



**МОСКОВСКАЯ
БИРЖА**

Руководителю фондового подразделения
Участника торгов ЗАО «ФБ ММВБ»

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

24.08.2015 № 44-06/254
На № от

На основании информационного сообщения Министерства финансов РФ от 21 августа 2015 года и в соответствии с Правилами проведения торгов по ценным бумагам в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ», утвержденными Советом директоров ЗАО «ФБ ММВБ» 25 июня 2015 г. (Протокол № 22), установлены следующие условия, время, срок и порядок проведения обмена облигаций федеральных займов с амортизацией долга с государственными регистрационными номерами 46010RMFS, 46011RMFS и 46012RMFS (далее отдельно и в совокупности – ОФЗ-АД) на облигации федеральных займов с постоянным купонным доходом с государственными регистрационными номерами 25082RMFS, 26212 RMFS, 26214RMFS, 26215RMFS и 26216RMFS (далее отдельно и в совокупности – ОФЗ-ПД):

1. ОФЗ-АД могут быть предъявлены к Обмену их владельцами, являющимися таковыми по состоянию на 19:00 по московскому времени 21 августа 2015 г. ОФЗ-АД могут быть предъявлены к обмену также владельцами, передавшими указанные ценные бумаги по первой части сделок РЕПО, заключенных с участниками торгов или Банком России 21 августа 2015 года или ранее, при условии исполнения второй части сделки РЕПО в период с 22 августа 2015 года по 26 августа 2015 года.

2. Продажа ОФЗ-ПД будет осуществляться в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» путем заключения сделок на основании адресных заявок по фиксированной цене.

2.1. Заявки на покупку ОФЗ-ПД направляются 27 августа 2015 года в адрес Банка России, действующего за счет и по поручению Министерства финансов РФ (идентификатор в системе торгов MZ0000200000, краткое наименование – ЦБ РФ).

2.2. Заявки на покупку ОФЗ-ПД направляются со следующими обязательными реквизитами:

- количество ценных бумаг в штуках, рассчитанное в соответствии с порядком обмена ОФЗ-АД на ОФЗ-ПД, опубликованного на сайте Министерства финансов РФ;
- код расчетов В0;
- другие параметры в соответствии с Правилами торгов.

2.3. Установлены следующие цены продажи ОФЗ-ПД:

Государственный регистрационный номер выпуска ОФЗ-ПД	Цена ОФЗ-ПД без учета НКД, % от номинальной стоимости**	НКД на дату обмена, руб.
25082RMFS	97,4242	17,43
26212RMFS	73,4027	4,25
26214RMFS	82,6288	14,90
26215RMFS	78,2333	0,19
26216RMFS	86,4994	18,17

2.4. Определено следующее время проведения торгов ОФЗ-ПД в Режиме торгов «Размещение: Адресные заявки» 27 августа 2015 года:

- период сбора адресных заявок на покупку ОФЗ-ПД: 10:00 - 13:00 по московскому времени;
- период удовлетворения заявок: 14:00 – 17:30.

2.5. Неудовлетворенные и/или удовлетворенные не в полном объеме адресные заявки на покупку ОФЗ-ПД отклоняются Банком России 27 августа 2015 года в период с 14:00 до 17:30.

3. Выкуп ОФЗ-АД будет осуществляться в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» путем заключения сделок на основании адресных заявок по фиксированной цене.

3.1. Заявки на продажу ОФЗ-АД направляются 27 августа 2015 года в адрес Банка России, действующего за счет и по поручению Министерства финансов РФ (идентификатор в системе торгов MZ0000200000, краткое наименование – ЦБ РФ).

3.2. Заявки на продажу ОФЗ-АД направляются со следующими обязательными реквизитами:

- количество ценных бумаг в штуках, рассчитанное в соответствии с порядком обмена ОФЗ-АД на ОФЗ-ПД, опубликованного на сайте Министерства финансов РФ;
- код расчетов В0;
- другие параметры в соответствии с Правилами торгов.

3.3. Установлены следующие цены выкупа ОФЗ-АД:

Государственный регистрационный номер выпуска ОФЗ-АД	Цена ОФЗ-АД без учета НКД, % от номинальной стоимости*	НКД на дату обмена, руб.
46010RMFS	91,4696	23,29
46011RMFS	92,8688	98,09
46012RMFS	68,1878	43,14

3.4. Определено следующее время проведения торгов ОФЗ-АД в Режиме торгов «Выкуп: Адресные заявки» 27 августа 2015 года:

- период сбора адресных заявок на продажу ОФЗ-АД: 10:00 - 13:00 по московскому времени;
- период удовлетворения заявок: 14:00 – 17:30.

3.5. Неудовлетворенные и/или удовлетворенные не в полном объеме адресные заявки на продажу ОФЗ-АД отклоняются Банком России 27 августа 2015 года в период с 14:00 до 17:30.

4. Количество заявок на покупку и заявок на продажу каждого из выпусков ОФЗ, участвующих в обмене, в интересах одного клиента участника торгов или одного участника торгов ограничивается следующим образом:

- для юридических лиц - не более одной заявки по каждому выпуску ОФЗ-АД/ОФЗ-ПД;
- для физических лиц - не более двух заявок по каждому выпуску ОФЗ-АД и не более одной заявки по каждому выпуску ОФЗ-ПД.

5. В период удовлетворения заявок с 14:00 до 17:30 Банк России удовлетворяет заявки, направленные участниками торгов в его адрес в рамках обмена. В момент заключения сделок обеспечение у инвестора не проверяется.

6. После заключения сделок с 17:30 до 18:20 участники торгов должны рассчитаться по заключенным сделкам (исполнить обязательства по сделкам) путем подачи специальных отчетов на исполнение. Участник торгов подает специальный отчет на исполнение по заключенным сделкам размещения и выкупа, в котором указывает сделки, совершенные с использованием одного и того же торгового-клирингового счета, которые необходимо неттировать. При необходимости неттирования требований и обязательств по заключенным сделкам на уровне каждого конечного владельца (клиента) - специальный отчет может подаваться на исполнение обязательств каждого конечного владельца (клиента), учитываемых по одному и тому же ТКС. В момент выставления отчета проверяется обеспечение (ОФЗ-АД в полном объеме и денежные средства в размере разницы между суммой покупки и суммой продажи).

7. Банк России с 18:20 до 19:00 отправляет встречные отчеты на исполнение.

С уважением,

Директор Департамента
Фондового рынка ЗАО «ФБ ММВБ»



Г.Г. Шевеленков