



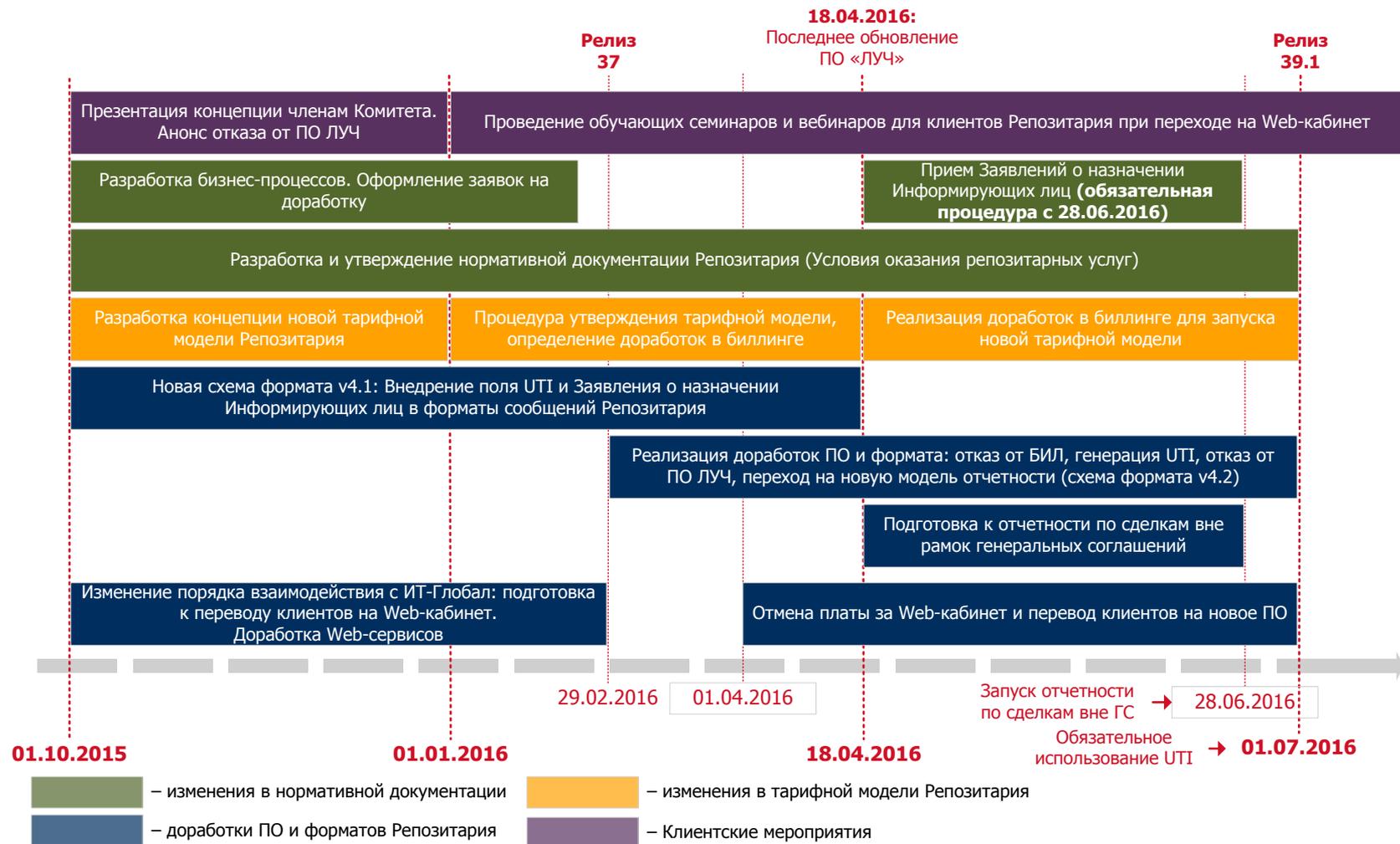
НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА



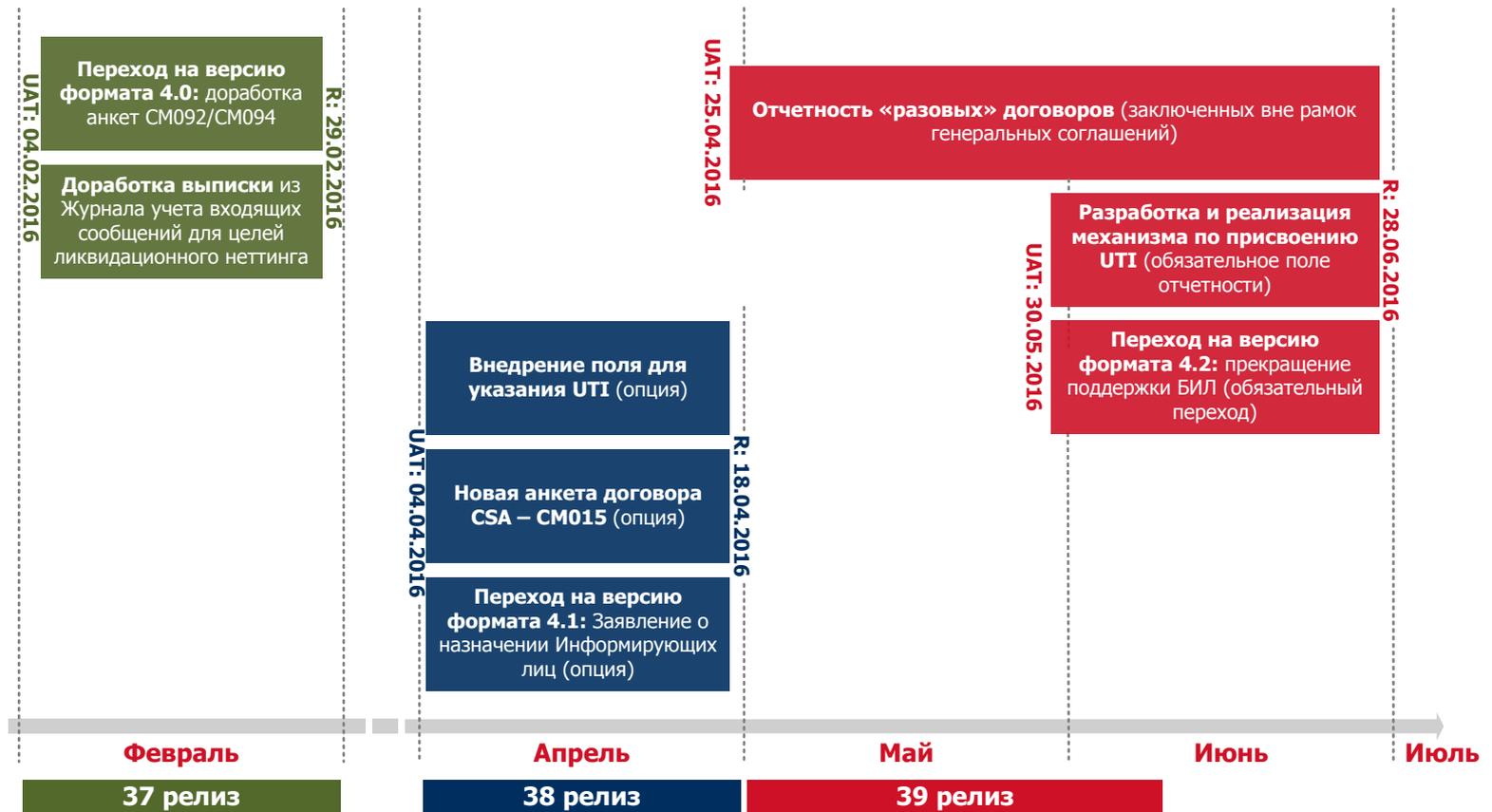
Управление развития репозитарной деятельности

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

РЕЛИЗЫ ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ РЕПОЗИТАРИЯ ЗАПЛАНИРОВАННЫЕ НА 2016 ГОД



ПЛАН-ГРАФИК РЕАЛИЗАЦИИ ДОРАБОТОК РЕПОЗИТАРИЯ НРД ФЕВРАЛЬ – ИЮНЬ 2016



UAT: 04.02.2016 – Дата начала опытной эксплуатации
R: 29.02.2016 – Дата официального релиза

38 РЕЛИЗ: СХЕМА 4.1 (ОПЦИОНАЛЬНАЯ ДЛЯ УСТАНОВКИ) **ВНЕДРЕНИЕ КОДА UTI**

ДОГОВОРЫ ТРЕБУЮЩИЕ ФОРМИРОВАНИЯ UTI

В соответствии с регулированием, только виды договоров, входящие в п.2, п.3 Указания 3253-У, а также Генеральные соглашения.

Исключения на уровне Репозитария: анкеты CM015 (CSA), CM092, CM094, анкеты по видам договоров, не входящих в п.2, 3 Указания.

ЛИЦА ФОРМИРУЮЩИЕ UTI

В соответствии с изменениями в регулировании формирующим лицом может быть: один из участников сделки или третье лицо.

НРД КАК ФОРМИРУЮЩЕЕ ЛИЦО

Участник указывает в анкете два параметра, позволяющие НРД сформировать UTI: NONREF – в поле tradeID (#4); НКО ЗАО НРД – в блоке UTIgeneratingParty.

ПРИНЦИП УНИКАЛЬНОСТИ UTI

В соответствии с принципом уникальности, UTI должен быть сформирован один раз для отдельной сделки и использоваться обеими сторонами для отчетности в свой репозитарий. Необходимо избегать повторной генерации кода.

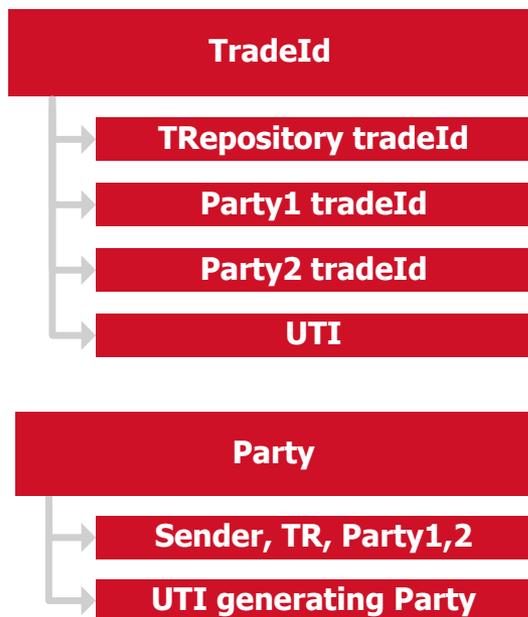


38 РЕЛИЗ: СХЕМА 4.1 (ОПЦИОНАЛЬНАЯ ДЛЯ УСТАНОВКИ) ВНЕДРЕНИЕ КОДА UTI

Формирование UTI в отчетности Репозитарию

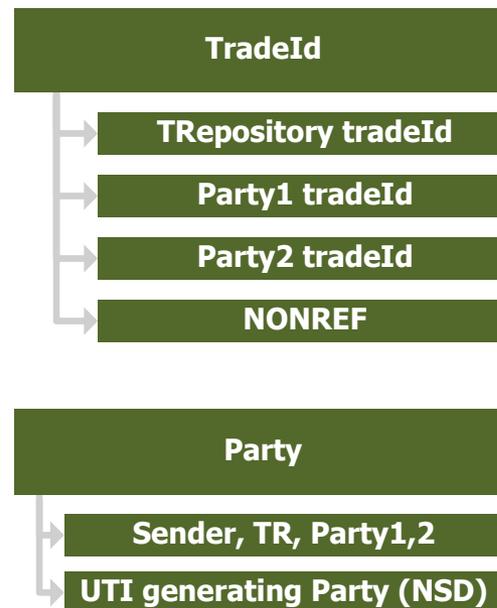
Участник имеет свой UTI

Участник указывает: номер UTI в четвертом элементе TradeId; реквизиты формирующего лица в пятом блоке Party



Участник просит НРД сформировать UTI

Клиент указывает: значение NONREF в четвертом элементе PartyId; реквизиты НРД в пятом блоке Party



38 РЕЛИЗ: СХЕМА 4.1 (ОПЦИОНАЛЬНАЯ ДЛЯ УСТАНОВКИ) ДЕРЕГИСТРАЦИЯ АНКЕТ ПРИ ЛИКВИДАЦИИ ЮРИДИЧЕСКОГО ЛИЦА

1. ИНИЦИИРОВАНИЕ ДЕРЕГИСТРАЦИИ ДОГОВОРОВ В РЕПОЗИТАРИИ:

- Уполномоченное лицо стороны – ликвидированного лица подает в Репозитарий извещение о ликвидации лица.

2. ДЕЙСТВИЯ РЕПОЗИТАРИЯ:

- Проверка документа.
- При положительных результатах проверки: подготовка служебных поручений на закрытие Генеральных соглашений, где указана ликвидированная сторона.

3. ДЕРЕГИСТРАЦИЯ АНКЕТ:

- Репозитарий направляет служебные поручения по форме СМ011 с указанием нового признака ликвидации лица (Liquidation).
- Открытые договоры дерегистрируются со статусом «D».
- Вторая сторона получает уведомления о дерегистрации договоров в реестре и закрытии генеральных соглашений.

38 РЕЛИЗ: СХЕМА 4.1 (ОПЦИОНАЛЬНАЯ ДЛЯ УСТАНОВКИ) РАЗРАБОТКА АНКЕТЫ СМ015 (CSA)

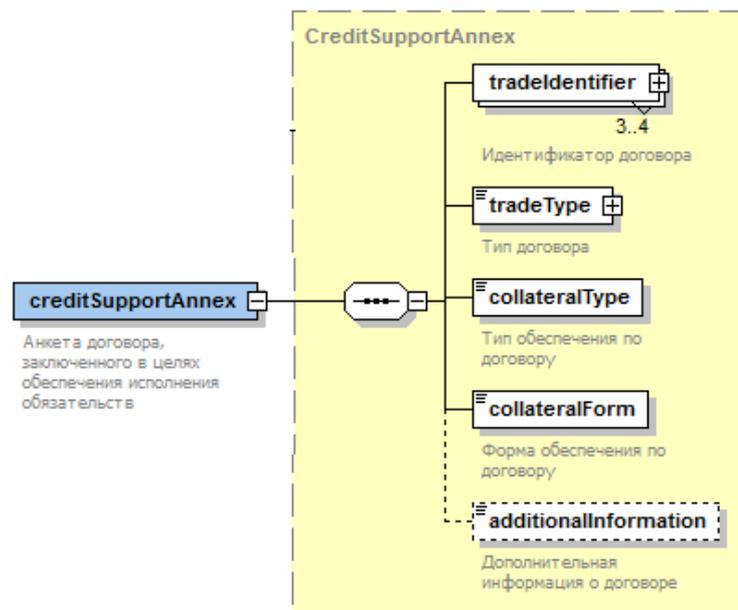
Структура анкеты CSA

Особенности анкеты

Анкета схожа со структурой анкеты Генерального соглашения СМ010. Согласование осуществляется БИЛами, в дальнейшем ИЛами.



Схема 4.1



38 РЕЛИЗ: СХЕМА 4.1 (ОПЦИОНАЛЬНАЯ ДЛЯ УСТАНОВКИ) АНКЕТА СМ016 (НАЗНАЧЕНИЕ ИНФОРМИРУЮЩЕГО ЛИЦА) (1/5)

ОСНОВНЫЕ БЛОКИ АНКЕТЫ

- Идентификатор заявления (applicationId)
- Информирующее лицо (agreementReportingAgent)
 - Информирующее лицо (reportingAgent)
 - **Тип отчетности (reportingType)**

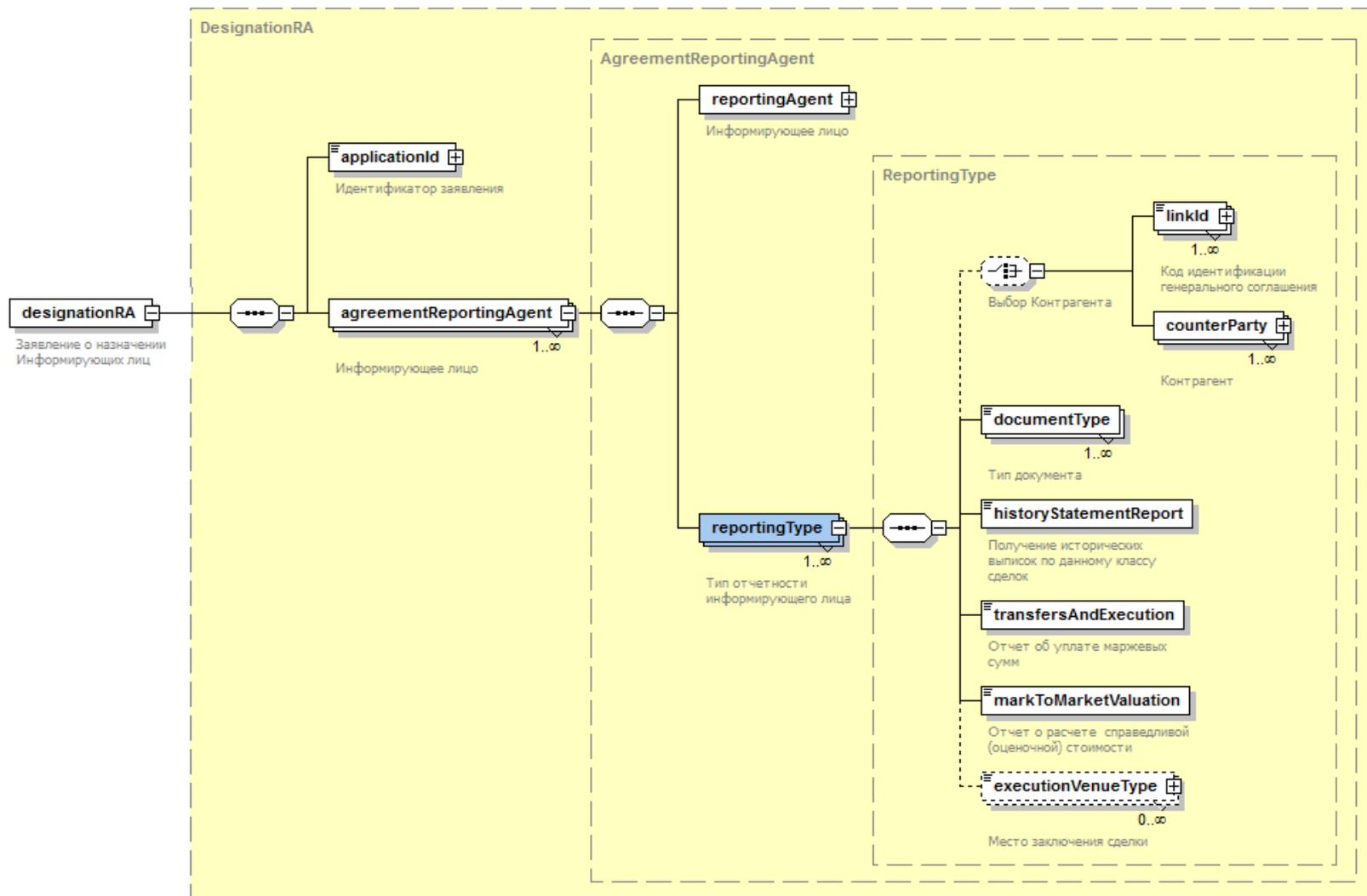
БЛОК ТИП ОТЧЕТНОСТИ (REPORTINGTYPE)

- Идентификатор Генерального соглашения (опционально)
- Контрагент (опционально)
- Признак места заключения сделки, пример – ОТС (опционально)
- Тип документа
- Признак запроса исторической информации
- Признак отчетности по форме СМ092
- Признак отчетности по форме СМ094

ВАЖНО:

Если участник не назначил ИЛа, он по умолчанию является ИЛом по своему основному репозитарному коду.

38 РЕЛИЗ: СХЕМА 4.1 (ОПЦИОНАЛЬНАЯ ДЛЯ УСТАНОВКИ) АНКЕТА СМ016 (НАЗНАЧЕНИЕ ИНФОРМИРУЮЩЕГО ЛИЦА) (2/5)



38 РЕЛИЗ: СХЕМА 4.1 (ОПЦИОНАЛЬНАЯ ДЛЯ УСТАНОВКИ) АНКЕТА СМ016 (НАЗНАЧЕНИЕ ИНФОРМИРУЮЩЕГО ЛИЦА) (3/5)

НАЗНАЧЕНИЕ ИНФОРМИРУЮЩЕГО ЛИЦА



ВАЖНО:

Не допускается пересечение полномочий для разных Информированных лиц

38 РЕЛИЗ: СХЕМА 4.1 (ОПЦИОНАЛЬНАЯ ДЛЯ УСТАНОВКИ) АНКЕТА СМ016 (НАЗНАЧЕНИЕ ИНФОРМИРУЮЩЕГО ЛИЦА) (4/5)

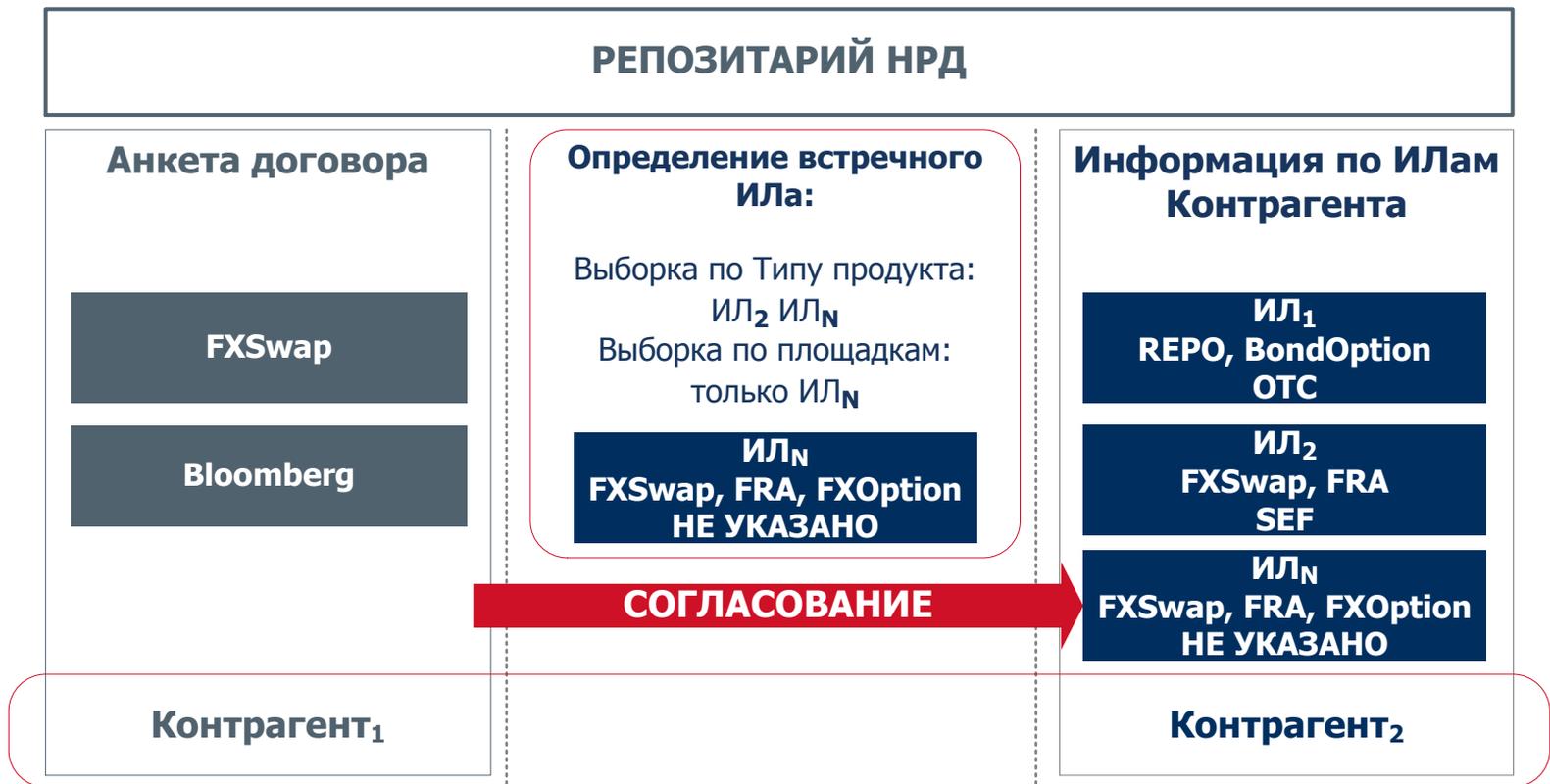
ПОДБОР ВСТРЕЧНОГО ИНФОРМИРУЮЩЕГО ЛИЦА

- Подбор встречного Информированного лица происходит по параметрам, указанным в заявлениях на Информированных лиц участников сделки.
- Из списка встречных Информированных лиц, назначенных вторым участником, подбирается нужный, по критериям, указанным в анкете договора.
- Согласование Генеральных соглашений происходит между Информированными лицами, которым назначен Тип документа – masterAgreement.

	Контрагент ₁			Контрагент ₂		
	Код ИЛ	Торговая площадка	Тип сделки	Тип сделки	Торговая площадка	Код ИЛ
Двусторонняя отчетность, сверка	Код ₁	ОТС	ALL	Repo / FX swap	ОТС	Код ₄
Односторонняя отчетность	Код ₂	Не указ.	ALL	FX swap	СПФИ	Код ₂

38 РЕЛИЗ: СХЕМА 4.1 (ОПЦИОНАЛЬНАЯ ДЛЯ УСТАНОВКИ)
АНКЕТА СМ016 (НАЗНАЧЕНИЕ ИНФОРМИРУЮЩЕГО ЛИЦА) (5/5)

ПОДБОР ВСТРЕЧНОГО ИНФОРМИРУЮЩЕГО ЛИЦА



39 РЕЛИЗ:

ПРЕДЛАГАЕМАЯ МОДЕЛЬ VULK-ФОРМАТА ДЛЯ РЕПО СООБЩЕНИЙ

В связи с тем, что введение отчетности по разовым договорам может вызвать отчетность на стороне участников по сделкам, носящих массовый характер, Репозитарий разработал новый формат сообщений:

[Блок 1]	[Блок 2]	[Блок 3]	[Блок 4]
Сведения об отчете	Общие сведения о сделках репо, входящих в отчет	Параметры сделок, входящих в отчет (повторяющийся блок)	Участники Анкеты
header - Заголовок сообщения.	linkId/ nonStandardTerms – Номер ГС/отсутствие ГС	counterParty - Контрагент	TradeRepository - репозитарий
tradeHeader - Общая информация о договоре.	Торговая площадка	tradeId (UTI) - Идентификационные коды	Sender - Отправитель
reportId – Идентификатор отчета	productType - Тип продукта	fixedRate/floatingRate - Выбор типа ставки	Party – Сторона
	productId - Код классификации ПФИ	settlementAmount - Суммы расчетов	
	tradesObligationStatus - Статус исполнения (Т)	underlyer - Базовый актив	
	SettlementDate - Даты расчетов		
	collateral - Обеспечение по сделке		
	nsdSpecificTradeFields - Специальные атрибуты		

Легенда

- Обязательное поле
- Поле заполняется при наличии информации
- Поле станет обязательным ориентировочно в 2016

ВАЖНО:

Данная анкета может быть направлена только в **одностороннем порядке**



39 РЕЛИЗ:

ПРЕДЛАГАЕМАЯ МОДЕЛЬ BULK-ФОРМАТА ДЛЯ FXSWAP СООБЩЕНИЙ

[Блок 1]	[Блок 2]	[Блок 3]	[Блок 4]
Сведения об отчете	Общие сведения о сделках fxSwap, входящих в отчет	Параметры сделок, входящих в отчет (повторяющийся блок)	Участники Анкеты
header -Заголовок сообщения.	linkId/ nonStandardTerms – Номер ГС/отсутствиеГС	counterParty - Контрагент	TradeRepository - репозиторий
tradeHeader - Общая информация о договоре.	Торговая площадка	tradeId (UTI) - Идентификационные коды	Sender - Отправитель
reportId – Идентификатор отчета	productType - Тип продукта	currency1/currency2 - Валюта 1 и 2	Party – Сторона
	productId - Код классификации ПФИ	rate - Обменный курс	
	tradesObligationStatus - Статус исполнения (Т)	settlementAmount - Суммы расчетов	
	SettlementDate - Даты расчетов	dealtCurrency- Торгуемая валюта (базовый актив)	
	collateral - Обеспечение по сделке		
	nsdSpecificTradeFields - Специальные атрибуты		

Легенда

Обязательное поле

Поле заполняется при наличии информации

Поле станет обязательным ориентировочно в 2016

ВАЖНО:

Данная анкета может быть направлена только в **одностороннем порядке**



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**

Процедура подключения

01.04.2016

28.06.2016

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»



ИЗМЕНЕНИЯ ВЫЗВАННЫЕ РЕГУЛИРОВАНИЕМ И ПРОЕКТОМ РЕПОЗИТАРИЙ 2.0: НОРМАТИВНАЯ ДОКУМЕНТАЦИЯ

ДОГОВОРНАЯ БАЗА

- Договор об оказании репозитарных услуг является публичным договором
- Заключение договора об оказании репозитарных услуг осуществляется путем присоединения к указанному договору

ОТЧЕТНОСТЬ

- Расчет показателей, основанных на сведениях из указанного реестра, раскрытие информации на официальном сайте репозитария в объеме и порядке, установленных нормативными актами Банка России.
- Отчетность по разовым договорам («...Если договоры, указанные в пункте 1 статьи 15.5 настоящего Федерального закона, заключены на условиях генерального соглашения»).
- Внедрение UTI.

РЕПОЗИТАРИЙ 2.0

- Отказ от Базового информирующего лица
- Введение заявлений на Информировующих лиц
- Новая модель тарификации
- Внедрение новых форматов отчетности



39 РЕЛИЗ:

ВНЕДРЕНИЕ ПРОЦЕДУР ФОРМАТНО-ЛОГИЧЕСКОГО КОНТРОЛЯ

ТИПОВЫЕ ОШИБКИ В СООБЩЕНИЯХ УЧАСТНИКОВ

- Наименование стороны для Party1,2 = NONREF
- Дата сделки > дата расчетов
- Дата расчетов по первой части > дата расчетов по второй части сделки
- Разные валюты в частях сделки свопа: RUB-USD, USD-EUR
- Количество и номинальная сумма < 0
- Указание процентной ставки в виде десятичной дроби
- Указание корректного типа продукта из справочника Репозитария

ВНЕДРЕНИЕ КОНТРОЛЕЙ

- Для всех вышеперечисленных случаев
- Контроль срока отчетности: дата сделки – дата записи сообщения в ЖУС
- Отклонение от рассчитанной процентной ставки по формуле
- Отклонение от официального курса иностранной валюты БР



**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.