

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

Дата проведения заседания: 26 февраля 2016 г. (пятница)

Время: 10:00 – 12:00

### 1. Состав и особенности 38 релиза ПО Репозитария (плановая дата установки – 18 апреля 2016). Тестирование (НРД)

#### Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы (РГ)

- 1.1. Участникам был представлен новый председатель рабочей группы – Алексей Гагарышев, представитель АО «СберТех», занимающего в компании должность главного руководителя разработки отдела реализации бизнес-решений бэкофиса, ЦК развития технологий корпоративно-инвестиционного бизнеса Департамента развития технологий инвестиционного бизнеса и управления рисками.
- 1.2. Участники получили уточненную информацию о датах выполнения задач по дорожной карте проекта Репозитарий 2.0, а также о запланированных датах начала опытной эксплуатации и релизах Репозитария для 37 – 39 релизов.

#### **Рекомендация РГ:**

Отсутствуют

- 1.3. Релиз №38 (18 апреля 2016):

- 1.3.1. В рамках внедрения 38 релиза участникам станут доступны новые форматы анкет, позволяющие осуществлять отчетность по договорам CSA (СМ015) на добровольной основе, а также назначать Информированных лиц (СМ016/СМ017) в рамках изменения функционала по проекту Репозитарий 2.0. Изменения форматов также затронут внедрение новых полей для указания опционального кода УТИ, признака определяющего отнесение договора к обязательным для отчетности видам финансовых инструментов, а также поля для формирующего УТИ лица (обязательность указания полей вводится с 1 июля 2016).

- 1.3.2. Установка схемы 4.1 является опциональной, в то же время Репозитарий рекомендовал перейти на новые форматы сообщений для возможности начала подачи заявлений по форме СМ016 в Web-кабинете Репозитария заблаговременно до даты внедрения 39 релиза.

- 1.3.3. С 28 июня 2016 (39 релиз) Репозитарий планирует перейти на новую модель отчетности в рамках реализации проекта Репозитарий 2.0. Из текущей модели будет удален институт Базового информирующего лица и изменен порядок назначения Информированных лиц посредством подачи заявлений по форме СМ016. Участникам была предоставлена информация о содержании формата анкеты, механизме назначения информирующих лиц и алгоритме определения информирующего лица контрагента.

#### **Рекомендация РГ:**

Участники высказали опасения о возможных задержках в подготовке заявлений на информирующих лиц на бумажных носителях (по форме СМ016), в случае отсутствия ЭДО у клиентов-нерезидентов.

#### **Рекомендация НРД:**

Репозитарий НРД разработает печатную форму анкеты СМ016, которая будет доступна, ориентировочно, с 18 марта 2016 г. С этого момента участники могут использовать форму для оформления и подачи заявления на информирующих лиц. Таким образом, на оформление одного документа отводится более чем 3 месяца, что на наш взгляд является достаточным сроком.

Для возможности подачи документов по ЭДО, было рекомендовано инициировать подключение к бесплатной версии Web-кабинета для клиентов Репозитария, у которых до сих пор подключение отсутствовало.

### 2. Доработки репозитария, вызванные изменениями в регулировании (НРД)

#### Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

- 2.1. Внедрение УТИ

- 2.1.1. Участникам были представлены изменения к схеме 4.1, в которой появляется возможность указания кода УТИ и сопутствующих атрибутов, позволяющих определить необходимость наличия кода, а также возможность сформировать код с помощью сервиса на стороне НРД.
- 2.1.2. Репозиторий НРД подтвердил, что НРД разработает сервис для возможности формирования кода УТИ для сообщений участников. Был представлен механизм формирования кода на стороне НРД.

**Рекомендация РГ:**

Для возможности использования сервиса НРД по формированию кода УТИ необходимо изменить требование в методических рекомендациях и Указании Банка России, предписывающего формирование кода в момент заключения сделки, позволив формирование кода на более поздних этапах жизненного цикла сделки. Таким образом, участники в отсутствие механизма по формированию кода на своей стороне имели бы возможность для использования сервиса третьих лиц, например НРД.

- 2.2. Разработка отчётности по индивидуальным сделкам вне рамок генеральных соглашений – изменения к функционалу:
  - 2.2.1. На рабочей группе от 16 декабря 2015 г. участникам был представлен новый формат сообщений, включающий отчетность по разовым договорам вне генеральных соглашений. Начало тестирования нового формата запланировано на конец апреля.
  - 2.2.2. Ввиду того, что введение обязательной отчетности по договорам вне генеральных соглашений может вызвать на стороне участников необходимость по отчетности сделок, носящих массовый характер, репозиторий НРД разработал новые форматы для «технических» сделок РЕПО и валютный своп. Формат предполагает одностороннюю отчетность, предполагается возможность включения до 100 000 сделок в одном сообщении.

### 3. | Переход на Web-кабинет Репозитория (НРД)

#### Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

- 3.1. Для плавного перехода на кабинет, участникам было предложено начать использование его промышленной версии с 01.04.2016, таким образом, у участников (при необходимости) будет возможность протестировать функционал кабинета, работая в двух параллельных интерфейсах – ПО «ЛУЧ» и Web-кабинета до 28.06.2016.
- 3.2. Процедура подключения к Web-кабинету будет доступна в марте.
- 3.3. Репозиторий НРД проводит опрос среди участников по развитию функционала Web-кабинета:
  - 3.3.1. На основании полученных предложений участников будет составлен план по доработкам Web-кабинета в течение 2016 г. Критические доработки будут реализованы в течение марта 2016 г.

### 4. | Внедрение форматно-логических контролей (качество отчетности) (НРД)

#### Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

- 4.1. Репозиторий НРД представил обзор типичных ошибок, которые участники допускают в отчетности в Репозиторий.
- 4.2. Для повышения качества информации и предотвращения санкций со стороны Банка России, Репозиторий НРД для своих клиентов планирует ввести ряд контролей, которые будут приводить к отказам в регистрации сообщений при попытке записи в реестр договоров, в случае типичных ошибок. Отдельные контроли будут носить уведомительный характер, с целью обратить внимание клиентов на возможные ошибки.  
По просьбе клиентов, будут внедрены дополнительные уведомления о возможных отклонениях в расчетных ставках и курсах иностранных валют, а также контроль соблюдения регуляторного срока по отчетности в репозиторий.

### 5. | Вопросы участников по итогам (НРД, Участников)

## Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

- 5.1. Вопрос не был обсужден в ходе заседания. Ранее участникам было предложено провести тестирование функционала в Web-кабинете для проверки корректной работы интерфейса по историческим данным.
- 5.2. По вопросу корректного указания статуса по договору Репозитарий НРД получил консультации от Банка России по эл. почте, ответ был предоставлен в повестке заседания.
- 5.3. Доработка анкеты СМ092 для возможности указания обеспечения в виде ценных бумаг запланирована в 41 релизе (24 октября 2016 г.).