

ПРОТОКОЛ № 41
заседания Комитета по расчетно-депозитарной деятельности и тарифам
НКО ЗАО НРД

Дата проведения заседания: 29.02.2016

Место проведения заседания: Москва, Спартаковская, 12, переговорная 1.6.

Форма проведения заседания: очная (совместное присутствие для обсуждения вопросов повестки дня и принятия решений по вопросам, поставленным на голосование).

Присутствовали:

ФИО	ДОЛЖНОСТЬ
1 Владислав Викторович Власенко	Начальник Депозитария, ПАО «МДМ Банк»
2 Ирина Юрьевна Гурова	Руководитель проектов по операционному развитию, АО «Специализированный депозитарий «ИНФИНИТУМ»
3 Юлия Юрьевна Давыдова	начальник Управления развития продуктов Департамента обслуживания ценных бумаг, ПАО РОСБАНК
4 Сергей Юрьевич Данилин	Операционный директор, ООО «Компания БКС»
6 Дмитрий Витальевич Зализняк	Начальник Управления депозитарных услуг, КБ «Дж.П. Морган Банк Интернешнл» (ООО)
6 Андрей Александрович Захаров	начальник Управления оформления и учета операций на финансовом рынке Операционного департамента, Банк России
7 Анна Александровна Зубанова	Начальник Дивизиона инвестиционных услуг, ПАО «СЭБ Банк»
8 Александр Николаевич Кондратьев	Начальник Управления расчетов по операциям на фондовом рынке, ООО «Ренессанс Брокер»
9 Оксана Викторовна Маркова	Руководитель Блока Операционной поддержки бизнеса, АО «ВТБ Капитал»
10 Алексей Владимирович Федотов	Директор, Начальник Департамента ценных бумаг, Россия и СНГ, АО КБ «Ситибанк»
11 Александр Викторович Шарыкин	Начальник отдела оформления депозитарных операций и операционного развития Управления депозитарных услуг, АО ЮниКредит Банк
12 Кристина Анатольевна Щеброва	Руководитель отдела клиентских отношений Депозитария, ООО «Барклайс Капитал»

Отсутствовали:

	ФИО	ДОЛЖНОСТЬ
1	Юрий Владимирович Дубин	Управляющий директор – директор Депозитария, ПАО Сбербанк
2	Мария Алексеевна Ильина	заместитель Директора Депозитария – начальник Управления расчетов и корпоративных действий, ВНЕШЭКОНОМБАНК
3	Ксения Владимировна Шинкаренко	Директор Департамента депозитарных операций, ПАО Банк «ФК Открытие»

Кворум для принятия решений по всем вопросам повестки дня имелся.

Председательствующий на заседании – Д.В. Зализняк

Секретарь заседания – В.И. Беляев

ПОВЕСТКА ДНЯ ЗАСЕДАНИЯ:

- 1. О новых расчетных сервисах НРД.**
Докладчик: С.В. Грянченко.
- 2. Использование подбора ценных бумаг для расчетов DVP.**
Докладчик: И.В. Тиссен.
- 3. О возможных вариантах по индексации тарифов.**
Докладчик: Г.А. Урютов.
- 4. О ходе запуска реформы корпоративных действий.**
Докладчик: С.А. Берневега.
- 5. Разное.**

ВОПРОС № 1

О новых расчетных сервисах НРД

Слушали: С.В. Грянченко

Обсуждалось:

- 1) Запуск новых расчетных сервисов НРД, в том числе, которые дают участникам рынка возможность использования дополнительных сервисов внутри НРД, в том числе:
 - Конверсионных сервисов, которые доступны как кредитным, так и некредитным организациям. Клиентам доступны операции по покупке-продаже валюты в соответствии с утвержденным списком.
 - Сервис по подаче поручений в валюте, отличной от валюты счета (например, поручение в долларах к счету в евро). При этом на сегодняшний момент существуют законодательные и технологические ограничения на использование данного сервиса при расчетах в рублях.
 - В 2015 году внедрена услуга по конвертации выплат по корпоративным действиям, когда владелец ценных бумаг получает выплату в валюте, отличной от валюты выплаты. Набор доступных валют для финального платежа клиенту ограничен долларами США и евро, рубли не используются.
 - Запущена услуга постоянного платежного поручения, которая может использоваться в отношении ко всем банковским счетам, при этом неторговый счет позволяет указывать время и сумму операции, торговый счет – только сумму. Переводы могут осуществляться в т.ч. и за пределы НРД.
 - 1 марта 2016 года запускается услуга по условному денежному переводу (Payment versus Payment, PVP). Услуга предназначена для кредитных организаций со счетами, открытыми внутри НРД, доступна в рамках остатка денежных средств и позволяет минимизировать (исключить) риск расхождений между датами в исполнении встречных платежных поручений (т.е. невозможно исполнение одного поручения без исполнения встречного).
- 2) Возможность пересмотра процедур валютного контроля с точки зрения их упрощения для участников рынка, не являющихся кредитными организациями и готовность НРД пересмотреть такие процедуры после получения соответствующих запросов от участников рынка, в том числе, членов Комитета.

Вопрос, поставленный на голосование:

Принять к сведению представленные материалы.

Итоги голосования: «За» - 12; «Против» - 0; «Воздержался» - 0.

РЕШЕНИЕ ПРИНЯТО ЕДИНОГЛАСНО.

ВОПРОС № 2

Использование подбора ценных бумаг для расчетов DVP

Слушали: И.В. Тиссен

Обсуждалось:

Предпосылки для реализации сервиса: сервис реализуется для повышения скорости расчетов на внебиржевом рынке после завершения клиринга на бирже-клиенты получают возможность использовать систему СУО НРД для осуществления подбора ценных бумаг в рамках исполнения сделок DVP. При этом в рамках процедуры подбора происходит подбор ценных бумаг только в рамках недостающего количества.

Для сделок DVP-1,2,3, в которых отмечено специальное поле, инициирующее подбор ценных бумаг для исполнения конкретного поручения DVP. В этом случае сначала осуществляется подбор ценных бумаг, в том числе с торговых счетов открытых под клиринг НКЦ и затем – расчеты по внебиржевой ноге сделки. Подбор осуществляется с периодичностью в 30 минут. График подбора может быть изменен.

Для того, чтобы обозначить разделы, и/или ценные бумаги, с которых может осуществляться подбор ценных бумаг, клиент должен подать клиринговое поручение на маркирование разделов. Способы подачи поручений на маркирование разделов: через ПО «ЛУЧ» и Веб-сервисы.

Рекомендации членов Комитета:

- 1) В рабочем порядке подготовить и отправить членам Комитета информацию по функционированию сервиса в связке с электронным мэтчингом/hold&release.
- 2) Рассмотреть возможность введения более частого подбора сразу после клиринговых сеансов биржи.
- 3) Рассмотреть возможность введения указания времени начала подбора.
- 4) Рассмотреть возможность разработки отчета о промаркированных разделах.

Вопрос, поставленный на голосование:

Принять к сведению представленные материалы с учетом рекомендаций членов Комитета.

Итоги голосования: «За» - 12; «Против» - 0; «Воздержался» - 0.

РЕШЕНИЕ ПРИНЯТО ЕДИНОГЛАСНО.

ВОПРОС № 3

О возможных вариантах по индексации тарифов

Слушали: Г.А. Урютова

Обсуждалось:

Особенности установки и формирования текущих тарифов за инвентарные операции (FOP/DVP) в ICSD, которые установлены в рублях исходя из курса рубля к евро в 2006 году и несоответствие текущих тарифов себестоимости услуги в связи с падением курса рубля начиная с 2014 года.

Планы Euroclear по пересмотру тарифов за хранение депозитарных расписок с середины 2016 года на 20-25%.

Особенности формирования тарифов на стороне клиентов, в частности, брокеров, которые могут включать в брокерскую комиссию в том числе и плату за услуги депозитария, и последствия индексации тарифов на стороне НРД для российских участников рынка.

Наиболее приемлемые варианты по индексации тарифов с точки зрения членов Комитета.

Возможность по использованию страновых коэффициентов для возмещения расходов НРД и сложности, связанные с переходом на маркированный учет ценных бумаг.

Рекомендации членов Комитета:

Предоставить членам Комитета дополнительную аналитику по формированию тарифа НРД в части:

- инвентарных операций в ICSD;
- платы за хранение ценных бумаг в ICSD;
- предложений по изменению тарифа за хранение депозитарных расписок.

Вопрос, поставленный на голосование:

Принять к сведению представленные материалы и вернуться к рассмотрению вопроса после предоставления дополнительных материалов согласно рекомендациям членов Комитета.

Итоги голосования: «За» - 12; «Против» - 0; «Воздержался» - 0.

РЕШЕНИЕ ПРИНЯТО ЕДИНОГЛАСНО.

ВОПРОС № 4

О ходе запуска реформы корпоративных действий

Слушали: С.А. Берневегу

Обсуждалось:

Разработка нормативно-правовой базы, в том числе подготовка законодательства в рамках центра корпоративной информации.

Ход переговоров с Банком России по упрощению законодательства для более оперативного получения информации о корпоративных действиях.

Тестирование Веб-кабинета по корпоративным действиям и готовность функционала к 01.07.2016.

Рекомендации членов Комитета:

- 1) Предоставить участникам рынка более продолжительные сроки на тестирование функционала Веб-кабинета.
- 2) На следующем заседании Комитета предоставить информацию о реализации рекомендаций по ЦКИ и ЦКД, которые были сформулированы на заседаниях в 2015 году.

Вопрос, поставленный на голосование:

Принять к сведению представленные материалы с учетом рекомендаций членов Комитета.

Итоги голосования: «За» - 12; «Против» - 0; «Воздержался» - 0.

РЕШЕНИЕ ПРИНЯТО ЕДИНОГЛАСНО.

ВОПРОС № 5

Разное. Отчет по сервисам проекта «Электронный мэтчинг»

Слушали: С.Г. Кузьмина

Обсуждалось:

Статистика по электронному мэтчингу и Hold&Release по итогам 2014 и 2015 годов.

Доработки, включенные в состав 37го релиза программного обеспечения НРД, установленные 29 февраля 2016 года.

Возможность получения статистики по итогам 1 квартала 2016 года.

Рекомендации членов Комитета:

На заседании Комитета в апреле 2016 года предоставить членам Комитета статистику за 1 кв. 2016 по сервисам проекта Электронный мэтчинг с указанием количества клиентов. Проанализировать созданные сервисы и то, насколько они удовлетворяют потребности участников расчетов.

Вопрос, поставленный на голосование:

Принять к сведению представленные материалы с учетом рекомендации членов Комитета.

Итоги голосования: «За» - 12; «Против» - 0; «Воздержался» - 0.

РЕШЕНИЕ ПРИНЯТО ЕДИНОГЛАСНО.