text{buy}}$, то считается определенным Дисбаланс в продажу;

- если $V_{\text{sell}} < V_{\text{buy}}$, то считается определенным Дисбаланс в покупку;

- если $V_{\text{sell}} = V_{\text{buy}}$, то считается определенным, что Дисбаланс отсутствует.

17.11. Следующие виды Заявок при совпадении сведений, указанных в пункте 11.2. настоящих Правил, считаются встречными:

1) две разнонаправленные Заявки аукциона закрытия, находящиеся в Очереди заявок;

2) Заявка аукциона закрытия одной направленности и Оффсетная Заявка противоположной направленности, в которой указаны Qualified Investments, в отношении которых определен Дисбаланс:

- Оффсетная Заявка является Заявкой на продажу, и в соответствии с пунктом 17.10. настоящих Правил определен Дисбаланс в покупку;

- Оффсетная Заявка является Заявкой на покупку, и в соответствии с пунктом 17.10. настоящих Правил определен Дисбаланс в продажу;

3) Лимитные Заявки, действующие до конца Торгового дня, Лимитные Заявки, действующие до определенного времени в течение Торгового дня, в которых содержатся Инструкция, предусмотренная подпунктом 15.11.2 настоящих Правил, при условии, что каждая из этих Заявок находится в Очереди заявок на момент проведения аукциона в рамках периода заключения Договоров (если такая возможность установлена решением Компании), одной направленности и Заявки аукциона закрытия противоположной направленности, при условии, что цена, указанная в описанных Лимитных Заявках, не хуже, чем Цена аукциона закрытия;

4) Лимитные Заявки, действующие до конца Торгового дня, Лимитные Заявки, действующие до определенного времени в течение Торгового дня, в реквизитах которых содержатся Инструкция, предусмотренная подпунктом 15.11.2 настоящих Правил, при условии, что каждая из этих Заявок находится в Очереди заявок на момент проведения аукциона в рамках периода заключения Договоров (если такая возможность установлена решением Компании), одной направленности и Оффсетные Заявки противоположной направленности, при условии, что цена, указанная в описанных Лимитных Заявках не хуже, чем Цена аукциона закрытия.

17.12. В рамках аукциона закрытия заключаются только Договоры купли-продажи. Договоры в рамках аукциона закрытия заключаются по Цена аукциона закрытия в течение периода заключения Договоров. Договор заключается на основании двух Заявок, являющихся встречными в соответствии с пунктом 17.11. настоящих Правил, в отношении меньшего количества Qualified

Investments, указанного в данных Заявках. Неисполненная часть Заявки остается в Очереди заявок и на основании указанной Заявки может быть заключен Договор.

Глава VI. Проведение Торгов в Режиме торгов RFQ

Статья 18. Запросы на котировку

18.1. Участник торгов для целей объявления Заявок в Системе проведения торгов вправе подать в Систему проведения торгов Запрос на котировку.

18.2. Запрос на котировку не является Заявкой и не регистрируется в реестре Заявок. Запрос на котировку является приглашением делать оферты путем подачи Котировочных Заявок на Торгах в Режиме торгов RFQ.

18.3. В Режиме торгов RFQ могут подаваться следующие виды Запросов на котировку:

- Запрос на продажу;
- Запрос на покупку.

Подача Запроса на продажу Участником торгов означает приглашение делать оферты путем направления Заявки на покупку с целью заключения Договора купли-продажи по цене, не ниже той, что указана в Запросе на продажу.

Подача Запроса на покупку Участником торгов означает приглашение делать оферты путем направления Заявки на продажу с целью заключения Договора купли-продажи по цене, не выше той, что указана в Запросе на покупку.

Если в Запросе на котировку не указана цена, то Запрос на котировку означает приглашение делать оферты путём направления Заявок на покупку (Заявок на продажу), направленность которых противоположна направленности указанного Запроса на котировку, с целью заключения Договора купли-продажи по ценам, указанным в Заявках.

18.4. Запрос на котировку содержит:

- указание на Идентификатор Участника торгов, подавшего Запрос на котировку;
 - указание на код Участника торгов, подавшего Запрос на котировку;
 - Краткий код Клиента (при подаче Участником торгов Запроса на котировку по поручению и за счет Клиента);
 - указание на идентификационный код Qualified Investments;
 - указание на Код расчетов;
 - количество Qualified Investments, выраженное в Лотах;
 - указание на Торгово-клиринговый счет;
 - указание на вид Запроса на котировку (Запрос на продажу или Запрос на покупку);
 - иные сведения в случаях, предусмотренных настоящими Правилами.
- Запрос на котировку может также содержать цену за одну Qualified Investments.

18.5. Запросы на котировку могут быть следующих видов:

18.5.1. Запрос на котировку с указанием цены, действующий до конца Торгового дня:

- действует до окончания Торгового дня, в течение которого указанный Запрос был подан, и по его окончании удаляется Компанией;
- допускает частичное исполнение.

18.5.2. Запрос на котировку с указанием цены, действующий до определённого времени в течение Торгового дня:

- действует до момента удаления указанного Запроса на котировку Компанией. При этом Компания удаляет Запрос на котировку только в течение периода времени, время начала и время окончания которого устанавливается решением Компании;
- допускает частичное исполнение.

18.5.3. Запрос на котировку с указанием цены, не допускающий частичного исполнения.

- не допускает частичного исполнения;
- действует до момента его исполнения в полном объеме или до момента его удаления Компанией в связи с получением Компанией уведомления о неподаче Рутинговым агентом Котировочной Заявки в соответствии с пунктом 18.8. настоящих Правил.

18.5.4. Запрос на котировку с указанием цены, допускающий частичное исполнение:

- допускает частичное исполнение;
- действует до момента его исполнения в полном объеме или до момента его удаления в полной или неисполненной части Компанией в связи с получением Компанией уведомления о неподаче Рутинговым агентом Котировочной Заявки в соответствии с пунктом 18.8. настоящих Правил.

18.5.5. Запрос на котировку без указания цены:

- допускает частичное исполнение.
- действует до момента его исполнения в полном объеме или до момента его удаления Компанией в полном объеме или в неисполненной части в связи с получением Компанией

уведомления о неподаче Рутинговым агентом Котировочной Заявки в соответствии с пунктом 18.8. настоящих Правил.

18.6. Решением Компании может быть установлен перечень Qualified Investments и (или) Групп инструментов в отношении которых могут быть поданы только Запросы на котировку с указанием цены, действующие до конца Торгового дня, в течение которого указанные Запросы на котировку были поданы. Указанное решение подлежит раскрытию на сайте Компании в сети Интернет не позднее 1 (одного) дня до даты его вступления в силу.

18.7. Участник торгов вправе отозвать Запрос на котировку, поданный на Торгах. Отзыв Запроса на котировку осуществляется путём подачи Участником торгов в Систему проведения торгов соответствующего запроса на отзыв Запроса на котировку. Случаи отзыва Запросов на котировку регистрируются в реестре Запросов на котировку.

18.8. При наличии Запроса на котировку с указанием цены, не допускающего частичного исполнения, Запроса на котировку с указанием цены, допускающего частичное исполнение, и Запроса на котировку без указания цены Рутинговый агент обязуется подать Котировочную Заявку или предоставить Компании уведомление о неподаче Котировочной Заявки.

Уведомление о неподаче Котировочной Заявки передаётся Компании посредством Системы проведения торгов.

Уведомление о неподаче Рутинговым агентом Котировочной Заявки должна содержать указание на идентификационный номер соответствующего Запроса на котировку.

18.9. Запрос на котировку исполняется в полном объеме или частично в случае заключения Договора на основании Некотировочной Заявки, объявленной на основании данного Запроса на котировку.

18.10. Участник торгов вправе до момента удаления или отзыва Запроса на котировку изменить количество Qualified Investments, выраженное в Лотах и указанное в поданном Запросе на котировку. Изменение количества Qualified Investments не является отзывом Запроса на котировку.

18.11. Если иное не установлено настоящим пунктом, Запросы на котировку вправе подавать все Участники торгов.

Решением Компании может быть установлен перечень Qualified Investments и (или) Групп инструментов, в отношении которых Участники торгов категории А вправе подавать Запросы на котировку, в которых указаны соответствующие Qualified Investments, только в случае, если Краткий код Клиента, указанный в данном Запросе на котировку, не является кратким кодом Маркет-мейкера. Указанное решение подлежит раскрытию на сайте Компании в сети Интернет не позднее 1 (одного) дня до даты его вступления в силу.

18.12. Компания осуществляет ведение реестра Запросов на котировку, поданных на Торгах (далее – реестр Запросов на котировку).

18.13. Реестр Запросов на котировку включает в себя следующие сведения:

- идентификационный номер Запроса на котировку;
- Идентификатор Участника торгов, подавшего Запрос на котировку;
- код Участника торгов, подавшего Запрос на котировку;
- Краткий код Клиента (при подаче Участником торгов Запроса на котировку по поручению и за счет Клиента);
- идентификационный код Qualified Investments;
- Торгово-клиринговый счет;
- Код расчетов;
- время подачи Запроса на котировку;
- цена за одну Qualified Investments (указывается, если видом Запроса на котировку предусмотрено указание цены);
- вид Запроса на котировку (Запрос на продажу или Запрос на покупку);
- количество Qualified Investments, выраженное в Лотах, указанное при подаче Запроса на котировку;
- количество Qualified Investments, содержащееся в Лотах, указанное при подаче Запроса на котировку, выраженное в штуках;
- время последнего изменения Запроса на котировку;
- результат подачи Запроса на котировку (исполнен, отозван, удалён);
- количество Qualified Investments, выраженное в Лотах (в случае изменения количества Qualified Investments, содержащееся в Запросе на котировку).

18.14. В реестр Запросов на котировку дополнительно может быть включена иная информация.

18.15. Компания хранит данные реестра Запросов на котировку в течение не менее 6 лет с даты включения Запроса на котировку в реестр Запросов на котировку.

18.16. Запрос на котировку считается объявленным с момента его регистрации в реестре Запросов на котировку.

18.17. Информация, содержащаяся в Запросе на котировку, после регистрации указанного запроса в реестре Запросов на котировку, раскрывается только Участнику торгов, объявившему данный запрос, и, если иное не предусмотрено решением Компании, Рутинговым агентам, всем Участникам торгов категории А и Центральному контрагенту.

Статья 19. Порядок подачи Заявок

19.1. В Режиме торгов RFQ могут подаваться Заявки на покупку и Заявки на продажу с соблюдением требований настоящих Правил.

19.2. В Режиме торгов RFQ могут быть поданы следующие виды Заявок:

- Котировочные Заявки;
- Некотировочные Заявки.

19.3. Под Котировочной Заявкой понимается Заявка на покупку или Заявка на продажу, обладающая в совокупности следующими признаками:

- Заявка является адресной. При этом информация об указанной Заявке раскрывается только Участнику торгов, подавшему Запрос на котировку, идентификационный номер которого указан в данной Котировочной Заявке;

- Заявка является анонимной;

- Заявка содержит указание на идентификационный номер Запроса на котировку следующим образом:

- Заявка на покупку содержит указание на идентификационный номер Запроса на продажу;

- Заявка на продажу содержит указание на идентификационный номер Запроса на покупку;

- Заявка содержит указание на цену одной Qualified Investments. Если в Запросе на котировку, идентификационный номер которого указан в данной Заявке, указана цена, то цена Котировочной заявки должна быть равна или лучше цены, указанной в Запросе на котировку. В случае если цена, указанная в данном Запросе на котировку, лучше цены, указанной в Котировочной заявке, то указанная Заявка не подлежит регистрации в реестре Заявок;

- Заявка допускает частичное исполнение;

- Заявка действует до момента заключения Договора на основании указанной Заявки или до момента удаления указанной Заявки Компанией;

- Заявка в отношении Qualified Investments и (или) Группы инструментов, определенных решением Компании, подлежит выставлению в Очередь заявок.

Решением Компании может быть установлен перечень Групп инструментов и (или) Qualified Investments, Котировочные Заявки в отношении которых могут подавать:

- только Участники торгов, являющиеся Рутинговыми агентами;
- только Центральный контрагент;
- все Участники торгов.

Соответствующее решение подлежит раскрытию на сайте Компании в сети Интернет не позднее 1 (одного) дня до даты его вступления в силу.

19.4. Под Некотировочной Заявкой понимается Заявка на покупку или Заявка на продажу, обладающая в совокупности следующими признаками:

- Заявка является адресной. При этом информация об указанной Заявке раскрывается только Участнику торгов, подавшему Котировочную Заявку, по отношению к которой данная Заявка является встречной;

- Заявка является анонимной;

- Заявка содержит указание на идентификационный номер Запроса на котировку следующим образом:

- Заявка на покупку содержит указание на идентификационный номер Запроса на покупку;

- Заявка на продажу содержит указание на идентификационный номер Запроса на продажу.

- Заявка допускает частичное исполнение;

- Заявка или неисполненный остаток Заявки подлежит выставлению в Очередь заявок;

- Заявка действует до момента заключения Договора на основании указанной Заявки или до момента удаления указанной Заявки Компанией;

Некотировочные Заявки на покупку могут подавать только Участники торгов, подавшие Запрос на покупку, идентификационный номер которого указан в данной Некотировочной Заявке. Некотировочные Заявки на продажу могут подавать только Участники торгов, подавшие Запрос на продажу, идентификационный номер которого содержится в данной Некотировочной Заявке. При этом указанная Некотировочная заявка должна содержать Краткий код Клиента, указанный в Запросе на котировку.

19.5. Для целей исполнения Котировочных Заявок лучшей ценой, содержащейся в Заявках на продажу, считается наименьшая цена, а лучшей ценой, содержащейся в Заявках на покупку – наибольшая цена.

19.6. Некотировочная Заявка может быть отозвана Участником торгов. Отзыв Некотировочной Заявки осуществляется путем подачи Участником торгов в Систему проведения торгов соответствующего запроса на отзыв Запроса на котировку, идентификационный номер которого указан в данной Некотировочной Заявке. Случаи отзыва Некотировочной Заявки регистрируются в реестре Заявок.

Котировочная Заявка может быть отозвана Участником торгов. Отзыв Котировочной Заявки осуществляется путем подачи Участником торгов в Систему проведения торгов соответствующего запроса на отзыв Котировочной Заявки. Случаи отзыва Котировочных Заявок регистрируются в реестре Заявок.

19.7. При подаче Заявки в Систему проведения торгов Котировочная Заявка и Некотировочная Заявка должны содержать:

- указание на код Участника торгов, подавшего Заявку;
- Краткий код (коды) Клиента (Клиентов), по поручению или в интересах которого (которых) подана Заявка (при подаче Участником торгов Заявки на заключение Договора по поручению и за счет Клиентов);
- указание на Идентификатор Участника торгов, подавшего Заявку;
- указание на вид Заявки;
- указание на направленность Заявки (Заявка на покупку или Заявка на продажу);
- указание на идентификационный код Qualified Investments;
- количество Qualified Investments, выраженное в Лотах;
- указание на Торгово-клиринговый счет;
- цену за одну Qualified Investments (указывается, если видом Заявки предусмотрено указание цены);
- указание на Код расчетов;
- указание на Режим торгов, в котором подается Заявка;
- указание на валюту цены;
- указание на валюту расчетов;
- указание на идентификационный номер Запроса на котировку, зарегистрированного в реестре Запросов на котировку;
- иные сведения в случаях, предусмотренных настоящими Правилами.

19.8. Решением Компании может быть установлен перечень Групп инструментов и (или) Qualified Investments, для которых применяются следующие правила:

- в случае если предметом Котировочной Заявки являются соответствующие Qualified Investments количество Qualified Investments, указанное в Котировочной Заявке, должно быть не меньше, чем количество Qualified Investments, указанное в Запросе на котировку, идентификационный номер которого указан в реквизитах Котировочной Заявки;
- в случае если предметом Котировочной Заявки являются соответствующие Qualified Investments количество Qualified Investments, указанное в Некотировочной Заявке, должно быть не больше, чем количество Qualified Investments, указанное во встречной Котировочной Заявке.

Соответствующее решение подлежит раскрытию на сайте Компании в сети Интернет не позднее 1 (одного) дня до даты его вступления в силу.

19.9. В Режиме торгов RFQ Котировочная Заявка одной направленности и Некотировочная Заявка противоположной направленности являются встречными при условии, что:

- совпадают признаки, указанные в пункте 11.2 настоящих Правил;
- цена, указанная в Заявке на покупку, не меньше, чем цена, указанная в Заявке на продажу (указывается, если видом Заявки предусмотрено указание цены);
- в Котировочной Заявке и в Некотировочной Заявке указан одинаковый идентификационный номер Запроса на котировку.

19.10. Решением Компании может быть установлен перечень Групп инструментов и (или) Qualified Investments, в отношении которых применяется следующее правило: в случае подачи двух Котировочных Заявок, предметом которых являются соответствующие Qualified Investments, содержащих одинаковый идентификационный номер Запроса на котировку, Котировочная Заявка объявленная позже удаляется Компанией. Соответствующее решение подлежит раскрытию на сайте Компании в сети Интернет не позднее 1 (одного) дня до даты его вступления в силу.

Статья 20. Порядок заключения Договоров

20.1. В Режиме торгов RFQ могут заключаться только Договоры купли-продажи. Договоры в Режиме торгов RFQ заключаются в порядке, установленном в статье 11 настоящих Правил и в настоящей статье.

20.2. Договоры купли-продажи заключаются на основании двух разнонаправленных Заявок, являющихся встречными, в соответствии с пунктом 19.9. настоящих Правил.

20.3. Договор заключается по цене, указанной в Котировочной заявке, в отношении меньшего количества Qualified Investments из указанных во встречных Заявках.

Глава VII. Проведение Торгов в Режиме переговорных сделок

Статья 21. Порядок подачи Заявок

21.1. В Режиме переговорных сделок могут подаваться Заявки на покупку и Заявки на продажу с соблюдением требований настоящих Правил.

21.2. В Режиме переговорных сделок Участники торгов вправе подавать адресные неанонимные Заявки.

21.3. Информация о поданной Заявке раскрывается Участнику торгов, подавшему указанную Заявку. Участник торгов в ходе Торгов имеет доступ к информации о Заявках, адресованных указанному Участнику торгов.

21.4. При подаче Заявки в Систему проведения торгов Заявка на покупку и Заявка на продажу должны содержать:

- указание на код Участника торгов, подавшего Заявку;
- указание на Краткий код (коды) Клиента (Клиентов), по поручению или в интересах которого (которых) подана Заявка (при подаче Участником торгов Заявки на заключение Договора по поручению и за счет Клиентов);
- указание на Идентификатор Участника торгов, подавшего Заявку;
- указание на направленность Заявки (Заявка на покупку или Заявка на продажу);
- указание на идентификационный код Qualified Investments;
- количество Qualified Investments, выраженное в Лотах;
- указание на Торгово-клиринговый счет;
- цену за одну Qualified Investments;
- указание на Код расчетов;
- указание на Режим торгов, в котором подается Заявка;
- указание на валюту цены;
- указание на валюту расчетов;
- указание на Идентификатор адресных сделок Участника торгов, которому адресована Заявка;
- указание на Идентификатор адресных сделок Участника торгов, подавшего Заявку;
- иные сведения в случаях, предусмотренных настоящими Правилами.

21.5. Заявка может содержать ссылку, под которой понимается последовательность символов, дополнительно используемая для установления соответствия Объявленных Заявок друг другу в соответствии с настоящими Правилами.

21.6. В Режиме переговорных сделок две разнонаправленные Заявки являются встречными при совпадении параметров, указанных в пунктах 11.2.1 – 11.2.3 настоящих Правил, а также при совпадении следующих параметров:

- количества Qualified Investments, выраженного в Лотах, указанного в Заявках;
- цены за одну Qualified Investments, указанной в Заявках;
- Идентификатора адресных сделок Участника торгов, объявившего Заявку, указанного в одной из Заявок, и Идентификатора адресных сделок Участника торгов, которому адресована встречная Заявка, указанного в другой Заявке;
- ссылки (в случае указания хотя бы в одной из Заявок).

Статья 22. Порядок заключения Договоров

22.1. В Режиме переговорных сделок могут заключаться только Договоры купли-продажи. Договоры в Режиме переговорных сделок заключаются в порядке, установленной в статье 11 настоящих Правил и в настоящей статье.

22.2. В целях прекращения обязательств по Договорам, возникших в результате неисполнения или ненадлежащего исполнения указанных обязательств, а также для целей прекращения неисполненных обязательств, в соответствии с условиями и порядком, установленном Правилами клиринга, допускается заключение Договоров между Центральным контрагентом и Участником торгов без подачи Заявок. Указанный Договор заключается в порядке, предусмотренном пунктом 11.4 настоящих Правил.

22.3. Договор в Режиме переговорных сделок заключается на основании двух разнонаправленных Заявок, являющихся встречными в соответствии с пунктом 21.6 настоящих Правил.

22.4. Договор заключается по цене и в отношении количества Qualified Investments, указанных во встречных Заявках.

В случае, когда объявлены две Заявки, содержащие одинаковые цены и количество Qualified Investments, Договор заключается на основании Заявки, объявленной ранее.

22.5. При получении адресной Заявки Участник торгов вправе отклонить полученную Заявку.

22.6. В случае если в течение Торгов Заявка не была исполнена, указанная Заявка подлежит удалению Компанией по окончании Торгового дня.

22.7. Режим переговорных сделок может состоять из периода, в течение которого Участники торгов вправе подавать Заявки, в которых указаны одинаковые ТКС (далее – Внутриброкерский РПС). Возможность проведения периода Внутриброкерский РПС может быть установлена решением Компании для одной или нескольких Qualified Investments, и (или) для одного или нескольких Кодов расчетов, и (или) для одной или нескольких Групп инструментов.

Для целей установления соответствия Заявок друг другу и заключения Договоров в рамках периода Внутриброкерский РПС встречными Заявками могут являться две разнонаправленные Заявки при совпадении параметров, указанных в пункте 21.6 настоящих Правил, а также при совпадении ТКС, указанных в данных Заявках.

22.8. Режим переговорных сделок может состоять из периода, в течение которого Договоры заключаются между Участниками торгов и Центральным контрагентом. Договор заключается на основании Заявки, адресованной Участником торгов Центральному контрагенту, и Заявки, подаваемой Центральным контрагентом в адрес Участника торгов (далее – РПС с ЦК Режимы переговорных сделок).

В Заявках, подаваемых Участниками торгов, должно содержаться указание на Идентификатор адресных сделок Участника торгов, однозначно идентифицирующий Центрального контрагента.

Возможность проведения периода РПС с ЦК Режимы переговорных сделок может быть установлена решением Компании для одной или нескольких Qualified Investments, и (или) для одного или нескольких Кодов расчетов, и (или) для одной или нескольких Групп инструментов.

Для целей установления соответствия Заявок друг другу и заключения Договоров в рамках периода РПС с ЦК Режимы переговорных сделок встречными Заявками могут являться две разнонаправленные Заявки при совпадении параметров, указанных в пункте 21.6 настоящих Правил, а также при условии, что один из Идентификаторов адресных сделок Участника торгов, указанных в Заявках, однозначно определяет Центрального контрагента.

22.9. В реестре Договоров может содержаться информация, указанная в пункте 21.5. настоящих Правил.

Глава VIII. Проведение Торгов в Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом»

Статья 23. Порядок подачи Заявок репо

23.1. В Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» могут подаваться только Заявки репо на покупку и Заявки репо на продажу с соблюдением требований настоящих Правил.

23.2. В Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» Участники торгов вправе подавать только адресные неанонимные Заявки репо.

23.3. Информация о поданной Заявке репо раскрывается Участнику торгов, подавшему указанную Заявку репо. Участник торгов в ходе Торгов имеет доступ к информации о Заявках репо, адресованных указанному Участнику торгов.

23.4. При подаче Заявки репо в Систему проведения торгов Заявка репо на покупку и Заявка репо на продажу должны содержать:

- указание на код Участника торгов, подавшего Заявку репо;
- Краткий код (коды) Клиента (Клиентов), по поручению или в интересах которого (которых) подана Заявка репо (при подаче Участником торгов Заявки репо на заключение Договора по поручению и за счет Клиентов);
- указание на Идентификатор Участника торгов, подавшего Заявку репо;
- указание на вид Заявки репо;
- указание на направленность Заявки репо (Заявка репо на покупку или Заявка репо на продажу);
- указание на идентификационный код Qualified Investments;
- количество Qualified Investments, выраженное в Лотах;
- указание на Торгово-клиринговый счет;
- указание на Идентификатор адресных сделок Участника торгов, подавшего Заявку репо;
- указание на Идентификатор адресных сделок Участника торгов, которому адресована Заявка репо;
- Ставку репо (в процентах годовых);

- цену первой части Договора репо;
- указание на валюту цены;
- указание на валюту расчетов;
- указание на Код расчетов;
- указание на Режим торгов, в котором подается Заявка репо.

23.5. Заявка репо может содержать ссылку, под которой понимается последовательность символов, дополнительно используемая для установления соответствия Объявленных Заявок репо друг другу в соответствии с настоящими Правилами.

23.6. В Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» две разнонаправленные Заявки репо являются встречными при совпадении параметров, указанных в пунктах 11.2.1 – 11.2.3 настоящих Правил, а также при совпадении следующих параметров:

- Ставки репо, указанной в Заявках репо;
- количества Qualified Investments, указанного в Заявках репо;
- цены первой части Договора репо, указанной в Заявках репо;
- Идентификатора адресных сделок Участника торгов, объявившего Заявку репо, указанного в одной из Заявок репо, и Идентификатора адресных сделок Участника торгов, которому адресована Заявка репо, указанного в другой Заявке репо;
- ссылки (в случае указания хотя бы в одной из Заявок репо).

Статья 24. Порядок заключения Договоров репо

24.1. В Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» заключаются Договоры репо. Договоры репо в Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» заключаются в порядке, установленном в статье 11 настоящих Правил и в настоящей статье.

24.2. Договор репо заключается на основании двух разнонаправленных Заявок репо, являющихся встречными в соответствии с пунктом 23.6 настоящих Правил.

24.3. Режим торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» может состоять из периода, в течение которого Участники торгов вправе подавать Заявки репо, в которых указаны одинаковые ТКС (далее – Внутриброкерское репо). Возможность проведения периода Внутриброкерское репо может быть установлена решением Компании для одной или нескольких Qualified Investments, и (или) для одного или нескольких Кодов расчетов, и (или) для одной или нескольких Групп инструментов.

Для целей установления соответствия Заявок репо друг другу и заключения Договоров в рамках периода Внутриброкерское репо встречными Заявками репо могут являться две разнонаправленные Заявки репо при совпадении параметров, указанных в пункте 23.6 настоящих Правил, а также при совпадении ТКС, указанных в данных Заявках репо.

Режим торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» может состоять из периода, в течение которого Договоры репо заключаются без подачи Заявок в порядке, указанном в пункте 11.4 настоящих Правил.

24.4. Режим «Адресное репо с Центральным контрагентом» может состоять из периода, в течение которого Договоры заключаются между Участниками торгов и Центральным контрагентом. Договор заключается на основании Заявки, адресованной Участником торгов Центральному контрагенту, и Заявки, подаваемой Центральным контрагентом в адрес Участника торгов (далее – РПС с ЦК Режим «Адресное репо с Центральным контрагентом»).

В Заявках, подаваемых Участниками торгов, должно содержаться указание на Идентификатор адресных сделок Участника торгов, однозначно идентифицирующий Центрального контрагента.

Возможность проведения периода РПС с ЦК Режим «Адресное репо с Центральным контрагентом» может быть установлена решением Компании для одной или нескольких Qualified Investments, и (или) для одного или нескольких Кодов расчетов, и (или) для одной или нескольких Групп инструментов.

Для целей установления соответствия Заявок друг другу и заключения Договоров в рамках периода РПС с ЦК Режим «Адресное репо с Центральным контрагентом» встречными Заявками репо могут являться две разнонаправленные Заявки при совпадении параметров, указанных в пункте 23.6 настоящих Правил, а также при условии, что один из Идентификаторов адресных сделок Участника торгов, указанных в Заявках, однозначно определяет Центрального контрагента.

24.5. Договор репо заключается по цене первой части Договора репо и в отношении количества Qualified Investments, указанного во встречных Заявках репо. В случае, когда объявлены две встречные Заявки репо, Договор репо заключается на основании встречной Заявки репо, объявленной ранее.

24.6. Участник торгов, которому адресована Заявка репо, вправе отклонить указанную Заявку репо. Отклоненная Участником торгов Заявка репо удаляется Компанией.

24.7. Если решением Компании не предусмотрено иное, то в целях заключения Договоров репо в Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» в качестве цены первой

части Договора репо используется расчетная цена Qualified Investments, определенная Клиринговой организацией.

24.8. Сумма репо рассчитывается по следующим формулам:

Для Договора репо, предметом которого являются Qualified Investments, за исключением облигаций:

$$Sum = P1 * q * Q,$$

где:

Sum - сумма репо, рассчитываемая с точностью до двух знаков после запятой;

Q – количество Qualified Investments, являющееся предметом Договора репо, выраженное в Лотах;

P1 – цена первой части Договора репо, определенная в соответствии с пунктом 24.7 настоящих Правил;

q - количество Qualified Investments в одном Лоте, установленное для данной Qualified Investments, в штуках.

Для Договора репо, предметом которого являются облигации:

$$Sum = (P1 * N / 100\% + NCD) * Q * q,$$

где:

Sum - сумма репо, рассчитываемая с точностью до двух знаков после запятой;

Q – количество Qualified Investments, являющееся предметом Договора репо, выраженное в Лотах;

P1 – цена первой части Договора репо, определенная в соответствии с пунктом 24.7 настоящих Правил (в процентах от номинальной стоимости);

NCD – накопленный купонный доход, рассчитываемый в соответствии с решением о выпуске (дополнительном выпуске) Qualified Investments;

q - количество Qualified Investments в одном Лоте, установленное для данной Qualified Investments, в штуках;

N – номинальная стоимость облигации.

24.9. Сумма второй части Договора репо рассчитывается по следующей формуле:

$$Sum2 = Sum * \left(1 + \frac{r}{100} * \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right) \right),$$

где:

Sum2 - сумма второй части Договора репо, рассчитываемая с точностью до двух знаков после запятой;

Sum – сумма репо;

r - Ставка репо, в процентах годовых;

T₃₆₅ - число дней между Датой исполнения первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо, приходящихся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T₃₆₆ - число дней между Датой исполнением первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо, приходящихся на календарный год, состоящий из 366 дней.

24.10. Цена второй части Договора репо рассчитывается по следующим формулам:

Для Договора репо, предметом которого являются Qualified Investments, за исключением облигаций:

$$P2 = \frac{Sum2}{(Q * q)}$$

где:

P2 - цена второй части Договора репо;

Q – количество Qualified Investments, являющееся предметом Договора репо, выраженное в Лотах;

q - количество Qualified Investments в одном Лоте, установленное для данной Qualified Investments, в штуках;

Sum2 - сумма второй части Договора репо, рассчитываемая в соответствии с пунктом 24.9 настоящих Правил.

Для Договора репо, предметом которого являются облигации:

$$P2 = \frac{(\text{Sum2} - \text{NCD} * Q * q)}{N * Q * q} * 100\%$$

где:

P2 - цена второй части Договора репо (в процентах от номинальной стоимости);

Sum2 - сумма второй части Договора репо, рассчитываемая в соответствии с пунктом 24.9 настоящих Правил;

NCD – накопленный купонный доход, рассчитываемый в соответствии с решением о выпуске (дополнительном выпуске) Qualified Investments;

Q – количество Qualified Investments, являющееся предметом Договора репо, выраженное в Лотах;

q - количество Qualified Investments в одном Лоте, установленное для данной Qualified Investments, в штуках;

N – номинальная стоимость облигации.

24.11. В случае если в течение Торгового дня Заявка репо не была исполнена, указанная Заявка репо подлежит удалению Компанией по окончании соответствующего Торгового дня.

24.12. В целях прекращения обязательств по Договорам репо, заключенным в Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом», возникших в результате неисполнения или ненадлежащего исполнения указанных обязательств, а также для целей прекращения неисполненных обязательств в соответствии с условиями и порядком, установленными Правилами клиринга, допускается заключение Договоров репо между Центральным контрагентом и Участником торгов без подачи Заявок репо. Указанный Договор репо заключается в порядке, предусмотренном пунктом 11.4 настоящих Правил.

24.13. В реестре Договоров может содержаться информация, указанная в пункте 23.5. настоящих Правил.

Глава IX. Проведение Торгов в Режиме торгов «Безадресное репо с Центральным контрагентом»

Статья 25. Порядок подачи Заявок

25.1. В Режиме торгов «Безадресное репо с Центральным контрагентом» могут подаваться только Заявки репо на покупку и Заявки репо на продажу с соблюдением требований настоящих Правил.

25.2. В Режиме торгов «Безадресное репо с Центральным контрагентом» Участники торгов вправе подавать только Лимитные Заявки репо.

Под Лимитной Заявкой репо понимается Заявка репо, обладающая в совокупности следующими признаками:

- Заявка репо является безадресной;
- Заявка репо является анонимной;
- Заявка репо действует до конца Торгового дня. В случае неисполнения указанной Заявки репо до конца Торгового дня, в течение которого она была объявлена, указанная Заявка репо удаляется Компанией после окончания указанного Торгового дня;

- Заявка репо допускает частичное исполнение. В случае частичного исполнения Заявки репо в течение Торгового дня неисполненный остаток ставится в Очередь заявок. В случае частичного исполнения указанной Заявки репо к моменту окончания Торгового дня, в течение которого она была объявлена, указанная Заявка репо удаляется Компанией в неисполненной части после окончания указанного Торгового дня.

25.3. При подаче Заявки репо в Систему проведения торгов Заявка репо на покупку и Заявка репо на продажу должны содержать:

- указание на код Участника торгов, подавшего Заявку репо;
- Краткий код (коды) Клиента (Клиентов), по поручению или в интересах которого (которых) подана Заявка репо (при подаче Участником торгов Заявки репо на заключение Договора репо по поручению и за счет Клиентов);

- указание на Идентификатор Участника торгов, подавшего Заявку репо;
- указание на вид Заявки репо;
- указание на направленность Заявки репо (Заявка репо на покупку или Заявка репо на продажу);

- указание на идентификационный код Qualified Investments;
- количество Qualified Investments, выраженное в Лотах;
- указание на Торгово-клиринговый счет;
- Ставку репо (в процентах годовых);
- цену первой части Договора репо;
- указание на валюту цены;

- указание на валюту расчетов;
- указание на Код расчетов;
- указание на Режим торгов, в котором подается Заявка репо.

25.4. В Режиме торгов «Безадресное репо с Центральным контрагентом» две разнонаправленные Заявки репо являются встречными при совпадении параметров, указанных в пунктах 11.2.1 – 11.2.3 настоящих Правил, а также при условии, что Ставка репо, указанная в Заявке репо на покупку (с учетом знака), не больше Ставки репо, указанной в Заявке репо на продажу (с учетом знака).

Статья 26. Порядок заключения Договоров

26.1. В Режиме торгов «Безадресное репо с Центральным контрагентом» заключаются Договоры репо. Договоры репо в Режиме торгов «Безадресное репо с Центральным контрагентом» заключаются в порядке, установленном в статье 11 настоящих Правил и в настоящей статье.

26.2. Договор репо заключается на основании двух Заявок репо, являющихся встречными в соответствии с пунктом 25.4 настоящих Правил.

26.3. Если решением Компании не предусмотрено иное, то для целей заключения Договоров репо в качестве цены первой части Договора репо используется расчетная цена, определяемая Центральным контрагентом

26.4. Сумма репо рассчитывается по следующим формулам:

Для Договора репо, предметом которого являются Qualified Investments, за исключением облигаций:

$$Sum = P1 * q * Q,$$

где:

Sum - сумма репо, рассчитываемая с точностью до двух знаков после запятой;

Q – количество Qualified Investments, являющееся предметом Договора репо, выраженное в Лотах;

P1 – цена первой части Договора репо, определенная в соответствии с пунктом 26.3 настоящих Правил (в процентах от номинальной стоимости);

q - количество Qualified Investments в одном Лоте, установленное для данной Qualified Investments, в штуках.

Для Договора репо, предметом которого являются облигации:

$$Sum = (P1 * N / 100\% + NCD) * Q * q,$$

где:

Sum - сумма репо, рассчитываемая с точностью до двух знаков после запятой;

Q – количество Qualified Investments, являющееся предметом Договора репо, выраженное в Лотах;

P1 – цена первой части Договора репо, определённая в соответствии с пунктом 26.3 настоящих Правил (в процентах от номинальной стоимости);

NCD – накопленный купонный доход, рассчитываемый в соответствии с решением о выпуске (дополнительном выпуске) Qualified Investments;

q - количество Qualified Investments в одном Лоте, установленное для данной Qualified Investments, в штуках;

N – номинальная стоимость облигации.

26.5. Сумма второй части Договора репо рассчитывается по следующей формуле:

$$Sum2 = Sum * \left(1 + \frac{r}{100} * \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right) \right),$$

где:

Sum2 - сумма второй части Договора репо, рассчитываемая с точностью до двух знаков после запятой;

Sum - сумма репо;

r - Ставка репо, в процентах годовых;

T₃₆₅ - число дней между Датой исполнения первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо, приходящихся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T₃₆₆ - число дней между Датой исполнением первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо, приходящихся на календарный год, состоящий из 366 дней.

26.6. Цена второй части Договора репо рассчитывается по следующим формулам:

Для Договора репо, предметом которого являются Qualified Investments, за исключением облигаций:

$$P2 = \frac{Sum2}{(Q * q)},$$

где:

P2 - цена второй части Договора репо;

Q – количество Qualified Investments, являющееся предметом Договора репо, выраженное в Лотах;

q - количество Qualified Investments в одном Лоте, установленное для данной Qualified Investments, в штуках;

Sum2 - сумма второй части Договора репо, рассчитываемая в соответствии с пунктом 26.5 настоящих Правил.

Для Договора репо, предметом которого являются облигации:

$$P2 = \frac{(Sum2 - NCD * Q * q)}{N * Q * q} * 100\%,$$

где:

P2 - цена второй части Договора репо (в процентах от номинальной стоимости);

Sum2 - сумма второй части Договора репо, рассчитываемая в соответствии с пунктом 26.5 настоящих Правил;

NCD – накопленный купонный доход, рассчитываемый в соответствии с решением о выпуске (дополнительном выпуске) Qualified Investments;

Q – количество Qualified Investments, являющееся предметом Договора репо, выраженное в Лотах;

q - количество Qualified Investments в одном Лоте, установленное для данной Qualified Investments, в штуках;

N – номинальная стоимость облигации.

26.7. Договор репо заключается на основании Обрабатываемой Заявки репо и лучшей встречной Заявки репо, находящейся в Очереди заявок, исходя из Ставки репо, указанной в данной лучшей Заявке репо.

В случае частичного исполнения Заявки репо Заявка репо в неисполненной части подлежит выставлению в Очередь заявок.

Глава X. Проведение Торгов в Режиме торгов «Адресные валютные свопы с Центральным контрагентом»

Статья 27. Порядок подачи Заявок валютный своп

27.1. В Режиме торгов «Адресные валютные свопы с Центральным контрагентом» могут подаваться только Заявки валютный своп на покупку и Заявки валютный своп на продажу с соблюдением требований настоящих Правил.

27.2. В Режиме торгов «Адресные валютные свопы с Центральным контрагентом» Участники торгов вправе подавать только адресные неанонимные Заявки валютный своп.

27.3. Информация о поданной Заявке валютный своп раскрывается Участнику торгов, подавшему указанную Заявку валютный своп. Участник торгов в ходе Торгов имеет доступ к информации о Заявках валютный своп, адресованных указанному Участнику торгов.

27.4. При подаче Заявки валютный своп в Систему проведения торгов Заявка валютный своп на покупку и Заявка валютный своп на продажу должны содержать:

- указание на код Участника торгов, подавшего Заявку валютный своп;
- Краткий код (коды) Клиента (Клиентов), по поручению или в интересах которого (которых) подана Заявка валютный своп (при подаче Участником торгов Заявки валютный своп на заключение Договора по поручению и за счет Клиентов);
- указание на Идентификатор Участника торгов, подавшего Заявку валютный своп;
- указание на вид Заявки валютный своп;
- указание на направленность Заявки валютный своп (Заявка валютный своп на покупку или Заявка валютный своп на продажу);
- указание на идентификационный код Qualified Investments;
- количество Qualified Investments, выраженное в Лотах;
- указание на Торгово-клиринговый счет;
- указание на Идентификатор адресных сделок Участника торгов, подавшего Заявку валютный своп;

- указание на Идентификатор адресных сделок Участника торгов, которому адресована Заявка валютный своп;
- Ставку Валютного свопа (в процентах годовых);
- цену первой части Валютного свопа;
- указание на валюту цены;
- указание на валюту расчетов;
- указание на Код расчетов;
- указание на Режим торгов, в котором подается Заявка валютный своп.

27.5. Заявка валютный своп может содержать ссылку, под которой понимается последовательность символов, дополнительно используемая для установления соответствия Объявленных Заявок валютный своп друг другу в соответствии с настоящими Правилами.

27.6. В Режиме торгов «Адресные валютные свопы с Центральным контрагентом» две разнонаправленные Заявки валютный своп являются встречными при совпадении параметров, указанных в пунктах 11.2.1 – 11.2.3 настоящих Правил, а также при совпадении следующих параметров:

- Ставки Валютного свопа, указанной в Заявках валютный своп;
- количества Qualified Investments, указанного в Заявках валютный своп;
- цены первой части Валютного свопа, указанной в Заявках валютный своп;
- Идентификатора адресных сделок Участника торгов, объявившего Заявку валютный своп, указанного в одной из Заявок валютный своп, и Идентификатора адресных сделок Участника торгов, которому адресована Заявка валютный своп, указанного в другой Заявке валютный своп;
- ссылки (в случае указания хотя бы в одной из Заявок валютный своп).

Статья 28. Порядок заключения Валютных свопов

28.1. В Режиме торгов «Адресные валютные свопы с Центральным контрагентом» заключаются Валютные свопы. Валютные свопы в Режиме торгов «Адресные валютные свопы с Центральным контрагентом» заключаются в порядке, установленном в статье 11 настоящих Правил и в настоящей статье.

28.2. Валютный своп заключается на основании двух разнонаправленных Заявок валютный своп, являющихся встречными в соответствии с пунктом 27.6 настоящих Правил.

28.3. Режим торгов «Адресные валютные свопы с Центральным контрагентом» может состоять из периода, в течение которого Участники торгов вправе подавать Заявки валютный своп, в которых указаны одинаковые ТКС (далее – Внутриброкерские валютные свопы). Возможность проведения периода Внутриброкерские валютные свопы может быть установлена решением Компании для одной или нескольких Qualified Investments, и (или) для одного или нескольких Кодов расчетов, и (или) для одной или нескольких Групп инструментов.

Для целей установления соответствия Заявок валютный своп друг другу и заключения Валютных свопов в рамках периода Внутриброкерские валютные свопы встречными Заявками валютный своп могут являться две разнонаправленные Заявки валютный своп при совпадении параметров, указанных в пункте 27.6 настоящих Правил, а также при совпадении ТКС, указанных в данных Заявках валютный своп.

Режим торгов «Адресные валютные свопы с Центральным контрагентом» может состоять из периода, в течение которого Валютные свопы заключаются без подачи Заявок в порядке, указанном в пункте 11.4 настоящих Правил.

28.4. Режим «Адресные валютные свопы с Центральным контрагентом» может состоять из периода, в течение которого Валютные свопы заключаются между Участниками торгов и Центральным контрагентом. Валютный своп заключается на основании Заявки, адресованной Участником торгов Центральному контрагенту, и Заявки, подаваемой Центральным контрагентом в адрес Участника торгов (далее – РПС с ЦК Режима «Адресные валютные свопы с Центральным контрагентом»).

В Заявках, подаваемых Участниками торгов, должно содержаться указание на Идентификатор адресных сделок Участника торгов, однозначно идентифицирующий Центрального контрагента.

Возможность проведения периода РПС с ЦК Режима «Адресные валютные свопы с Центральным контрагентом» может быть установлена решением Компании для одной или нескольких Qualified Investments, и (или) для одного или нескольких Кодов расчетов, и (или) для одной или нескольких Групп инструментов.

Для целей установления соответствия Заявок друг другу и заключения Договоров в рамках периода РПС с ЦК Режима «Адресные валютные свопы с Центральным контрагентом» встречными Заявками могут являться две разнонаправленные Заявки при совпадении параметров, указанных в пункте 27.6 настоящих Правил, а также при условии, что один из Идентификаторов адресных сделок Участника торгов, указанных в Заявках, однозначно определяет Центрального контрагента.

28.5. Валютные свопы заключается по цене первой части Валютного свопа и в отношении количества Qualified Investments, указанного во встречных Заявках валютный своп. В случае, когда объявлены две встречные Заявки валютный своп, Валютный своп заключается на основании встречной Заявки валютный своп, объявленной ранее.

28.6. Участник торгов, которому адресована Заявка валютный своп, вправе отклонить указанную Заявку валютный своп. Отклоненная Участником торгов Заявка валютный своп удаляется Компанией.

28.7. Если решением Компании не предусмотрено иное, то в целях заключения Валютных свопов в Режиме торгов «Адресные валютные свопы с Центральным контрагентом» в качестве цены первой части Валютного свопа используется расчетная цена Qualified Investments, определенная Центральным контрагентом

28.8. Сумма Валютного свопа рассчитывается по следующей формуле:

$$Sum = P1 * q * Q,$$

где:

Sum - сумма Валютного свопа, рассчитываемая с точностью до двух знаков после запятой;

Q – количество Qualified Investments, являющееся предметом Валютного свопа, выраженное в Лотах;

P1 – цена первой части Валютного свопа, определенная в соответствии с пунктом 28.7 настоящих Правил;

q - количество Qualified Investments в одном Лоте, установленное для данной Qualified Investments, в штуках.

28.9. Цена второй части Валютного свопа рассчитывается по следующей формуле:

$$P2 = P1 + SwapPrice$$

где:

P2 - цена второй части Валютного свопа;

P1 – цена первой части Валютного свопа, определенная в соответствии с пунктом 28.7 настоящих Правил;

SwapPrice – Цена валютного свопа.

28.10. Сумма второй части Валютного свопа рассчитывается по следующей формуле:

$$Sum2 = P2 * Q * q,$$

где:

Sum2 - сумма второй части Валютного свопа, рассчитываемая с точностью до двух знаков после запятой;

P2 - цена второй части Валютного свопа;

Q – количество Qualified Investments, являющееся предметом Валютного свопа, выраженное в Лотах;

q - количество Qualified Investments в одном Лоте, установленное для данной Qualified Investments, в штуках.

28.11. В случае если в течение Торгового дня Заявка валютный своп не была исполнена, указанная Заявка валютный своп подлежит удалению Компанией по окончании соответствующего Торгового дня.

28.12. В целях прекращения обязательств по Валютным свопам, заключенным в Режиме торгов «Адресные валютные свопы с Центральным контрагентом», возникших в результате неисполнения или ненадлежащего исполнения указанных обязательств, а также для целей прекращения неисполненных обязательств в соответствии с условиями и порядком, установленными Правилами клиринга, допускается заключение Валютных свопов между Центральным контрагентом и Участником торгов без подачи Заявок валютный своп. Указанный Валютный своп заключается в порядке, предусмотренном пунктом 11.4 настоящих Правил.

28.13. В реестре Договоров может содержаться информация, указанная в пункте 27.5. настоящих Правил.

Глава XI. Проведение Торгов в Режиме торгов «Безадресные валютные свопы с Центральным контрагентом»

Статья 29. Порядок подачи Заявок

29.1. В Режиме торгов «Безадресные валютные свопы с Центральным контрагентом» могут подаваться только Заявки валютный своп на покупку и Заявки валютный своп на продажу с соблюдением требований настоящих Правил.

29.2. В Режиме торгов «Безадресные валютные свопы с Центральным контрагентом» Участники торгов вправе подавать только Лимитные Заявки валютный своп.

Под Лимитной Заявкой валютный своп понимается Заявка валютный своп, обладающая в совокупности следующими признаками:

- Заявка валютный своп является безадресной;
- Заявка валютный своп является анонимной;
- Заявка валютный своп действует до конца Торгового дня. В случае неисполнения указанной Заявки валютный своп до конца Торгового дня, в течение которого она была объявлена, указанная Заявка валютный своп удаляется Компанией после окончания указанного Торгового дня;

- Заявка валютный своп допускает частичное исполнение. В случае частичного исполнения Заявки валютный своп в течение Торгового дня неисполненный остаток ставится в Очередь заявок. В случае частичного исполнения указанной Заявки валютный своп к моменту окончания Торгового дня, в течение которого она была объявлена, указанная Заявка валютный своп удаляется Компанией в неисполненной части после окончания указанного Торгового дня.

29.3. При подаче Заявки валютный своп в Систему проведения торгов Заявка валютный своп на покупку и Заявка валютный своп на продажу должны содержать:

- указание на код Участника торгов, подавшего Заявку валютный своп;
- Краткий код (коды) Клиента (Клиентов), по поручению или в интересах которого (которых) подана Заявка валютный своп (при подаче Участником торгов Заявки валютный своп на заключение Валютного свопа по поручению и за счет Клиентов);
- указание на Идентификатор Участника торгов, подавшего Заявку валютный своп;
- указание на вид Заявки валютный своп;
- указание на направленность Заявки валютный своп (Заявка валютный своп на покупку или Заявка валютный своп на продажу);
- указание на идентификационный код Qualified Investments;
- количество Qualified Investments, выраженное в Лотах;
- указание на Торгово-клиринговый счет;
- Ставку Валютного свопа (в процентах годовых);
- цену первой части Валютного свопа;
- указание на валюту цены;
- указание на валюту расчетов;
- указание на Код расчетов;
- указание на Режим торгов, в котором подается Заявка валютный своп.

29.4. В Режиме торгов «Безадресные Валютные свопы с Центральным контрагентом» две разнонаправленные Заявки валютный своп являются встречными при совпадении параметров, указанных в пунктах 11.2.1 – 11.2.3 настоящих Правил, а также при условии, что Ставка Валютного свопа, указанная в Заявке валютный своп на покупку (с учетом знака), не больше Ставки Валютного свопа, указанной в Заявке валютный своп на продажу (с учетом знака).

Статья 30. Порядок заключения Валютных свопов

30.1. В Режиме торгов «Безадресные валютные свопы с Центральным контрагентом» заключаются Валютные свопы. Валютные свопы в Режиме торгов «Безадресные валютные свопы с Центральным контрагентом» заключаются в порядке, установленном в статье 11 настоящих Правил и в настоящей статье.

30.2. Валютные свопы заключается на основании двух Заявок валютный своп, являющихся встречными в соответствии с пунктом 29.4 настоящих Правил.

30.3. Если решением Компании не предусмотрено иное, то для целей заключения Валютных свопов в качестве цены первой части Валютного свопа используется расчетная цена, определяемая Центральным контрагентом

30.4. Сумма Валютного свопа рассчитывается по следующей формуле:

$$Sum=P1*q*Q,$$

где:

Sum - сумма Валютного свопа, рассчитываемая с точностью до двух знаков после запятой;
Q – количество Qualified Investments, являющееся предметом Валютного свопа, выраженное в Лотах;

P1 – цена первой части Валютного свопа, определенная в соответствии с пунктом 30.3 настоящих Правил (в процентах от номинальной стоимости);

q - количество Qualified Investments в одном Лоте, установленное для данной Qualified Investments, в штуках.

30.5. Цена второй части Валютного свопа рассчитывается по следующей формуле:

$$P2 = P1 + SwapPrice$$

где:

P2 - цена второй части Валютного свопа;

P1 – цена первой части Валютного свопа, определенная в соответствии с пунктом 30.3 настоящих Правил;

SwapPrice – Цена валютного свопа.

30.6. Сумма второй части Валютного свопа рассчитывается по следующей формуле:

$$Sum2 = P2 * Q * q,$$

где:

Sum2 - сумма второй части Валютного свопа, рассчитываемая с точностью до двух знаков после запятой;

P2 - цена второй части Валютного свопа;

Q – количество Qualified Investments, являющееся предметом Валютного свопа, выраженное в Лотах;

q - количество Qualified Investments в одном Лоте, установленное для данной Qualified Investments, в штуках.

30.7. Валютный своп заключается на основании Обрабатываемой Заявки валютный своп и лучшей встречной Заявки валютный своп, находящейся в Очереди заявок, исходя из Ставки Валютного свопа, указанной в данной лучшей Заявке валютный своп.

В случае частичного исполнения Заявки валютный своп Заявка валютный своп в неисполненной части подлежит выставлению в Очередь заявок.

Глава XII. Иные положения

Статья 31. Приостановка, возобновление и прекращение Торгов

31.1. Под приостановкой Торгов в рамках настоящей статьи понимается приостановка Торгов в ходе их проведения, а также отсрочка начала проведения Торгов.

31.2. Компания приостанавливает или прекращает Торги в случаях, предусмотренных настоящими Правилами.

Требования о прекращении или приостановлении Торгов распространяются на основную и дополнительные торговые сессии. Требования, установленные в настоящем пункте Правил, не применяются при заключении Договоров репо, за исключением случая приостановки Торгов по основанию, указанному в пункте 31.6. настоящих Правил.

При наличии оснований для приостановки Торгов, указанных в настоящем пункте, за исключением приостановки Торгов по основанию, указанному в пункте 31.6. настоящих Правил, Компания вправе проводить Торги в рамках аукциона закрытия Режима основных торгов при соблюдении следующих условий:

- период времени, в течение которого Участниками торгов могут подаваться Заявки для участия в аукционе закрытия, соответствует периоду времени подачи Заявок, определённого в статье 17 настоящих Правил;

- цена Договоров равна цене аукциона закрытия, определяемой в соответствии со статьёй 17 настоящих Правил;

- Заявки аукциона закрытия поданы не менее чем одним Участником торгов;

- минимальное совокупное количество Qualified Investments, выраженное в Лотах, отдельно в Заявках на покупку и в Заявках на продажу, поданных для участия в аукционе закрытия, составило не менее 1 (одного) Лота.

31.3. Компания вправе принять решение о приостановке Торгов при возникновении обстоятельств, которые нарушают или могут нарушить нормальный порядок проведения Торгов, к которым в частности, относятся:

технические сбои и (или) ошибки в работе Системы проведения торгов, сбои в работе информационно-коммуникационных средств связи, с помощью которых обеспечивается проведение Торгов, или иных средств, обеспечивающих нормальный порядок проведения Торгов; сбои в работе энергоснабжения;

обстоятельства непреодолимой силы, в том числе введение чрезвычайного или военного положения, наступление иных обстоятельств природного и (или) техногенного характера;

нефункционирование или ненадлежащее функционирование Центрального контрагента, Расчетной организации и/или иных организаций, которые могут повлиять на нормальный порядок проведения Торгов;

любые обстоятельства, которые могут привести к ненадлежащему функционированию программных средств и (или) оборудования, необходимых для проведения Торгов;

иные обстоятельства, которые могут привести к нарушению порядка проведения Торгов.

31.4. Компания вправе принять решение о приостановке Торгов в случае получения от Центрального контрагента информации о необходимости изменений верхнего и/или нижнего лимитов колебаний цены Qualified Investments.

31.5. Компания вправе приостановить Торги и (или) прекратить Торги Qualified Investments иностранного эмитента в случае приостановки или прекращения торгов этими Qualified Investments на иностранной бирже, на которой они прошли процедуру листинга и (или) обращаются.

31.6. Компания приостанавливает Торги при возникновении технических сбоев в работе Системы проведения торгов, которые оказывают влияние или могут оказать влияние на ход Торгов, установленный в соответствии с настоящими Правилами, в течение Торгового дня в отношении большинства Участников торгов. При возникновении указанных технических сбоев Торги приостанавливаются в течение 5 (пяти) минут с момента выявления технического сбоя.

31.7. Компания вправе приостановить Торги по Qualified Investments эмитента с момента раскрытия эмитентом в течение Торгового дня существенной информации, которая может оказать существенное влияние на ход Торгов указанной Qualified Investments. Торги указанной Qualified Investments могут быть возобновлены на основании решения Компании.

31.8. Если в течение текущего Торгового дня приостановленные Торги были возобновлены менее чем за один час до окончания основной торговой сессии, Компания вправе продлить основную торговую сессию после истечения времени, предусмотренного настоящими Правилами для ее проведения. Информация о продлении основной торговой сессии раскрывается на сайте Компании в сети Интернет и (или) посредством Системы проведения торгов.

31.9. О приостановке Торгов Участники торгов извещаются с использованием Системы проведения торгов (при условии ее работоспособности) и (или) другим доступным способом.

31.10. Компания вправе приостанавливать Торги в целях проведения клиринговых сессий, время и порядок проведения которых установлены внутренними документами Центрального контрагента

31.11. После устранения (прекращения) обстоятельств, послуживших причиной приостановки Торгов, Торги возобновляются.

О возобновлении Торгов Участники торгов извещаются не позднее чем за 15 (пятнадцать) минут до возобновления Торгов с использованием Системы проведения торгов, путем опубликования соответствующего сообщения на сайте Компании в сети Интернет, и (или) другим доступным способом.

До возобновления Торгов Компания предоставляет Участникам торгов возможность отозвать объявленные Заявки посредством Системы проведения торгов. Отзыв Заявок осуществляется в порядке и в сроки, предусмотренные настоящими Правилами.

В случае невозможности отозвать объявленные Заявки посредством Системы проведения торгов Участник торгов может предоставить Компании заявление на удаление объявленных им Заявок в форме Электронного документа посредством системы электронного документооборота, при условии подключения Сторон к данной системе, или по телефону.

31.12. В случае если в течение 20 (двадцати) минут обстоятельства, послужившие основанием для приостановки Торгов, не устранены, Старший исполнительный директор Компании вправе принять решение о досрочном прекращении Торгов.

Извещение Участников торгов о досрочном прекращении Торгов осуществляется способом, указанным в пункте 31.9 настоящих Правил.

31.13. Информация о прекращении Торгов всеми Qualified Investments, в том числе в отдельном Режиме торгов, раскрывается на сайте Компании в сети Интернет не позднее, чем за один месяц до даты прекращения Торгов, и не позднее одного Торгового дня, следующего за днем принятия Компанией соответствующего решения.

Статья 32. Информация, связанная с ходом и итогами Торгов

32.1. Компания является обладателем всей информации, связанной с ходом и итогами Торгов.

32.2. Компания, Участники торгов и (или) Клиенты вправе предоставлять информацию, связанную с ходом и итогами Торгов, а также производную информацию, созданную на основе информации, связанной с ходом и итогами Торгов, своим Клиентам для целей участия в Торгах и принятия решения о подаче Заявок и (или) заключении Договоров.

Предоставление информации, связанной с ходом и итогами Торгов, а также производной информации, созданной на основе информации, связанной с ходом и итогами Торгов, лицам, не указанным в настоящем пункте Правил, и (или) для целей, не предусмотренных настоящим пунктом Правил, и распространение указанной информации неограниченному кругу лиц возможно только на основании договора с Компанией.

32.3. В случае нарушения Участником торгов пункта 32.2 настоящих Правил Компания вправе требовать от Участника торгов возмещения убытков, возникших у Компании в связи с таким нарушением.

32.4. Не является распространением информации и не влечет применение мер ответственности в соответствии со статьей 32.3 настоящих Правил предоставление Участником торгов своему Клиенту информации о ходе Торгов в объеме, необходимом для принятия решения о заключении Договоров, а также об итогах Торгов в отношении Договоров, которые были заключены в интересах и за счет этого Клиента.

32.5. Компания раскрывает на сайте Компании в сети Интернет информацию:

(а) текущие цены и объем заявок и предложений;

(б) степень заинтересованности трейдеров в ценах и объемах, объявленных через ее системы для Qualified Investments; и

(с) любую другую информацию, относящуюся к Qualified Investments, которая обеспечивает прозрачность торговли.

32.6. Компания вправе раскрывать в Системе проведения торгов информацию обо всех Договорах, заключенных в текущий Торговый день, без указания кодов Участников торгов и кодов Клиентов, которые присвоены им в порядке, предусмотренном документами Компании.

32.7. Компания вправе утвердить внутренний документ, определяющий порядок и условия предоставления, распространения и использования информации, связанной с ходом и итогами Торгов, обязательный для исполнения всеми заинтересованными лицами.

Статья 33. Информация о Торгах

33.1. Компания каждый Торговый день представляет Участнику торгов выписку из реестра Договоров, содержащую информацию о Договорах, заключенных данным Участником торгов на Торгах в течение соответствующего Торгового дня. Выписка из реестра Договоров о Договорах, заключенных данным Участником торгов, предоставляется Участнику торгов посредством Системы проведения торгов в режиме реального времени или посредством Системы электронного документооборота. Выписка из реестра Договоров о Договорах, заключенных данным Участником торгов, считается предоставленной Участнику торгов в момент регистрации Договора в реестре Договоров. Реестр Договоров, заключенных Участником торгов в течение Торгового дня, представляет собой совокупность сведений, содержащихся в отчетах обо всех таких Договорах, и считается предоставленным Участнику торгов с момента предоставления ему указанных отчетов.

33.2. Выписки из реестра Договоров содержат все сведения, указанные в статье 12 настоящих Правил.

33.3. Компания вправе в дополнение к информации, содержащейся в выписках из реестра Договоров предоставлять Участникам торгов дополнительные отчеты, состав информации, порядок, формы и сроки предоставления которых устанавливаются внутренними документами Компании и подлежат опубликованию на сайте Компании в сети Интернет.

Статья 34. Определение тарифов Компании

34.1. Участник торгов обязуется оплачивать услуги Компании по проведению Торгов.

34.2. Оплата услуг Компании по проведению Торгов осуществляется в виде разовых и периодических платежей в соответствии с тарифами, установленными Советом директоров Компании (далее - Тарифы).

34.3. Тарифы подлежат опубликованию на сайте Компании в сети Интернет. В случае внесения изменений в Тарифы Компания извещает Участников торгов об установлении/изменении Тарифов не менее чем за 3 (три) рабочих дня до вступления указанных Тарифов в силу.

34.4. Компания вправе в одностороннем порядке изменять размер Тарифов.

Статья 35. Порядок оплаты услуг Компании

35.1. По усмотрению Компании Тарифы могут удерживаться с торговых или клиринговых счетов в порядке, определенном в Правилах клиринга или оплачиваться на основании выставленных Компанией счетов.

35.2. Уплата иных платежей в оплату услуг Компании, помимо определенных в соответствии с пунктом 34.2 настоящих Правил, осуществляется не позднее 5 (пяти) рабочих дней со дня выставления Участнику торгов соответствующего счета.

35.3. Временной период оказания услуг Компании устанавливается равным 1 (одному) календарному месяцу.

35.4. Неисполнение или ненадлежащее исполнение обязанностей по оплате услуг Компании в том числе в связи с отсутствием или недостаточностью денежных средств на счетах, определенных в пункте 35.1. настоящих Правил, является основанием для применения мер ответственности к Участнику торгов, в том числе в соответствии с Правилами допуска и иными внутренними документами Компании.

35.5. Услуги считаются оказанными Участнику торгов надлежащим образом за истекший календарный месяц, если в течение 5 (пяти) рабочих дней после его окончания Участник торгов письменно не заявит об обратном.

Статья 36. Порядок осуществления контроля за Участниками торгов и контроля за операциями

36.1 Компания осуществляет контроль за Участниками торгов и за операциями, совершаемыми Участниками торгов в ходе проведения Торгов, в соответствии с внутренними документами, утвержденными Компанией.

36.2. В целях предотвращения, выявления и пресечения неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком Компания осуществляет контроль за операциями с Qualified Investments, осуществляемыми на Торгах. При осуществлении такого контроля Компания:

- устанавливает правила предотвращения, выявления и пресечения случаев неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком, в том числе критерии сделок (заявок), имеющих признаки неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком (далее - нестандартные сделки (заявки));

- осуществляет проверку нестандартных сделок (заявок) на предмет неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком.

36.3. При осуществлении контроля, предусмотренного настоящей статьей, Компания, вправе:

- требовать от Участников торгов представления необходимых документов (в том числе полученных Участником торгов от его Клиента), объяснений, информации соответственно в письменной и устной форме.

36.5. При осуществлении мониторинга Торгов, а также контроля за Участниками торгов и иными лицами Компании осуществляет следующие действия:

- выявляет нестандартные сделки (заявки), заключенные (поданные) в ходе Торгов;
- проверяет нестандартные сделки (заявки) на предмет неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком;
- проверяет нестандартные сделки (заявки) на предмет нарушения внутренних документов Компании.

36.6. При наличии оснований квалифицировать нестандартную сделку (заявку) как нарушение внутренних документов Компании, Компания принимает решение о применении мер к Участникам торгов, являющимся сторонами такой сделки или подавшими заявки.

36.7. К нестандартным сделкам (заявкам), которые могут быть квалифицированы как нарушения настоящих Правил и иных внутренних документов Компании могут относиться сделки, приведшие к существенному изменению одного или нескольких из перечисленных ниже показателей:

- цены закрытия;
- текущей цены;
- средневзвешенной цены.

Статья 37. Ответственность

37.1. За нарушение правил совершения операций Компании Участник торгов несет ответственность, предусмотренную настоящими Правилами и нормативными документами и правилами МФЦА.

37.2. Компания не несет ответственности в случае невозможности исполнения своих обязательств по оказанию услуг по организации Торгов, возникшей в результате обстоятельств, указанных в пунктах 31.3 и 31.6. настоящих Правил.

37.3. К значительным нарушениям Участника торгов относятся нарушения им требований нормативных документов и правил МФЦА и настоящих Правил, которые повлекли причинение убытков другим Участникам торгов, Компании и (или) Центральному контрагенту

37.4. В случае неисполнения Участниками торгов обязательств, возникших из заключенных Договоров, а также при наличии у Компании оснований квалифицировать нестандартную сделку (заявку) как нарушение внутренних документов Компании, Компания вправе принять решение о применении к Участникам торгов одну из следующих мер воздействия:

- предупреждение;
- приостановление допуска к участию в Торгах в отдельных Режимах торгов, и (или) к подаче Заявок, и (или) к заключению Договоров в отношении Qualified Investments, Группы инструментов и (или) Кода расчетов;
- приостановление допуска к участию в Торгах Компании;
- прекращение допуска к участию в Торгах Компании.

Статья 38. Порядок разрешения споров и применимое законодательство.

38.1. Все споры, разногласия и требования, возникающие в связи с оказанием Компанией услуг в соответствии с настоящими Правилами и Правилами допуска, с заключением, изменением или прекращением Договоров, а также исполнением обязательств из Договоров или в связи с ними, подлежат разрешению в суде МФЦА в соответствии с его правилами, действующими на дату подачи искового заявления.

38.2. Передача споров на разрешение в суд МФЦА возможна только после соблюдения предварительного претензионного порядка урегулирования споров. В случае полного или частичного отказа в удовлетворении претензии или неполучения ответа в течение 7 (семи) дней с момента получения претензии заявитель вправе предъявить иск в суд МФЦА.

38.3. Решения суда МФЦА являются окончательными и обязательными для сторон.

38.4. Участники торгов обязаны воздерживаться от действий, направленных на затягивание процесса рассмотрения спора в суде МФЦА, а в случае вынесения судом МФЦА решения – на затягивание сроков исполнения определений и решений, вынесенных судом МФЦА.

38.5. .

38.6. Компания обязуется хранить документы и сведения, связанные с рассмотрением всех споров, возникших в рамках настоящих Правил и Правил допуска, в течение не менее 6 лет со дня поступления соответствующих документов и сведений.

Статья 39. Правила предотвращения, выявления и пресечения случаев неправомерного использования инсайдерской информации и (или) манипулирования рынком

39.1. Участник торгов не вправе осуществлять действия, относящиеся к манипулированию рынком в соответствии с нормативными документами и правилами МФЦА.

39.2. Участник торгов не вправе использовать инсайдерскую информацию для подачи Заявок и заключения Договоров на Торгах.

**Условия Договоров купли-продажи Qualified Investments,
заключенных на Торгах**

1. По Договору купли-продажи, заключенному на Торгах, одна сторона - продавец обязуется передать совокупность Qualified Investments, в отношении которых заключен Договор (далее - Пакет Qualified Investments) в собственность другой стороне - покупателю, а покупатель обязуется принять в собственность и оплатить Пакет Qualified Investments в соответствии с настоящим Приложением.

2. Условия заключенного Договора не могут быть изменены.

3. В Дату исполнения Договора продавец должен исполнить свои обязательства по перерегистрации Пакета Qualified Investments, а покупатель должен исполнить свои обязательства по перерегистрации Пакета Qualified Investments и оплате указанного Пакета. Перерегистрация Пакета Qualified Investments означает осуществление юридических и фактических действий, связанных с переходом права собственности на Qualified Investments в соответствии с условиями заключенного Договора.

4. Исполнение обязательств Сторон осуществляется в порядке, установленном Правилами клиринга. При этом:

- Участник клиринга, являющийся продавцом, обязан к определенному в соответствии с настоящими Правилами торгов и Правилами клиринга моменту времени в дату исполнения Договора обеспечить наличие на счете (субсчете) депо, используемом для проведения расчетов по Договору, Qualified Investments в количестве, достаточном для проведения указанных расчетов;

- Участник клиринга, являющийся покупателем, обязан к определенному в соответствии с настоящими Правилами торгов и Правилами клиринга моменту времени в дату исполнения Договора обеспечить наличие на счете, используемом для расчетов по Договору, денежные средства в сумме, достаточной для проведения указанных расчетов;

- стороны Договора обязаны осуществлять иные действия и соблюдать иные требования, необходимые для проведения расчетов по Договору в соответствии с Правилами клиринга.

5. Каждая из сторон Договора самостоятельно несет расходы, связанные с исполнением обязательств по Договору.

6. Продавец гарантирует, что на момент перерегистрации Пакета Qualified Investments он имеет все права, необходимые для передачи покупателю прав на Пакет Qualified Investments, не обремененный залогом или иными правами третьих лиц, препятствующими передаче прав на Пакет Qualified Investments покупателю.

7. Стороны не вправе в одностороннем порядке отказаться от исполнения обязательств по оплате и перерегистрации Пакета Qualified Investments.

8. Расторжение заключенного Договора не допускается.

Порядок использования АСП

1. Настоящее Приложение устанавливает порядок использования АСП на Торгах, а также способ и периодичность идентификации Участников торгов.

2. АСП используется при подаче (направлении) с использованием Системы проведения торгов Заявок или иных электронных сообщений, предусмотренных настоящими Правилами. Заявка или иное электронное сообщение, подписанное АСП, признается электронным документом, равнозначным документу на бумажном носителе, подписанному собственноручной подписью уполномоченного лица Участника торгов.

3. Заявка или иное электронное сообщение считается подписанным АСП с момента отправки Участником торгов в Систему проведения торгов такой Заявки или иного электронного сообщения при условии успешного прохождения Участником торгов процедуры аутентификации в порядке, предусмотренном настоящим Приложением.

4. Присвоение Имени и Пароля Участнику торгов осуществляется техническим центром, определенным Компанией, информация о котором раскрыта на сайте Компании в сети Интернет (далее – технический центр), на основании договора (соглашения), заключенного между Участником торгов и техническим центром, посредством внесения указанных Имени и Пароля в базу данных Системы проведения торгов.

5. Процедура аутентификации осуществляется техническим центром с использованием Системы проведения торгов при осуществлении технического доступа Участника торгов в Систему проведения торгов путем сопоставления введенных Имени и Пароля соответствующим Имени и Паролю Участника торгов, информация о которых содержится в базе данных Системы проведения торгов. В случае успешного прохождения процедуры аутентификации Участник торгов получает возможность доступа к Системе проведения торгов. Аутентификация Участника торгов осуществляется автоматическим способом при каждом входе Участника торгов в Систему проведения торгов.

6. Участник торгов соглашается с тем, что техническим центром могут быть изготовлены (распечатаны) копии Заявок или иных электронных сообщений, подписанных АСП, на бумажном носителе, которые удостоверяются подписью уполномоченного лица технического центра и являются доказательством факта направления Заявки или иного электронного сообщения с использованием Системы проведения торгов, а также подтверждают соответствие Заявки или иного электронного сообщения содержанию копии Заявки или иного электронного сообщения, изготовленного (распечатанного) на бумажном носителе.

7. Участник торгов обязуется хранить в тайне присвоенные им Пароль (Пароли) и несут риск последствий, вызванных нарушением тайны Пароля (Паролей). В случае нарушения тайны Пароля Участник торгов обязан незамедлительно уведомить об этом технический центр. Технический центр в этом случае присваивает Участнику торгов новый Пароль.