

Протокол заседания рабочей группы по технологическим вопросам при Комитете по репозитарной деятельности при Правлении НКО ЗАО НРД

Тема: Очередное заседание рабочей группы по технологическим вопросам при Комитете по репозитарной деятельности при Правлении НКО ЗАО НРД

Дата проведения заседания: 15 августа 2014 г.

Время: 10:00 – 13:00 (ауд. 1.7)

1	Проект указания Банка России «О внесении изменений в Указание Банка России от 30 апреля 2014 года № 3253-У»
	Рекомендации/решение рабочей группы:

- НРД рекомендуется уточнить у Банка России, планируется ли анонсируемое ранее сокращение сроков представления информации в репозитарий (в текущей редакции – «не позднее трех рабочих дней с даты заключения, прекращения или исполнения» договора). Если да – в какой редакции Указания это будет прописано (необходимо заранее разработать технологию для отчетности в режиме T+1).

Участникам рабочей группы предлагается направить в НРД описание проблем, связанных с сокращением сроков (возможные проблемы: различные часовые пояса с контрагентом, недостаточное время для согласования параметров анкеты с контрагентом, в том числе справедливой стоимости).

В случае принятия решения о сокращении сроков представления информации в репозитарий до T+1 рекомендуется оставить 3 рабочих дня для согласования анкет и внесения изменений в случае отказа репозитария во внесении записи в реестр договоров.¹

Комментарий. НРД передаст данный вопрос Банку России.

2	Особенности назначения информирующих лиц в случае, если одной из сторон является лицо, не обязанное представлять информацию в репозитарий.
	Рекомендации/решение рабочей группы:

- Презентация направлена участникам рабочей группы (принять к сведению).
- Необходимо дать разъяснение для случая, когда клиент репозитария, не обязанный предоставлять отчетность, не направил в НРД «Уведомление об отказе от предоставления сведений в Репозитарий», однако перестал участвовать в репортинге (либо продолжает отчитываться по генеральным соглашениям, зарегистрированным ранее, но не участвует в регистрации новых генеральных соглашений).

Участникам рабочей группы предлагается направить в НРД список таких «проблемных» контрагентов, для того чтобы НРД провел с ними разъяснительную работу.

Комментарий. На официальном сайте НРД размещена [новость](#) (в т. ч. на [английском языке](#)) «О порядке отказа от предоставления сведений в Репозитарий и расторжения Соглашений об условиях оказания репозитарных услуг для иностранных лиц».

На данный момент НРД получил информацию о следующих клиентах-нерезидентах, которые перестали участвовать в репортинге, не направив «Уведомление об отказе от предоставления сведений в Репозитарий»: Commerzbank AG, Credit Agricole Corporate and Investment Bank.

¹ В соответствии с проектом новой редакции Указания Банка России № 3253-У:

«26. В случае отказа репозитария во внесении записи в реестр договоров информирующее лицо вправе внести изменения в сообщение и представить репозитариям новое сообщение о генеральном соглашении или договоре не позднее трех рабочих дней с даты получения отказа репозитария».

«28. Информированное лицо вправе предоставить репозитариям возражения по внесенным в реестр договоров сведениям не позднее трех рабочих дней, следующих за днем получения сообщения репозитария о внесении в реестр договоров соответствующих сведений».

- НРД предлагается рассмотреть возможность изменения действующей технологии: вместо «Уведомления об отказе от предоставления сведений в Репозиторий» требовать от клиентов, не обязанных представлять информацию в репозиторий, «Уведомление о согласии на предоставление сведений в Репозиторий» (т.е. если такой клиент желает добровольно отчитываться, он должен уведомить об этом НРД).
Комментарий. НРД проанализирует возможность введения «Уведомления о согласии на предоставление сведений в Репозиторий» и даст свои комментарии на следующем заседании рабочей группы.
- НРД рекомендуется сократить перечень кодов в справочнике «Описание ограничений на идентификатор участника» (PartyId) – исключить коды Bloomberg и Thomson Reuters.

3 Карта проектов репозитария на II полугодие 2014 г.

Рекомендации/решение рабочей группы:

- План доработок ПО репозитария прилагается к Протоколу (принять к сведению – см. Приложение 1).

4 Новая редакция xsd-схемы (3.3) в 27 релизе ПО Репозитария

Рекомендации/решение рабочей группы:

- Таблица с изменениями прилагается к Протоколу (принять к сведению – см. Приложение 2). Плановая дата установки в промышленный контур – 07.11.14.
- Рекомендуется опубликовать новую версию xsd-схемы (3.3) на сайте <http://repository.nsd.ru/>.
Комментарий. Новая версия опубликована: <http://repository.nsd.ru/versioned/developing/>

Приложение 1. План доработок ПО репозитария во II полугодии 2014 г.

Описание	Планируемая дата начала ОЭ	Планируемая дата ввода в ПРОМ
<ul style="list-style-type: none"> Исключение двойного набора сообщений (о статусах, об отказах и о регистрации), направляемых клиенту, являющемуся ИЛ для обеих сторон по сделке 	08.09.2014	22.09.2014 (26 релиз)
<ul style="list-style-type: none"> В экранных формах, открываемых в ПО "ЛУЧ" в режиме просмотра, оставить доступной только кнопку ОК* Добавление в ПО "ЛУЧ" фильтров по дате регистрации/дерегистрации* Отправка подтверждения о внесении сообщения в Журнал входящих сообщений Репозитария Выгрузка счетов за репозитарные услуги в Web-кабинет* Служебные уведомления в ПО "ЛУЧ" о приеме/отказе в приеме пакета, направляемых Почтовым Диспетчером Изменение алгоритма обработки полученных от Репозитария документов (разработка правил очередности загрузки и обработки сообщений)* Идентификация клиентов Репозитария по фиксированному набору кодов Отмена входящих сообщений в случае отсутствия ЭДО у БИЛ/ИЛ контрагента Подстановка кратких наименований участников (partyName) из Справочника клиентов Репозитария в случае их не указания во входящих анкетах Доработка одностороннего репортинга, если одной из сторон является лицо, не обязанное предоставлять информацию в Репозитарий 	27.10.2014	10.11.2014 (27 релиз)
<ul style="list-style-type: none"> Изменение xsd-схемы, версия 3.3 Расылка расчетных документов на репозитарный код клиента Модернизация справочника отказов (ReasonCode) Диагностики ошибок валидации сообщений на русском языке Изменение xsd-схемы в соответствии с новой редакцией Приложений к Указанию Банка России 3253-У, версия 3.4 	01.12.2014	15.12.2014 (28 релиз)
<ul style="list-style-type: none"> Взаимодействие с иностранным репозитарием (по EMIR) Добавление справочника с причинами отказа операциониста (в случае отклонения сообщения на стороне клиента) Направление уведомления второму контрагенту при поступлении сообщения от первого контрагента при встречной схеме сверки 	2015	(№ релиза уточняется)

* - задача может быть перенесена в другой релиз

Приложение 2. Изменения, вносимые в спецификацию электронных сообщений (xsd-схему) версии 3.2 в 27 релизе ПО Репозитория (версия 3.3).

№ п/п	Название элемента в схеме формата сообщений репозитория	Название элемента в форме ПО Луч и Web-кабинета	Изменение	Техническое описание
Анкета генерального соглашения (СМ010)				
1	unwillingReportingParty	Сторона, не предоставляющая отчетность	Название элемента заменяется на « Сторона, не обязанная предоставлять информацию в репозиторий » На английском: «Party which is not obliged to report»	Файл схемы: nsd-extensions/nsd-master-agreement.xsd Изменения: xsd:schema/xsd:complexType[@name='MasterAgreementTerms']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='fpml:Product']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='unwillingReportingParty']
2	countryCode	Код страны контрагента Counterparty's country code	В Анкету генерального соглашения (СМ010) добавляется новый элемент: код страны контрагента, указанного в поле <unwillingReportingParty> (указывается значение из внешнего справочника Country code). Обязательное заполнение при заполнении элемента <unwillingReportingParty>.	Файл схемы: nsd-extensions/nsd-master-agreement.xsd Изменения: В блок xsd:schema/xsd:complexType[@name='MasterAgreementTerms']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='fpml:Product']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='unwillingReportingParty'] добавлен новый элемент: countryCode - помечается как minOccurs="0", mfr (<xsd:appinfo source="mfr"/>)
Все анкеты				
1.	partyName	Наименование участника	Присвоить элементу признак sfr – поле специальной сверки.	Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-shared-5-4.xsd Изменения: xsd:schema/xsd:complexType[@name='Party']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='partyName' and @type='PartyName'] - помечается как sfr

Товарные ПФИ (CM051, CM052, CM053, CM054)

2.	valueDate	Дата валютирования	<p>Помечается как неиспользуемый (ncf)</p> <p>Снимается признак поля, определяющего уникальность анкеты (umf)</p>	<p>Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd</p> <p>Изменения: <i>xsd:schema/xsd:complexType[@name='CommodityForward']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='Product']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='valueDate' and @type='AdjustableOrRelativeDate']</i> - помечается как ncf (<xsd:appinfo source="ncf"/>) - удален umf (<xsd:appinfo source="umf"/>)</p>
3.	CommodityCalculationPeriods.model	Выбор способа указания расчетных периодов.	Помечается как опциональный (afr), необязательное заполнение	<p>Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd</p> <p>Изменения: <i>xsd:schema/xsd:complexType[@name='AveragePriceLeg']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='CommoditySwapLeg']/xsd:sequence[1]/xsd:group[@ref='CommodityCalculationPeriods.model']</i> - помечается как afr (<xsd:appinfo source="afr"/>)</p>
4.	Выбор	Выбор варианта определения дат поставки.	Помечается как неиспользуемый (ncf)	<p>Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-asset-5-4.xsd</p> <p>Изменения: <i>xsd:schema/xsd:group[@name='CommodityProduct.model']/xsd:sequence[1]/xsd:sequence[1]/xsd:choice[1]</i> - помечается как ncf (<xsd:appinfo source="ncf"/>)</p>
5.	deliveryDateRollConvention	Правило переноса даты поставки.	Помечается как неиспользуемый (ncf)	<p>Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-asset-5-4.xsd</p> <p>Изменения: <i>xsd:schema/xsd:group[@name='CommodityProduct.model']/xsd:sequence[1]/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='deliveryDateRollConvention' and @type='Offset']</i> - помечается как ncf (<xsd:appinfo source="ncf"/>)</p>
6.	quantityReference	Ссылка на количество	Помечается как неиспользуемый (ncf)	<p>Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd</p> <p>Изменения: <i>xsd:schema/xsd:complexType[@name='AveragePriceLeg']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='CommoditySwapLeg']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='quantityReference' and @type='QuantityReference']</i> - помечается как ncf (<xsd:appinfo source="ncf"/>)</p>

7.	pricingStartDate	Начальная дата расчета цены	Помечается как неиспользуемый (ncf)	Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd Изменения: <i>xsd:schema/xsd:complexType[@name='AveragePriceLeg']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='CommoditySwapLeg']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='pricingStartDate' and @type='AdjustableDate']</i> - помечается как ncf (<xsd:appinfo source="ncf"/>)
8.	Вариант выбора	Способ определения дат	Помечается как неиспользуемый (ncf)	Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd Изменения: <i>xsd:schema/xsd:complexType[@name='CommodityPricingDates']/xsd:sequence[1]/xsd:choice[1]/xsd:sequence[1]</i> - помечается как ncf (<xsd:appinfo source="ncf"/>)
9.	Выбор	Выбор варианта представления спреда.	Помечается как опциональный (afr), необязательное заполнение	Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd Изменения: <i>xsd:schema/xsd:complexType[@name='FloatingLegCalculation']/xsd:sequence[1]/xsd:choice[1]</i> - помечается как afr (<xsd:appinfo source="afr"/>)
10.	deliveryLocation	Место поставки	Помечается как опциональный (afr), необязательное заполнение	Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd Изменения: <i>xsd:schema/xsd:complexType[@name='BullionPhysicalLeg']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='PhysicalForwardLeg']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='deliveryLocation' and @type='BullionDeliveryLocation']</i> - помечается как afr (<xsd:appinfo source="afr"/>), mre удален
11.	Вариант выбора	Физическое количество	Помечается как опциональный (afr), необязательное заполнение	Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd Изменения: <i>xsd:schema/xsd:group[@name='CommodityFixedPhysicalQuantity.model']/xsd:sequence[1]/xsd:choice[1]/xsd:element[@name='physicalQuantity' and @type='CommodityNotionalQuantity']</i> - помечается как afr (<xsd:appinfo source="afr"/>)
12.	shape	Форма металлической продукции	Помечается как неиспользуемый (ncf) Снимается признак поля, определяющего уникальность анкеты (umf)	Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd Изменения: <i>xsd:schema/xsd:complexType[@name='Metal']/xsd:sequence[1]/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='shape' and @type='CommodityMetalShape']</i> - помечается как ncf (<xsd:appinfo source="ncf"/>) - удален umf (<xsd:appinfo source="umf"/>)
13.	brand	Бренд	Помечается как неиспользуемый (ncf)	Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd Изменения: <i>xsd:schema/xsd:complexType[@name='Metal']/xsd:sequence[1]/xsd:sequence[2]/xsd:element[@name='brand' and @type='CommodityMetalBrand']</i>

				- помечается как ncf (<xsd:appinfo source="ncf"/>)
14.	grade	Класс.	Помечается как неиспользуемый (ncf)	Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd Изменения: <i>xsd:schema/xsd:complexType[@name='Metal']/xsd:sequence[1]/xsd:sequence[3]/xsd:element[@name='grade' and @type='CommodityMetalGrade']</i> - помечается как ncf (<xsd:appinfo source="ncf"/>)
15.	deliveryConditions	Условия поставки	Помечается как неиспользуемый (ncf)	Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd Изменения: <i>xsd:schema/xsd:complexType[@name='MetalPhysicalLeg']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='PhysicalForwardLeg']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='deliveryConditions' and @type='MetalDelivery']</i> - помечается как ncf (<xsd:appinfo source="ncf"/>)
16.	deliveryPeriods	Периоды поставки	Помечается как неиспользуемый (ncf)	Файл схемы: nsd-extensions/nsd-com.xsd Изменения: <i>xsd:schema/xsd:complexType[@name='CommodityPhysicalLeg']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='fpml:PhysicalForwardLeg']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='deliveryPeriods' and @type='fpml:CommodityDeliveryPeriods']</i> - помечается как ncf (<xsd:appinfo source="ncf"/>)
17.	Выбор	Выбор способа указания номинального количества	Помечается как опциональный (afr), необязательное заполнение	Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd Изменения: <i>xsd:schema/xsd:group[@name='CommodityNotionalQuantity.model']/xsd:choice[1]/xsd:sequence[1]/xsd:choice[1]</i> - помечается как afr (<xsd:appinfo source="afr"/>)
18.	sCoTASpecifications	Признак спецификации SCoTA	Помечается как неиспользуемый (ncf)	Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd Изменения: <i>xsd:schema/xsd:complexType[@name='CoalProduct']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='sCoTASpecifications' and @type='xsd:boolean']</i> - помечается как ncf (<xsd:appinfo source="ncf"/>)
19.	paymentDate	Дата платежа	Помечается как неиспользуемый (ncf)	Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd Изменения: <i>xsd:schema/xsd:complexType[@name='EnvironmentalPhysicalLeg']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='PhysicalSwapLeg']/xsd:sequence[1]/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='paymentDate' and @type='DateOffset']</i> - помечается как ncf (<xsd:appinfo source="ncf"/>)
20.	Выбор	Выбор качественных характеристик газа	Помечается как неиспользуемый (ncf)	Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd Изменения: <i>xsd:schema/xsd:complexType[@name='GasProduct']/xsd:sequence[1]/xsd:choice[1]</i>

				- помечается как ncf (<xsd:appinfo source="ncf"/>)
21.	paymentDaysOffset	Смещение дат платежей	Помечается как неиспользуемый (ncf)	Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd Изменения: xsd:schema/xsd:complexType[@name='CommodityRelativePaymentDates']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='paymentDaysOffset' and @type='DateOffset'] - помечается как ncf (<xsd:appinfo source="ncf"/>)
22.	CommodityContent.model		Помечается как неиспользуемый (ncf)	Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd Изменения: xsd:schema/xsd:complexType[@name='CommodityForward']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='Product']/xsd:sequence[1]/xsd:group[@ref='CommodityContent.model'] - помечается как ncf (<xsd:appinfo source="ncf"/>)
23.	Выбор	Выбор способа определения наиболее позднего времени исполнения	Помечается как неиспользуемый (ncf)	Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd Изменения: xsd:schema/xsd:complexType[@name='CommodityAmericanExercise']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='Exercise']/xsd:sequence[1]/xsd:choice[1] - помечается как ncf (<xsd:appinfo source="ncf"/>)
24.	expirationTime	Время истечения опциона	Помечается как неиспользуемый (ncf)	Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd Изменения: xsd:schema/xsd:complexType[@name='CommodityAmericanExercise']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='Exercise']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='expirationTime' and @type='BusinessCenterTime'] и xsd:schema/xsd:complexType[@name='CommodityEuropeanExercise']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='Exercise']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='expirationTime' and @type='BusinessCenterTime'] - помечаются как ncf (<xsd:appinfo source="ncf"/>)
25.	latestExerciseTime	Наиболее позднее время исполнения	Помечается как неиспользуемый (ncf)	fpml:nonpublicExecutionReport/fpml:trade/fpml:commodityOption/fpml:physicalExercise/fpml:americanExercise/fpml:latestExerciseTime Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-com-5-4.xsd Изменения: xsd:schema/xsd:complexType[@name='CommodityPhysicalAmericanExercise']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='Exercise']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='latestExerciseTime' and @type='PrevailingTime'] - помечаются как ncf (<xsd:appinfo source="ncf"/>)
Анкета договора РЕПО (СМ041)				
26.	id	Атрибут (идентификатор части продукта)	Помечается как неиспользуемый (ncf)	Файл схемы: fpml-extensions-nsd-annotation/fpml-ext-repo.xsd Изменения: xsd:schema/xsd:complexType[@name='RepoTransactionLeg']/xsd:attribute[@na

				<i>me='id' and @type='xsd:ID' and @use='optional']</i> - помечается как ncf (<xsd:appinfo source="ncf"/>)
Процентные сделки (СМ032, СМ033, СМ034)				
27.	resetDatesAdjustments	Корректировка дат изменения плавающей ставки	Удален признак обязательного заполнения (mre)	Файл схемы: fpml-5-4/recordkeeping-nsd-annotation/fpml-ird-5-4.xsd Изменения: <i>xsd:schema/xsd:complexType[@name='ResetDates']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='resetDatesAdjustments' and @type='BusinessDayAdjustments']</i> - удален признак mre (<xsd:appinfo source="mre">1</xsd:appinfo>)

Обновление справочников (раздел «Таксономия»).

№	Тип справочника	Описание	Изменение
1.	Country code	Код страны контрагента.	Добавлен справочник
2.	BullionDeliveryLocation	Справочник, определяющей место поставки слитков	Добавлено новое значение (расширение NSD) – Moscow