



**НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ ДЕПОЗИТАРИЙ**

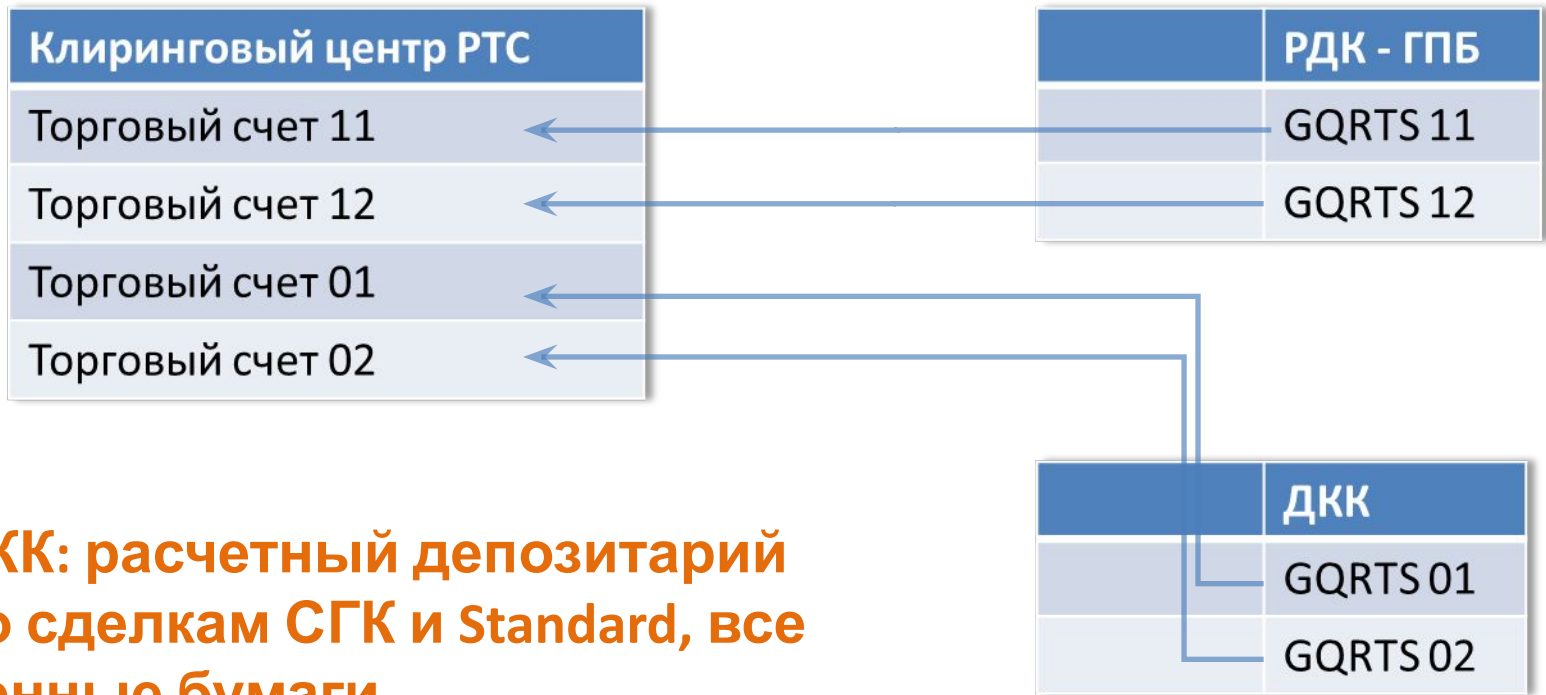
ГРУППА ММВБ – РТС

НРД – расчетный депозитарий КЦ РТС

Стрельникова Елена
Заместитель директора Департамента
нормативно-технологического
обеспечения – главный технолог

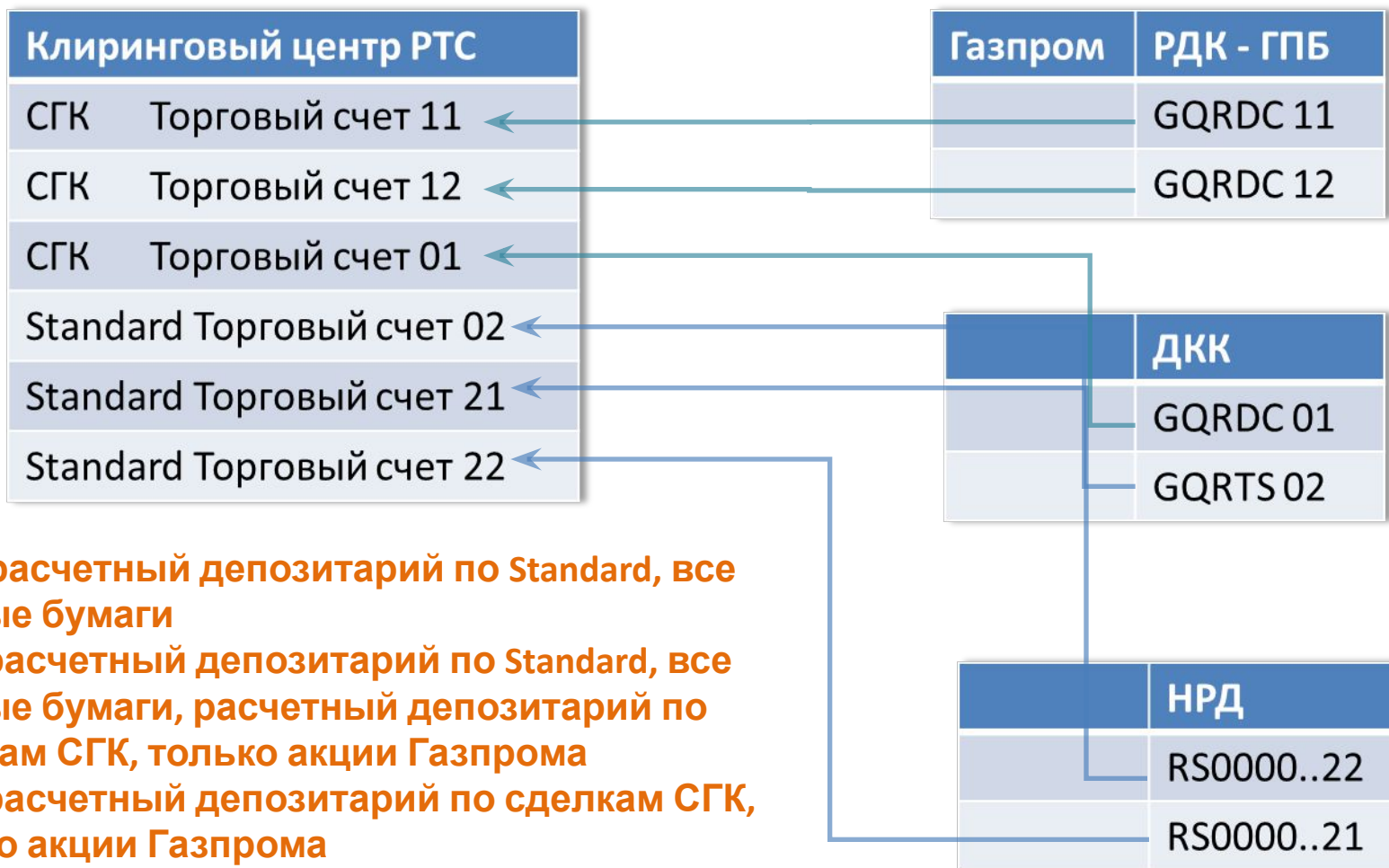
10 апреля 2012

Существующая конфигурация торговых разделов для КЦ РТС (без учета FORTS)



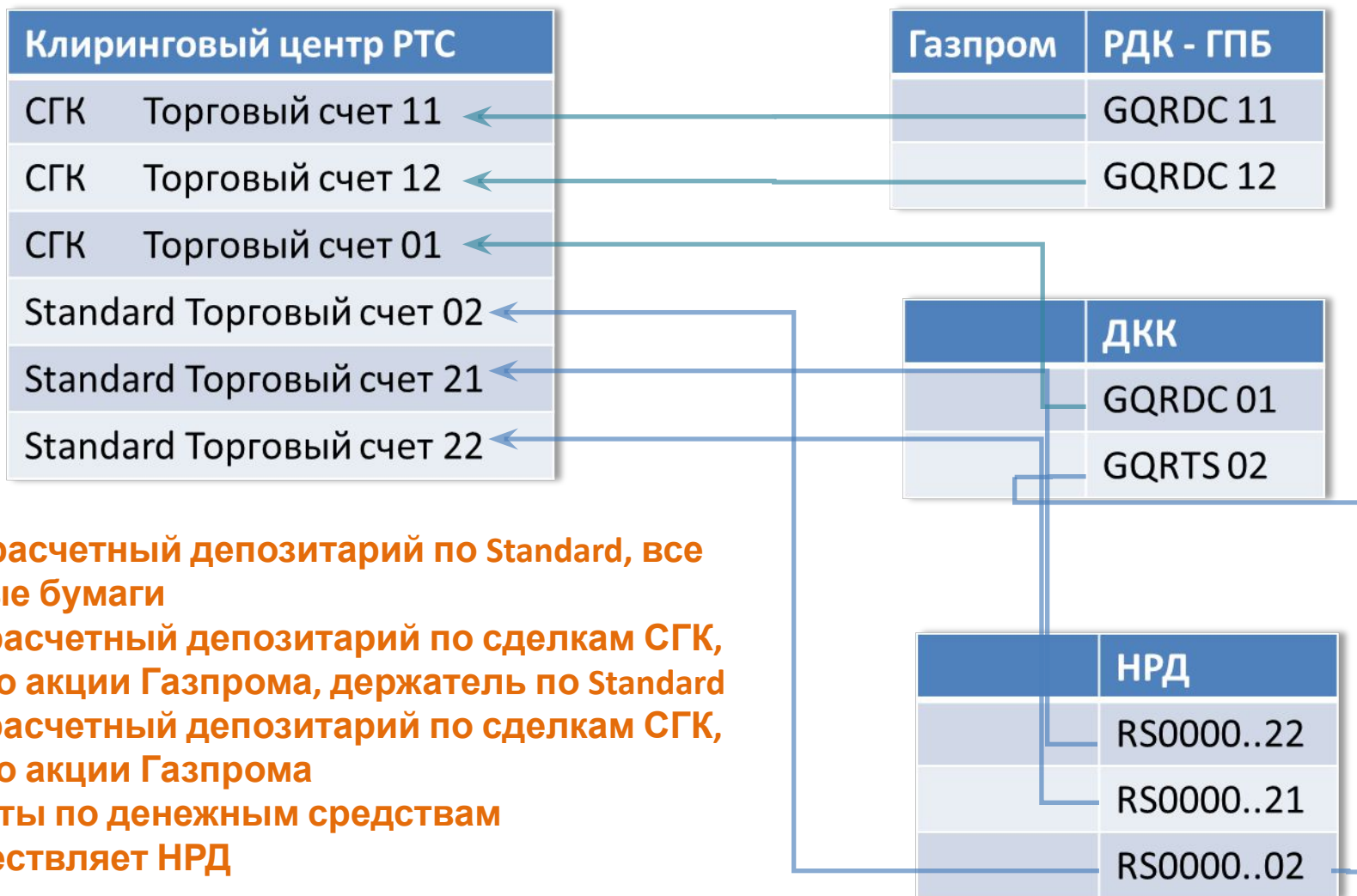
1. **ДКК: расчетный депозитарий по сделкам СГК и Standard, все ценные бумаги**
2. **РДК: расчетный депозитарий по сделкам СГК, только акции Газпрома**

Конфигурация торговых разделов для КЦ РТС (без учета FORTS) на первом этапе



1. **НРД: расчетный депозитарий по Standard, все ценные бумаги**
2. **ДКК: расчетный депозитарий по Standard, все ценные бумаги, расчетный депозитарий по сделкам СГК, только акции Газпрома**
3. **РДК: расчетный депозитарий по сделкам СГК, только акции Газпрома**
4. **Расчеты по денежным средствам осуществляет НП РП РТС**

Конфигурация торговых разделов для КЦ РТС (без учета FORTS) на втором этапе



1. **НРД: расчетный депозитарий по Standard, все ценные бумаги**
2. **ДКК: расчетный депозитарий по сделкам СГК, только акции Газпрома, держатель по Standard**
3. **РДК: расчетный депозитарий по сделкам СГК, только акции Газпрома**
4. **Расчеты по денежным средствам осуществляет НРД**

Основные особенности взаимодействия КЦ РТС, ДКК и НРД на секциях FORTS и Standard по ценным бумагам

1. СГК выносятся в отдельный клиринговый пул КЦ РТС, расчеты осуществляются только по акциям Газпрома, создается отдельный новый тип торгового раздела в ДКК

2. НРД и ДКК становятся расчетными депозитариями по Standard и FORTS, обязательства могут возникать как внутри каждого расчетного депозитария, так и между ними. В ДКК сохраняются все торговые разделы GQRTS и FORTS

3. В течение нескольких месяцев действуют два расчетных депозитария, после чего торговые разделы в ДКК закрываются, НРД становится единственным расчетным депозитарием по ценным бумагам. В ДКК появляется возможность открывать «держательские» разделы для Standard и FORTS , аналогично разделам типа «MICEX»

Основные отличия расчетов по торговым разделам РТС (Standard, FORTS) от расчетов по торговым разделам ММВБ (основная секция)

1. Код типа разделов – «RS» Standard и «RF» для FORTS. В коде раздела не указывается код участника клиринга КЦ РТС. Связь раздела и кода участника осуществляет КЦ РТС по заявлению депонента НРД. Формы заявлений приведены на сайте КЦ РТС
2. Возможность онлайн – открытия / разблокировки и онлайн - закрытия / блокировки торговых разделов.
3. Торговые сессии продолжаются после вечерней клиринговой сессии. Ценные бумаги на торговых разделах находятся под управлением КЦ РТС весь операционный день.
4. Для заключения сделки Standard не требуется 100% обеспечение по ценным бумагам на разделах типа «RS». Срок расчетов – до T+4
5. Для заключения сделок FORTS обеспечение по ценным бумагам на разделах типа «RF» влияет на лимиты и размер денежного обеспечения.

Торговые разделы для осуществления расчетов по ценным бумагам по результатам клиринга КЦ РТС

1. Раздел «Блокировано для клиринга. RTS STANDARD» предназначен для учета ценных бумаг, которые подлежат списанию/зачислению при проведении расчетов по ценным бумагам по результатам клиринга в соответствии с Правилами клиринга КЦ РТС

Код типа раздела «»Блокировано для клиринга. RTS STANDARD» = RS (1-2 символы) + свободные (3-15 символы). В коде раздела не указывается код участника клиринга КЦ РТС.

3. Раздел «Блокировано для клиринга. FORTS» предназначен для учета ценных бумаг, внесенных в качестве средств гарантийного обеспечения в соответствии с Правилами клиринга КЦ РТС

4. Код типа раздела «Блокировано для клиринга. FORTS» = RF (1-2 символы) + свободные (3-15 символы). В коде раздела не указывается код участника клиринга КЦ РТС.

5. Разделы открываются по поручению Депонента AF090 в ходе исполнения операции «Открытие раздела» (код операции - 90). На счете депо может быть открыто множество разделов указанного типа.

В Условном поручении депо по форме

MF014

в обязательном порядке должны быть

указаны:

1. Номер счета депо. Условное поручение депо действует в отношении всех торговых разделов, открытых или открываемых в будущем для расчетов по клирингу, осуществляемому КЦ РТС на указанном в Условном поручении счете депо.

2. В одном Условном поручении депо допускается указание **только одного** счета депо.

3. **Полное наименование клиринговой организации** - Закрытое акционерное общество «Клиринговый центр РТС» и сектор рынка STANDARD или FORTS

4. В поле «Инициатор поручения» **депозитарный код**, который присвоен депоненту при открытии счета депо, номер которого указан в Условном поручении депо.

5. Подписано лицом, имеющим полномочия подписывать от имени депонента поручения депо на бумажном носителе в соответствии с учредительными документами, либо на основании доверенности. Предоставляется на бумажном носителе

Изменение квитанки встречных поручений при переводах ценных бумаг с подтверждением на условиях свободной поставки (коды операций 16 и 16/1). 3 варианта

1 вариант. Квитовка по основанию. В основном поручения выпадают на ручную квитанку. Не предоставляются дополнительные отчеты.

2 вариант. Квитовка по референсу и дате сделки. Автоматическая квитанка. Депонентам предоставляются дополнительные отчеты.

3 вариант. Квитовка по дате сделки. Квитовка автоматическая. Предоставляются дополнительные отчеты.

- 4. Дополнительно Депонентам направляются отчеты:
 - в случае выявления при квитанке расхождений – отчет с указанием полного перечня полей, по которым не прошла сверка;
 - инициатору поручения - Уведомление об отсутствии встречного поручения, если контрагентом не подано встречное поручение;
 - контрагенту - Уведомление о наличии встречного поручения с информацией о параметрах поручения к его счету депо.

Контакты

- **Многоканальный телефон НРД:**
+7 (495) 234-48-27
- **Отдел по работе с клиентами:**
Тел.: +7 (495) 956-27-90/91/92/93; (495) 956-09-40;
(495) 745-81-45; (495) 234-48-65
E-mail: dc@nsd.ru, marketing@nsd.ru
- **Отдел продвижения услуг и привлечения клиентов:**
Тел.: +7 (495) 234-99-60
- **Адрес:**
107066, г. Москва, ул. Спартаковская, 12
- **Веб-сайты:**
www.nsd.ru, www.isin.ru