



МОСКОВСКАЯ БИРЖА

Закрытое акционерное общество «Фондовая биржа ММВБ»
(ЗАО «ФБ ММВБ»)
Большой Кисловский пер., 13, Москва, Россия, 125009
Тел. +7 (495) 363-32-32, факс +7 (495) 234-48-40
E-mail: fbinfo@moex.com, www.moex.com
ОКПО 71341319, ОГРН 1037789012414
ИНН/КПП 7703507076/775001001

21.09.2016 № 44-06/295
На №от

На основании информационного сообщения Министерства финансов РФ от 21 сентября 2016 года и в соответствии с Правилами проведения торгов в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ», утвержденными Советом директоров ЗАО «ФБ ММВБ» 25 апреля 2016 года (Протокол № 39), установлены следующие условия, время, срок и порядок проведения обмена облигаций федеральных займов с амортизацией долга с государственными регистрационными номерами 46005RMFS, 46014RMFS, 46018RMFS, 46019RMFS, 46020RMFS, 46021RMFS, 46022RMFS и 48001RMFS (далее отдельно и в совокупности - ОФЗ-АД) на облигации федеральных займов с постоянным купонным доходом с государственными регистрационными номерами 26217RMFS, 26218RMFS, 26219RMFS (далее отдельно и в совокупности - ОФЗ-ПД):

1. Обмен ОФЗ осуществляется путем проведения 28 сентября 2016 г. выкупа ОФЗ-АД в режиме торгов «Выкуп: Аукцион» и продажи ОФЗ-ПД в режиме «Размещение: Адресные заявки» (далее - обмен). Обмен проводится без приостановки вторичных торгов соответствующими выпусками ОФЗ-АД и ОФЗ-ПД в иных режимах торгов.
2. Исполнение обязательств по сделкам, совершаемым в рамках обмена, осуществляется 28 сентября 2016 г.
3. Выкуп ОФЗ-АД в режиме торгов «Выкуп: Аукцион» будет осуществляться путем заключения сделок на основании лимитных заявок с указанием цены (подача заявок с указанием доходности не предусмотрена). Заявки на продажу ОФЗ-АД направляются со следующими обязательными реквизитами:
 - цена, в % номинальной стоимости;

- количество ценных бумаг в штуках;
 - код расчетов ВО;
 - другие необходимые параметры в соответствии с Правилами торгов.
4. Участник торгов имеет право выставить не более 1 заявки на продажу каждого выпуска ОФЗ-АД от своего имени и за свой счет с указанием соответствующего собственного торгово-клирингового счета и/или не более 1 заявки на продажу каждого выпуска ОФЗ-АД от своего имени, по поручению и за счет каждого клиента с указанием соответствующего торгово-клирингового счета и кода клиента.

В случае подачи более 1 заявки на продажу одного и того же выпуска ОФЗ-АД от своего имени и за свой счет с указанием соответствующего собственного торгово-клирингового счета все заявки на продажу данного выпуска ОФЗ-АД, поданные от своего имени и за свой счет с указанием собственного торгово-клирингового счета, считаются не соответствующими условиям обмена и будут отклонены по окончании периода сбора заявок.

В случае подачи более 1 заявки на продажу одного и того же выпуска ОФЗ-АД по поручению и за счет одного и того же клиента с указанием соответствующего торгово-клирингового счета и кода клиента, все заявки на продажу данного выпуска ОФЗ-АД, поданные по поручению и за счет данного клиента считаются не соответствующими условиям обмена и будут отклонены по окончании периода сбора заявок.

5. Определено следующее время проведения торгов ОФЗ-АД в Режиме торгов «Выкуп: Аукцион» 28 сентября 2016 года:
- период сбора заявок на продажу: 10:00 - 10:30 мск;
 - снятие заявок, не соответствующих порядку обмена, изложенному в п.4 настоящего Уведомления и/или опубликованному на сайте Министерства финансов РФ: 10:30 – 11:00 мск;
 - снятие заявок с ценой, превышающей цену отсечения и/или не подлежащих удовлетворению: 12:20 – 12 :50 мск;
 - период удовлетворения заявок: 16:20 - 16:50 мск.
6. Размещение (продажа) ОФЗ-ПД будет осуществляться в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» путем заключения сделок на основании адресных заявок по фиксированной цене, поданных в адрес Банка России, действующего за счет и по поручению Министерства финансов РФ (идентификатор в системе торгов MZ0000200000, краткое наименование - ЦБ РФ), со следующими обязательными

реквизитами:

- цена, в % номинальной стоимости;
- количество ценных бумаг в штуках, рассчитанное в соответствии с порядком обмена ОФЗ-АД на ОФЗ-ПД, опубликованным на сайте Министерства финансов РФ;
- код расчетов ВО;
- другие необходимые параметры в соответствии с Правилами торгов.

7. В случае если суммарное количество предложенных к обмену участником торгов ОФЗ-АД от своего имени и за свой счет или суммарное количество предложенных к обмену участником торгов ОФЗ-АД от своего имени по поручению и за счет клиента - меньше или равно 10 шт., обмен происходит на один выпуск ОФЗ-ПД с Государственным регистрационным номером 26217RMFS (далее - Балансирующий выпуск). В этих случаях участник торгов подает только одну заявку на приобретение Балансирующего выпуска от своего имени и за свой счет или одну заявку на приобретение Балансирующего выпуска от своего имени, по поручению и за счет данного клиента, соответственно.

В иных случаях участник торгов обязан подать заявки на покупку 3-х выпусков ОФЗ-ПД от своего имени и за свой счет и/или по поручению и за счет соответствующего клиента.

Разность суммарной стоимости ОФЗ-АД и суммарной стоимости ОФЗ-ПД в заявках, поданных от своего имени и за свой счет и/или поданных от своего имени, по поручению и за счет клиента, не должна превышать стоимость одной облигации Балансирующего выпуска, соответственно.

8. Участник торгов имеет право подать не более 1 заявки на покупку каждого выпуска ОФЗ-ПД от своего имени и за свой счет с указанием соответствующего собственного торгово-клирингового счета и/или не более 1 заявки на покупку каждого выпуска ОФЗ-ПД от своего имени, по поручению и за счет клиента с указанием соответствующего торгово-клирингового счета и кода данного клиента.
9. Определено следующее время проведения торгов ОФЗ-ПД в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» 28 сентября 2016 года:
- период сбора заявок на покупку: 12:50 - 14:10 мск;
 - снятие заявок, не соответствующих порядку обмена, изложенному в пп. 7, 8 настоящего Уведомления и/или опубликованному на сайте Министерства финансов

РФ: 14:10 – 14:50 мск;

- период удовлетворения заявок: 16:20 - 16:50 мск.

10. В дату проведения обмена во всех Режимх торгов не допускается подача заявок с ценой, рассчитанной на основании показателя доходности по следующим ОФЗ-АД и ОФЗ-ПД:

Государственный регистрационный номер выпуска
46005RMFS
46014RMFS
46018RMFS
46019RMFS
46020RMFS
46021RMFS
46022RMFS
48001RMFS
26217RMFS
26218RMFS
26219RMFS

11. Дополнительные условия:

11.1. ОФЗ-АД, предъявляемые к Обмену владельцем, обмениваются на ОФЗ-ПД в следующем соотношении стоимостей передаваемых выпусков ОФЗ-ПД: № 26217RMFS – 33%, № 26218RMFS – 34%, № 26219RMFS – 33%.

11.2. После заключения сделок с 16:50 до 17:30 участники торгов должны рассчитаться по заключенным сделкам (исполнить обязательства по сделкам) путем подачи специальных отчетов на исполнение. Участник торгов подает специальный отчет на исполнение заключенных сделок размещения и выкупа, в котором указывает сделки, совершенные с использованием одного и того же торгового-клирингового счета и кода клиента. В момент выставления отчета проверяется обеспечение (ОФЗ-АД - в полном объеме и денежные средства в размере разницы между суммой покупки ОФЗ-ПД и суммой продажи ОФЗ-АД).

11.3. Банк России с 18:00 до 18:30 подает встречные отчеты на исполнение.

С уважением,

Директор Департамента
фондового рынка
ЗАО «ФБ ММВБ»



Г.Г. Шевеленков