



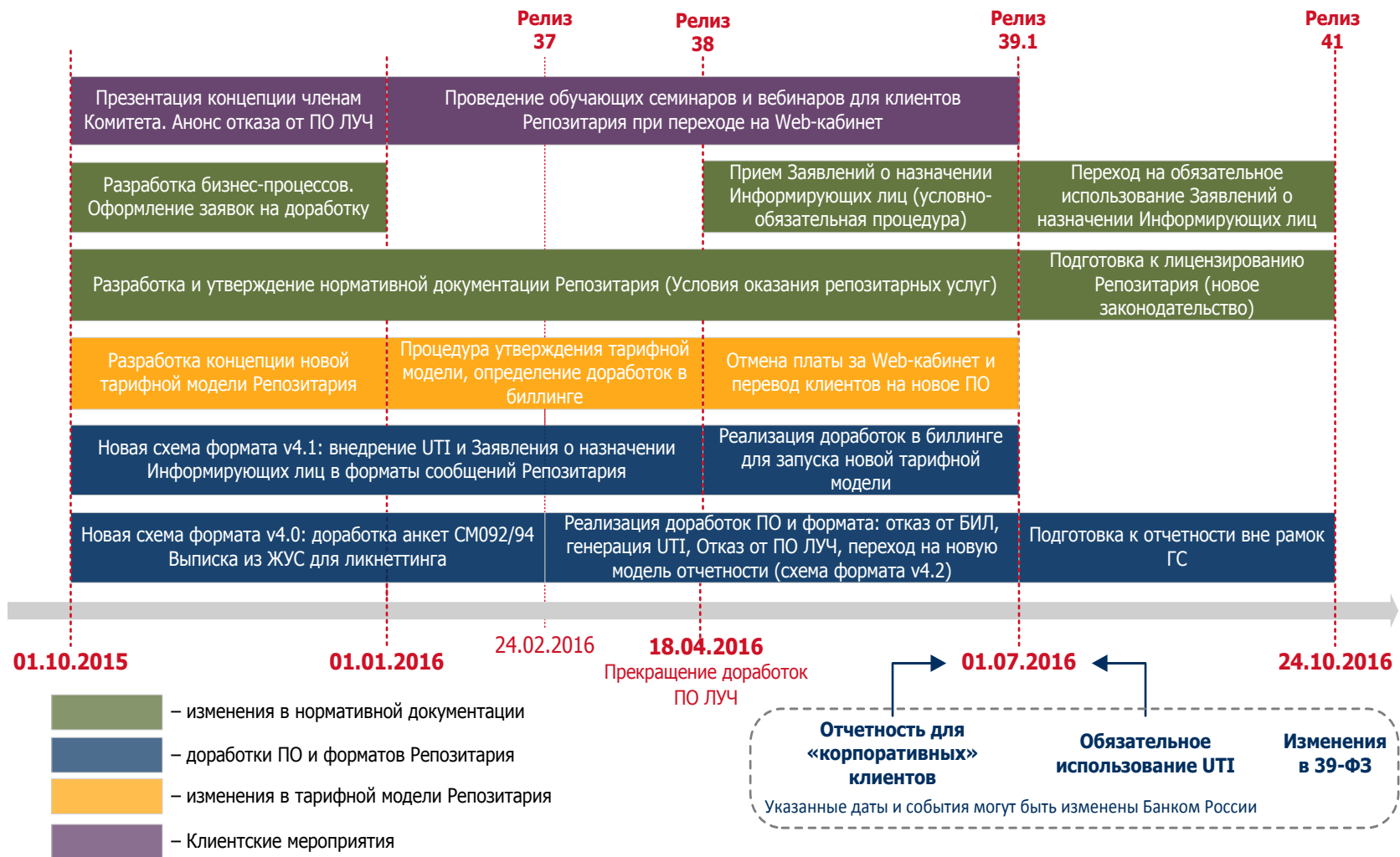
НАЦИОНАЛЬНЫЙ  
РАСЧЕТНЫЙ  
ДЕПОЗИТАРИЙ  
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА



Управление развития репозитарной деятельности

**ИЗМЕНЕНИЯ В РЕПОЗИТАРНЫХ СИСТЕМАХ, ВЫЗВАННЫЕ НОВЫМИ РЕЛИЗАМИ И ИЗМЕНЕНИЯМИ В НОРМАТИВНОЙ БАЗЕ В 2016 ГОДУ**

# РЕЛИЗЫ ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ РЕПОЗИТАРИЯ ЗАПЛАНИРОВАННЫЕ НА 2016 ГОД



## В РЕЛИЗАХ 2016 ГОДА

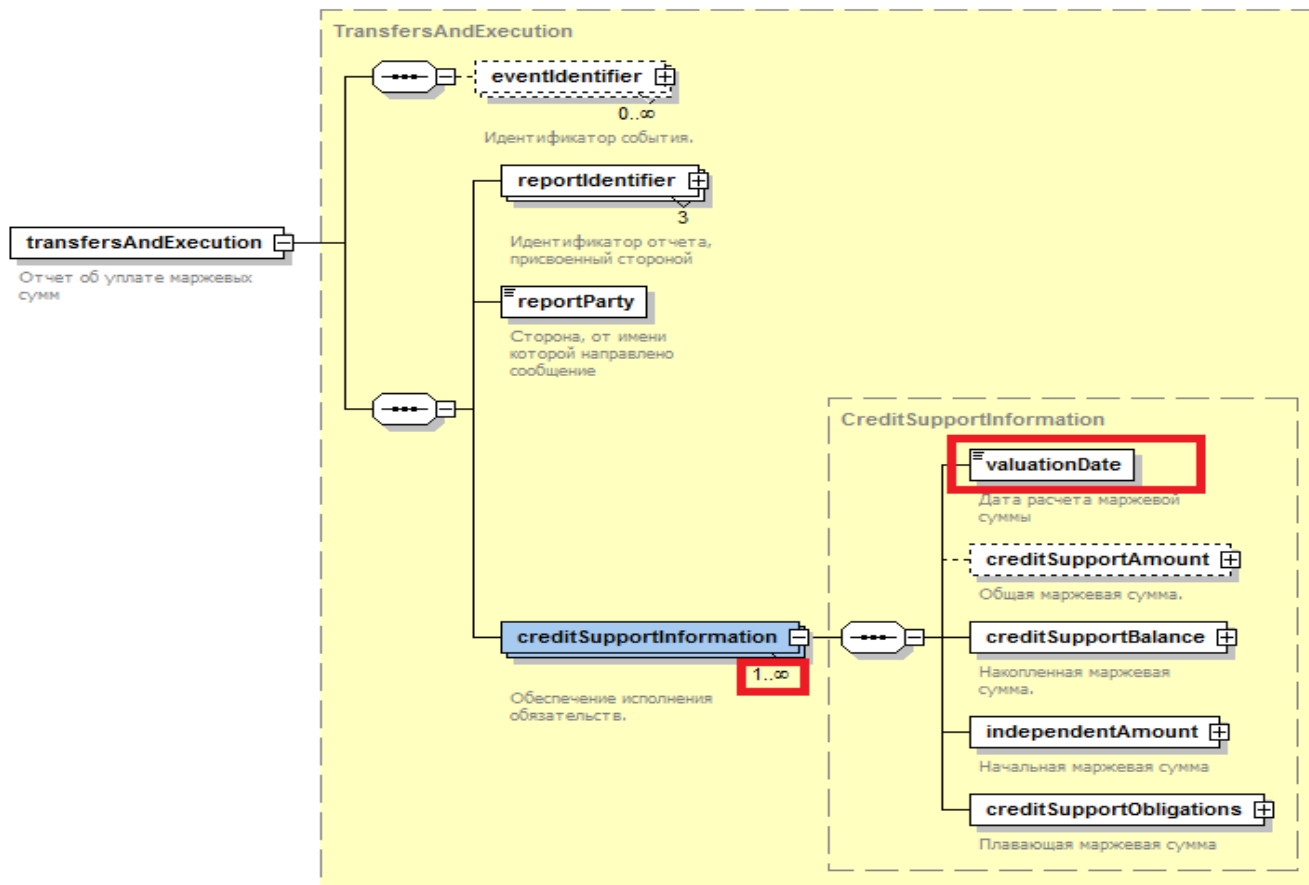
- **37 релиз (24 февраля)** – переход на формат **версии 4.0 (обязательная для установки)**: доработка анкет СМ092/СМ094 для возможности указания в одном отчете множества событий и односторонней отчетности.
- **38 релиз (18 апреля)** – переход на формат **версии 4.1 (опциональная для установки)**: разработка заявлений на назначение Информирующих лиц, анкеты СМ015 (CSA), указание кода UTI (опционально), доработка процедуры deregистрации анкет в случае ликвидации клиента – финальная доработка интерфейса ПО «ЛУЧ».
- **39 релиз (1 июля)** – переход на формат **версии 4.2 (обязательная для установки)**: переход на новый функционал отчетности Информирующих лиц (деактивация БИЛ), **обязательность указания UTI кода**, разработка отчетности по разовым сделкам вне генеральных соглашений, прекращение поддержки интерфейса ПО «ЛУЧ», поддержка автоимпорта/экспорта в ПО «ЛУЧ», переход на web-кабинет репозитория
- **41 релиз (24 октября)** – прекращение поддержки автоимпорта /экспорта в ПО «ЛУЧ», доработка корректировочной записи в реестре договоров, запрос выписки не клиентом репозитория, отказ ИЛа от своих полномочий.

37 РЕЛИЗ:

## ДОРАБОТКА АНКЕТЫ СМ092

Блок **creditSupportInformation** заполняется от **1 до ∞**

Дата расчета маржевой сумма перемещена в блок **creditSupportInformation**  
**reportParty** перемещен в основной блок



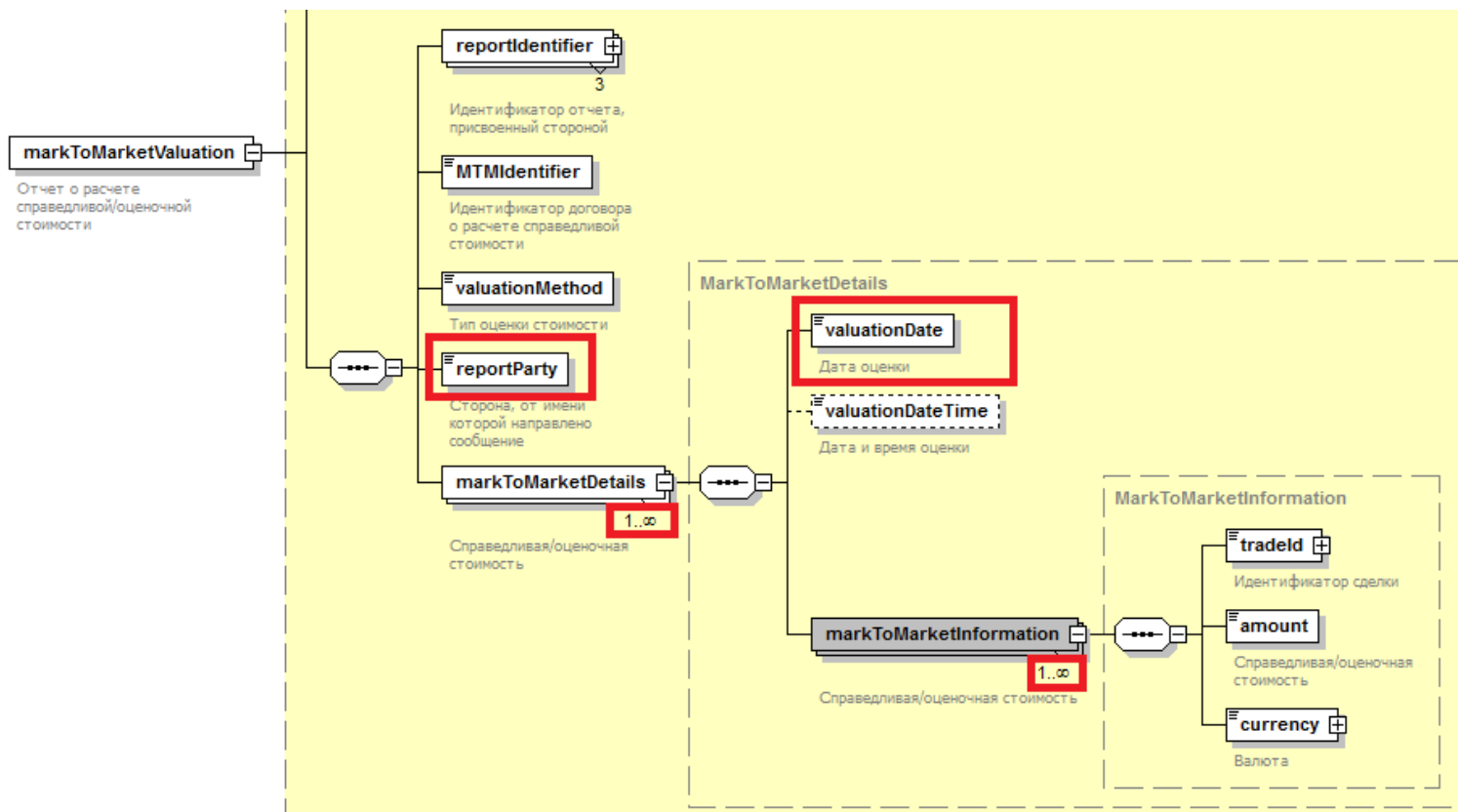
37 РЕЛИЗ:

## ДОРАБОТКА АНКЕТЫ СМ094

Блок **markToMarketDetails** заполняется от **1** до  $\infty$

Блок **markToMarketInformation** заполняется от **1** до  $\infty$

Дата оценки перемещена в блок **markToMarketDetails**  
**reportParty** перемещен в основной блок



37 РЕЛИЗ:

## ДОРАБОТКА АНКЕТ СМ092 / СМ094

### Проверка на дубликаты сообщений в одном отчетном периоде:

- При первичной регистрации анкет в полях **reportIdentifier** указываются любые значения (для **TradeRepository - NONREF**), значения для **valuationDate** могут повторяться в блоках одного сообщения
- Для СМ092 обязательное указание **linkId** (номер ГС в репозитории)
- При регистрации последующих анкет в том же отчетном периоде, осуществляется проверка: (1) на отличие номера отчета в **reportIdentifier** стороны **reportParty** и (2) указание **valuationDate**
- Проверка по указанию **asofDate** = дате последнего события в отчетном периоде или последний календарный день отчетного периода. **valuationDate** и **asofDate** может быть только в одном отчетном периоде.

### Регистрация анкет в реестре договоров репозитария:

- Анкеты от каждого участника направляются в репозиторий независимо друг от друга, процедура сверки анкет на уровне репозитария отсутствуют

### Схема формата 4.0:

- Будет выложена на сайте <http://repository.nsd.ru/> по итогам обсуждения доработок на Рабочей группе



38 РЕЛИЗ:

# РАСШИРЕНИЕ ФУНКЦИЙ ИЛ И ПРЕКРАЩЕНИЕ ФУНКЦИЙ БИЛ

## ОТСУТСТВИЕ ТРЕБОВАНИЯ РЕГУЛЯТОРА

При запуске репозитария в 2013 году была разработана юридическая конструкция, подразумевающая использование отчетного института Базового информирующего лица, не специфицированного в Указании 3253-У.

## СЛОЖНЫЙ ДОКУМЕНТООБОРОТ

В настоящий момент как клиентам, так и Репозитарию необходимо постоянно поддерживать в актуальном состоянии Доверенности, выданные на Базовых информирующих лиц.

## ГИБКОСТЬ

Репозитарий должен быть способен получать и обрабатывать данные по сделкам, поступающим от различных уполномоченных источников информации без привязки Информированных лиц к типам инструментов.



# РАСШИРЕНИЕ ФУНКЦИЙ ИЛ

## СЛИЯНИЕ ФУНКЦИЙ БАЗОВОГО И ИНФОРМИРУЮЩЕГО ЛИЦА

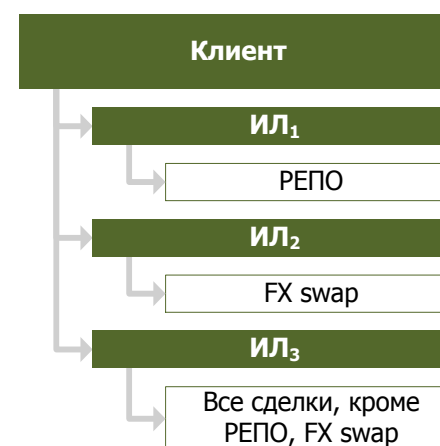
### Текущая реализация

Клиент выдает Доверенность **на каждое** Базовое информирующее лицо, каждое из которых назначает неограниченное количество Информированных лиц в рамках отдельного генерального соглашения.



### Планируемая реализация

Клиент подает Заявление о назначении Информированных лиц, в котором определяет перечень участников, уполномоченных отчитываться за клиента в привязке к типам сделок/площадкам.





38 РЕЛИЗ:

# РАСШИРЕНИЕ ФУНКЦИЙ ИЛ

## НАЗНАЧЕНИЕ ИНФОРМИРУЮЩИХ ЛИЦ (1) ПОДАЧА ЗАЯВЛЕНИЯ

Назначение Информированных лиц будет производиться с помощью соответствующих Заявлений, которые могут быть направлены в НРД как через ЭДО, так и на бумажном носителе.

Заявление содержит в себе набор полей, которые заполняются следующими параметрами:

	Клиент <sub>1</sub>			Клиент <sub>2</sub>		
	Код ИЛ	Торговая площадка	Тип сделки	Тип сделки	Торговая площадка	Код ИЛ
Двусторонняя отчетность, сверка	Код <sub>1</sub>	ОТС	ALL	Repo / FX swap	ОТС	Код <sub>4</sub>
Односторонняя отчетность	Код <sub>2</sub>	ALL	ALL	FX swap	СПФИ	Код <sub>2</sub>

«Пары» Информированных лиц сверяются между собой.

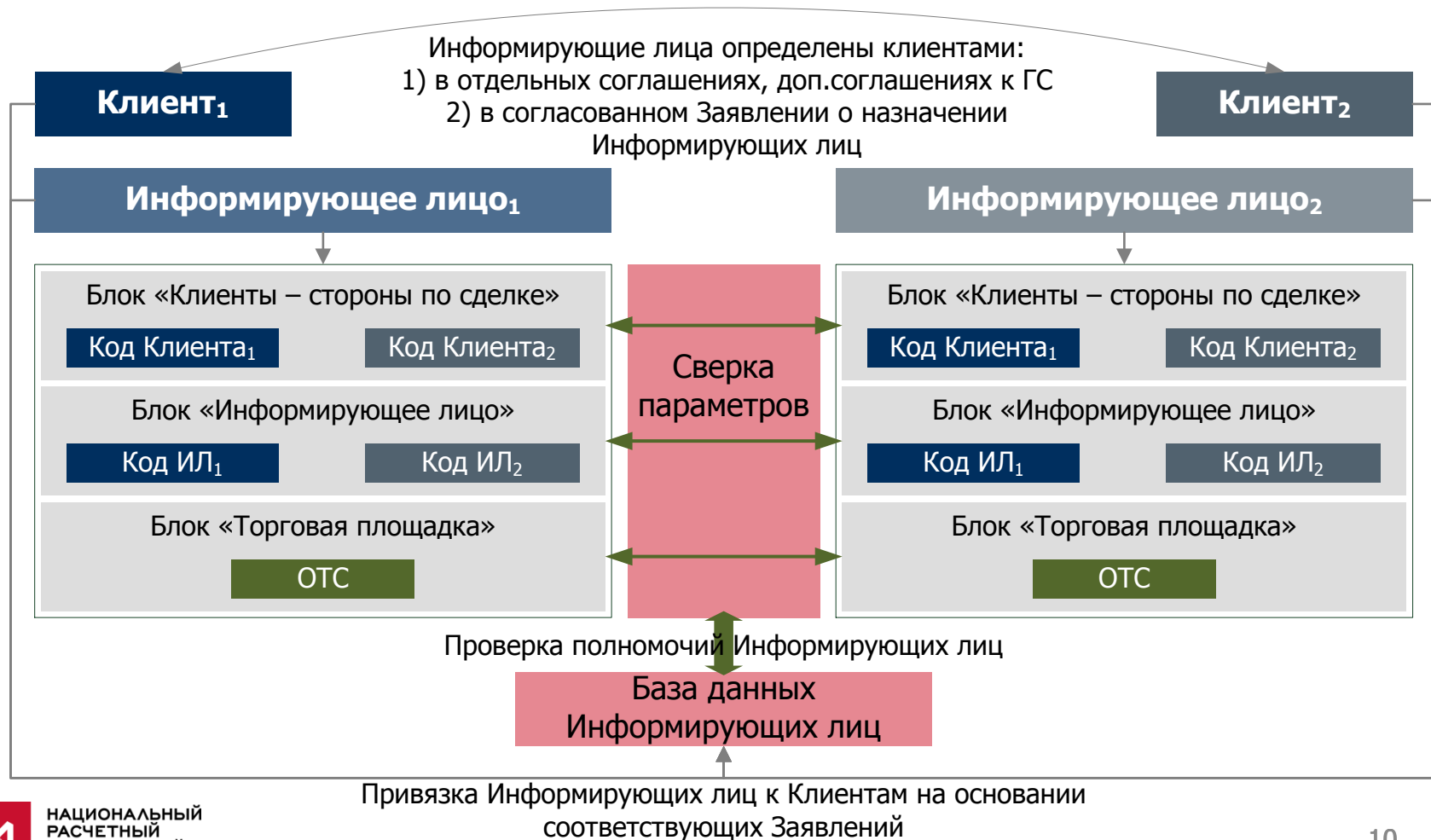
Каждый клиент назначает столько Информированных лиц, сколько ему необходимо для отчетности.

38 РЕЛИЗ:

# РАСШИРЕНИЕ ФУНКЦИЙ ИЛ

НАЗНАЧЕНИЕ ИНФОРМИРУЮЩИХ ЛИЦ

## (2) КОНТРОЛЬ ЗА ИНФОРМИРУЮЩИМИ ЛИЦАМИ



38 РЕЛИЗ:

# РАСШИРЕНИЕ ФУНКЦИЙ ИЛ

НАЗНАЧЕНИЕ ИНФОРМИРУЮЩИХ ЛИЦ

## (3) ЗАЯВЛЕНИЕ НА ИНФОРМИРУЮЩЕЕ ЛИЦО

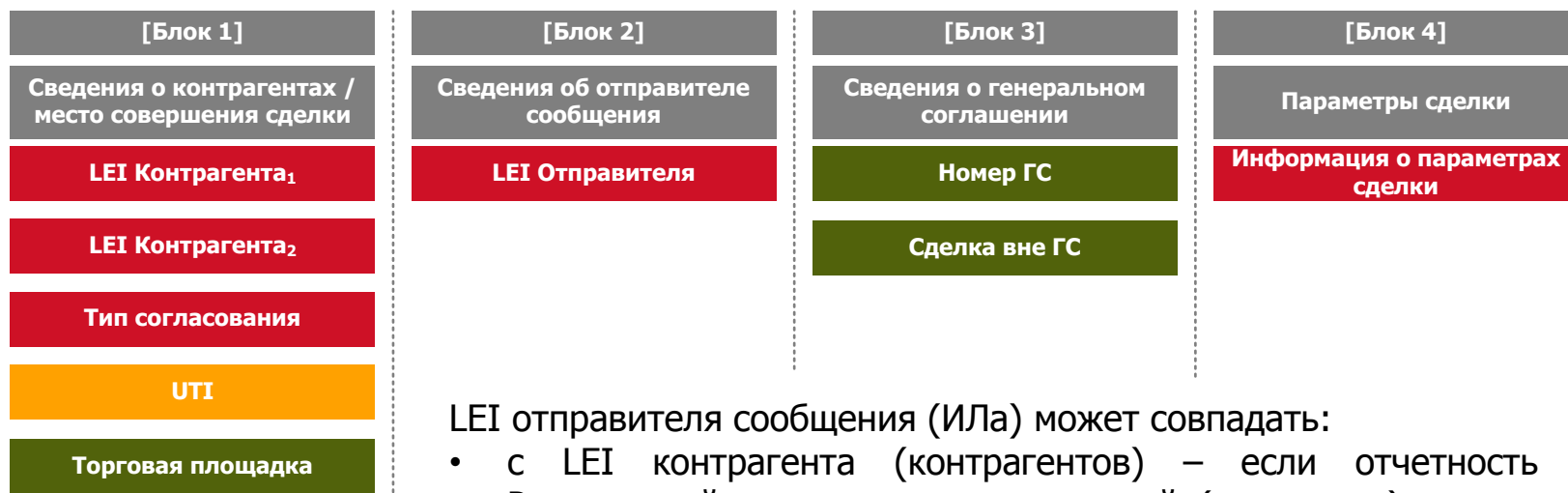
Название в xsd-схеме	Наименование поля	Признаки
1) Party	Клиент репозитария	обязательно
2) agreementReportingParty	Информирующее лицо	обязательная группа (повторяющаяся)
· reportingParty	Информирующее лицо/Reporting party	обязательно
· link ID	Код идентификации генерального соглашения	опционально, м.б. указано несколько
· CounterParty	Контрагент	опционально, м.б. указано несколько
· ReportingType	Тип отчетности информирующего лица	обязательно, м.б. указано несколько
–DocumentType	Тип отчетности информирующего лица	обязательно
–historicalStatementRequest	Запрос на предоставление исторической выписки по договорам, зарегистрированным в интересах клиента	обязательно
–TransfersAndExecution	Отчет об уплате маржевых сумм	обязательно
–MarkToMarketValuation	Отчет о расчете справедливой (оценочной) стоимости	обязательно
· executionVenueType	Место заключения сделки/ Execution venue type	опционально, м.б. указано несколько

39 РЕЛИЗ:

# ПРЕДЛАГАЕМАЯ МОДЕЛЬ ФОРМАТА СООБЩЕНИЙ

В связи с тем что:

- Генеральное соглашение перестает быть обязательным условием для регистрации сделки после вступления в силу изменений 39-ФЗ;
- В будущем может появиться полноценный институт информирующих лиц (например, таким лицом станет НКЦ в качестве центрального контрагента или Reuters / Bloomberg), предлагается построить сообщения о сделках в виде 4х блоков:



## Легенда

Обязательное поле

Поле заполняется при наличии информации

Поле станет обязательным ориентировочно в 2016

LEI отправителя сообщения (ИЛа) может совпадать:

- с LEI контрагента (контрагентов) – если отчетность в Репозиторий осуществляется стороной (сторонами) по сделке самостоятельно;
- с LEI торговой площадки – если торговая площадка и контрагенты согласились назначить ее информирующим лицом по своим сделкам.

Тип согласования анкет – по умолчанию комбинированный (может быть изменен на встречный)



39 РЕЛИЗ:

## **ПРЕКРАЩЕНИЕ ПОДДЕРЖКИ ПО «ЛУЧ»**

### **ТРУДОЕМКОСТЬ ДОРАБОТОК В ПО «ЛУЧ»**

Так как функционал ПО «ЛУЧ» изначально предназначался для депозитарной деятельности, любые доработки в репозитарной составляющей требуют дополнительных затрат времени и ресурсов.

### **СЛОЖНОСТЬ РАЗВИТИЯ НОВЫХ СЕРВИСОВ**

Например, по генерации уникального кода сделки (UTI).

### **РАБОТА ЧЕРЕЗ ЭЛЕКТРОННУЮ ПОЧТУ**

Передача файлов через электронную почту накладывает ограничения на размер файлов и может повлиять на своевременную сверку сообщений.

### **НЕОБХОДИМОСТЬ ЗАГРУЗКИ И УСТАНОВКИ ОБНОВЛЕНИЙ**

Для корректной работы ПО «ЛУЧ» необходима ежедневная загрузка справочников и установка обновлений, для чего требуются дополнительные действия на стороне клиента.



# ПРЕКРАЩЕНИЕ ПОДДЕРЖКИ ПО «ЛУЧ»

## ОПТИМИЗАЦИЯ ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ РЕПОЗИТАРИЯ

### Текущая реализация

В настоящий момент ПО Репозитария условно можно разделить на 2 компонента:

- 1) **ПО «ЛУЧ»** - комплексный продукт, обновления которого производятся **только** в рамках релиза программного обеспечения.
- 2) **Веб-кабинет и Файловый шлюз ЭДО** – специализированное ПО, не зависящее от релизной политики НРД.

Наличие двух принципиально разных клиентских решений требует принципиально разных подходов к их поддержке и дополнительных ресурсов.

### Планируемая реализация

- **Прекращение поддержки ПО «ЛУЧ»**
- **Бесплатный доступ в Веб-кабинет**
- **Бесплатный доступ к Файловому шлюзу ЭДО**

позволят НРД:

- Направить дополнительные ресурсы на реализацию запросов клиентов.
- Оперативно реагировать на проблемы, выявленные, например, в ходе тестирования.
- Кастомизировать ПО под потребности конкретного клиента.



# ПЛАН ПЕРЕХОДА НА WEB-КАБИНЕТ РЕПОЗИТАРИЯ

Бесплатный доступ к тестовой версии Web-кабинета (и тестовому контуру) Репозитария

Проведение обучающих семинаров и вебинаров в рамках перехода на Web-кабинет и Файловый шлюз

Поддержка ПО «ЛУЧ» осуществляется в **полном объеме** (включая исправление ошибок и устранение инцидентов)

Осуществление поддержки ПО «ЛУЧ» **только** в режиме **автоматического импорта / экспорта** сообщений

Разработка **версии 4.1** формата сообщений в ПО «ЛУЧ» и Web-кабинете

Разработка формата сообщений **версии 4.2** **только** в Web-кабинете

01.04.2016

01.07.2016

24.10.2016

Отмена платы за Web-Кабинет и Файловый шлюз ЭДО

Отключение экранных форм (визуализации) в ПО «ЛУЧ»

Отключение функции автоматического импорта / экспорта в ПО «ЛУЧ»



**СПАСИБО  
ЗА ВНИМАНИЕ!**



**НАЦИОНАЛЬНЫЙ  
РАСЧЕТНЫЙ  
ДЕПОЗИТАРИЙ**  
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА



# ПРАВОВАЯ ОГОВОРКА

- Настоящая презентация была подготовлена и выпущена НКО ЗАО НРД (далее – «Компания»). Если нет какой-либо оговорки об ином, то Компания считается источником всей информации, изложенной в настоящем документе. Данная информация предоставляется по состоянию на дату настоящего документа и может быть изменена без какого-либо уведомления.
- Данный документ не является, не формирует и не должен рассматриваться в качестве предложения или же приглашения для продажи или участия в подписке, или же, как побуждение к приобретению или же к подписке на какие-либо ценные бумаги, а также этот документ или его часть или же факт его распространения не являются основанием и на них нельзя полагаться в связи с каким-либо предложением, договором, обязательством или же инвестиционным решением, связанными с ним, равно как и он не является рекомендацией относительно ценных бумаг компании.
- Изложенная в данном документе информация не являлась предметом независимой проверки. В нем также не содержится каких-либо заверений или гарантий, сформулированных или подразумеваемых и никто не должен полагаться на достоверность, точность и полноту информации или мнения, изложенного здесь. Никто из Компании или каких-либо ее дочерних обществ или аффилированных лиц или их директоров, сотрудников или работников, консультантов или их представителей не принимает какой-либо ответственности (независимо от того, возникла ли она в результате халатности или чего-то другого), прямо или косвенно связанной с использованием этого документа или иным образом возникшей из него.
- Данная презентация содержит прогнозные заявления. Все включенные в настоящую презентацию заявления, за исключением заявлений об исторических фактах, включая, но, не ограничиваясь, заявлениями, относящимися к нашему финансовому положению, бизнес-стратегии, планам менеджмента и целям по будущим операциям являются прогнозными заявлениями. Эти прогнозные заявления включают в себя известные и неизвестные риски, факторы неопределенности и иные факторы, которые могут стать причиной того, что наши нынешние показатели, достижения, свершения или же производственные показатели, будут существенно отличаться от тех, которые сформулированы или подразумеваются под этими прогнозными заявлениями. Данные прогнозные заявления основаны на многочисленных презумпциях относительно нашей нынешней и будущей бизнес-стратегии и среды, в которой мы ожидаем осуществлять свою деятельность в будущем. Важнейшими факторами, которые могут повлиять на наши нынешние показатели, достижения, свершения или же производственные показатели, которые могут существенно отличаться от тех, которые сформулированы или подразумеваются этими прогнозными заявлениями являются, помимо иных факторов, следующие:
  - восприятие рыночных услуг, предоставляемых Компанией и ее дочерними обществами;
  - волатильность (а) Российской экономики и рынка ценных бумаг и (b) секторов с высоким уровнем конкуренции, в которых Компания и ее дочерние общества осуществляют свою деятельность;
  - изменения в (а) отечественном и международном законодательстве и налоговом регулировании и (b) государственных программах, относящихся к финансовым рынкам и рынкам ценных бумаг;
  - ростом уровня конкуренции со стороны новых игроков на рынке России;
  - способность успевать за быстрыми изменениями в научно-технической среде, включая способность использовать расширенные функциональные возможности, которые популярны среди клиентов Компании и ее дочерних обществ;
  - способность сохранять преемственность процесса внедрения новых конкурентных продуктов и услуг, равно как и поддержка конкурентоспособности;
  - способность привлекать новых клиентов на отечественный рынок и в зарубежных юрисдикциях;
  - способность увеличивать предложение продукции в зарубежных юрисдикциях.
- Прогнозные заявления делаются только на дату настоящей презентации, и мы точно отрицаем наличие любых обязательств по обновлению или пересмотру прогнозных заявлений в настоящей презентации в связи с изменениями наших ожиданий, или перемен в условиях или обстоятельствах, на которых основаны эти прогнозные заявления.

