

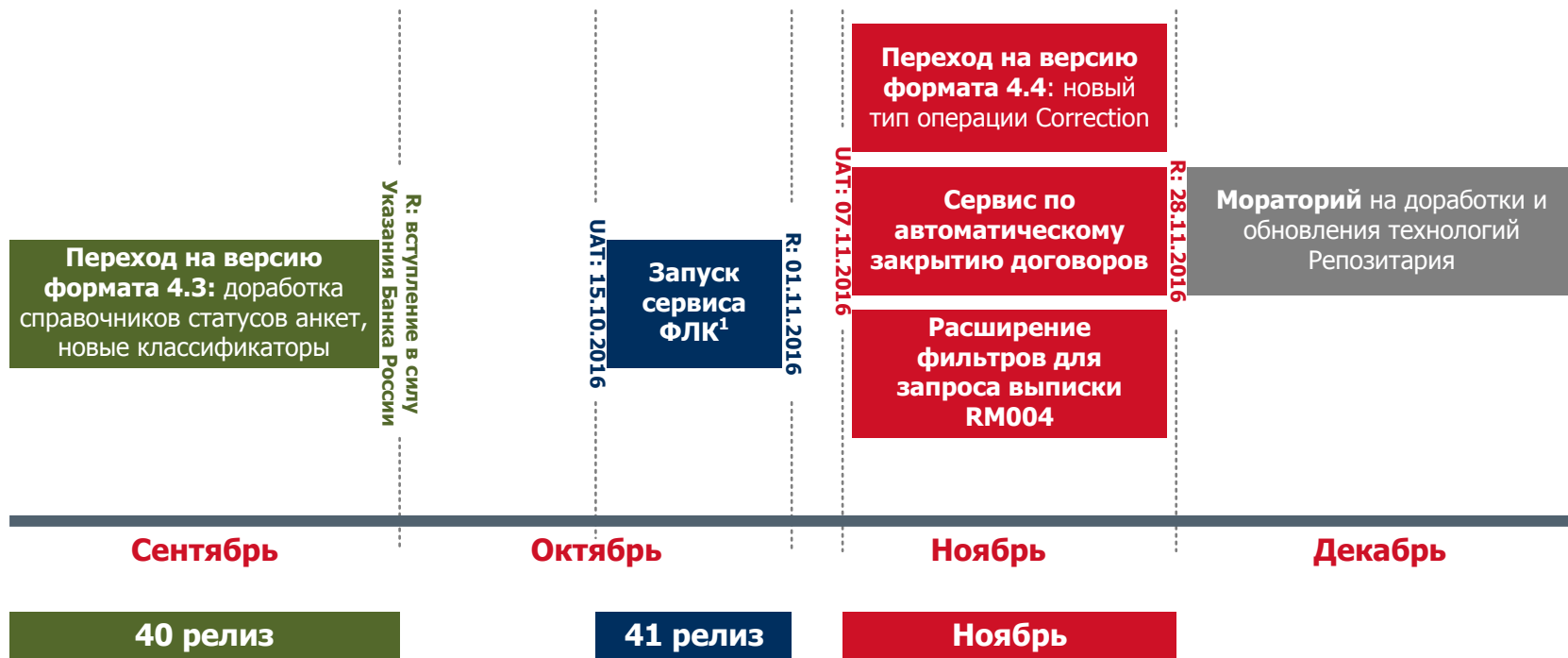


НАЦИОНАЛЬНЫЙ  
РАСЧЕТНЫЙ  
ДЕПОЗИТАРИЙ  
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

24.08.2016

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

# ПЛАН-ГРАФИК РЕАЛИЗАЦИИ ДОРАБОТОК РЕПОЗИТАРИЯ НА СЕНТЯБРЬ – ДЕКАБРЬ 2016



40 РЕЛИЗ (ПАТЧ): СХЕМА 4.3 (ОПЦИОНАЛЬНАЯ ДЛЯ УСТАНОВКИ)

## **ВНЕДРЕНИЕ ИЗМЕНЕНИЙ ИЗ УКАЗАНИЯ 4104-У**

### **ОБНОВЛЕНИЕ СПРАВОЧНИКА «ВИД ЭКОНОМИЧЕСКОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ»**

В соответствии с Приложением 1 Таблица 1 вводится новый классификатор для Управляющих - Т

### **ОБНОВЛЕНИЕ СПРАВОЧНИКА СТАТУСА ПО ДОГОВОРУ**

В соответствии с Приложением 1 Таблица 2 вводятся новые статусы состояния обязательств по договорам: SO - прекращение обязательств зачетом (неттингом); CCP – прекращение обязательств заменой новым обязательством между каждой из сторон первоначального обязательства и центральным контрагентом; O – договор открыт.

### **ОБНОВЛЕНИЕ СПРАВОЧНИКА ВАЛЮТ**

Для валюты белорусский рубль добавляется новый код – BYN. Текущие значения валют: BYR (до деноминации), BYN (после деноминации)

41 РЕЛИЗ (ПАТЧ): СХЕМА 4.4 (ОБЯЗАТЕЛЬНАЯ ДЛЯ УСТАНОВКИ)

## **ДОПОЛНИТЕЛЬНЫЕ ДОРАБОТКИ**

### **НОВЫЙ ТИП ОПЕРАЦИИ В РЕПОЗИТАРИИ**

Добавление нового типа операции Correction для автоматизации внесения изменений в закрытый договор в реестре. Ранее сервис осуществлялся с помощью подачи бумажного заявления в Репозитарий.

### **АВТОМАТИЧЕСКОЕ ЗАКРЫТИЕ ДОГОВОРА**

Разработка механизма для автоматического перевода договора в статус – Т после истечения 3-х рабочих дней с даты endAgreementdate.

### **ДОПОЛНИТЕЛЬНЫЕ ФИЛЬТРЫ В ВЫПИСКЕ RM004**

В запросе выписки RM004 добавляются новые фильтры:

- Контрагент (сторона по сделке)
- Номер документа (действующий фильтр, меняется логика)
- Тип документа (форма анкеты)
- Статус сделки (состояние обязательств по договору)

### **ПРЕКРАЩЕНИЕ РЕПОЗИТАРНЫХ ПРОЦЕССОВ В ПО «ЛУЧ»**

В дату последнего обновления схемы форматов будет отключен режим авто импорт/экспорт в ПО «ЛУЧ»

41 РЕЛИЗ (ПАТЧ): СХЕМА 4.4 (ОБЯЗАТЕЛЬНАЯ ДЛЯ УСТАНОВКИ)

## **ОПЕРАЦИЯ «CORRECTION»**

### **1. ТИПЫ ОПЕРАЦИЙ ДЛЯ ИЗМЕНЕНИЙ**

- AMENDMENT – для открытых договоров
- CORRECTION – для deregistrрованных договоров

### **2. УЧАСТНИКИ**

- Клиент
- Информирующее лицо

### **3. ДОСТУПНЫЕ ОПЕРАЦИИ**

- Изменение договора
- Изменение статуса договора с помощью анкеты СМ093

### **4. ТАЙМИНГ**

- 3 рабочих дня от даты deregистрации договора в реестре договоров

### **5. ПОРЯДОК СОГЛАСОВАНИЯ/ИНФОРМИРОВАНИЯ СТОРОН**

- Текущий процесс согласования
- Извещение о регистрации изменений RM001 направляется Клиенту и его Информирующему лицу (если инициатор - Клиент)

# 41 РЕЛИЗ (ПАТЧ): СХЕМА 4.4 (ОБЯЗАТЕЛЬНАЯ ДЛЯ УСТАНОВКИ) **АВТОМАТИЧЕСКОЕ ЗАКРЫТИЕ ДОГОВОРОВ**

## **1. ПОРЯДОК ЗАПОЛНЕНИЯ ПРИЗНАКА В АНКЕТЕ**

- Первичная регистрация
- Изменение договора
- Значение – «Y»
- Наличие даты в поле «endAgreementDate»

## **2. ДЕАКТИВАЦИЯ АВТОМАТИЧЕСКОГО ЗАКРЫТИЯ**

- Изменение статуса договора, отличного от «O» до даты автоматического закрытия

## **3. ТАЙМИНГ**

- Автоматическое закрытие произойдет на 3-ий рабочий день от даты «endAgreementDate»

## **4. ПОРЯДОК СОГЛАСОВАНИЯ/ИНФОРМИРОВАНИЯ СТОРОН**

- Текущий процесс согласования
- Извещение о deregистрации договора RM001 направляется Информирующим лицам

## ФОРМАТНО-ЛОГИЧЕСКИЙ КОНТРОЛЬ (I)

### СРОК ОТЧЕТНОСТИ

- Дата сделки – Дата записи в ЖУС / в реестре (опер. день)
- Дата отчитываемого события – Дата записи в ЖУС / в реестре (опер. день)
- Дата отказа – Дата записи повторного сообщения в ЖУС (опер. день):  
Номер UTI – критерий взаимосвязи сообщений участника

Пример текста в уведомлении: Разница между «Дата (операционный день) регистрации сообщения в журнале входящих сообщений.» и «Дата сделки.» не должна превышать 3 РАБОЧИХ дня. Reg\_date (ЖУС) -  
fpml:trade/fpml:tradeHeader/fpml:tradeDate <= 3 РАБОЧИХ дня

### ОТКЛОНЕНИЕ ПРОЦЕНТНОЙ СТАВКИ

- Отклонение процентной ставки рассчитанной по формуле

Условие:

- Возможно вычислить процентную ставку по суммам 1 и 2 частям сделки
- Одинаковая валюта
- Рассчитанная ставка не должна отличаться от вычисляемой более чем на 0,1%



41 РЕЛИЗ (ПАТЧ): СХЕМА 4.4 (ОБЯЗАТЕЛЬНАЯ ДЛЯ УСТАНОВКИ)  
**ФОРМАТНО-ЛОГИЧЕСКИЙ КОНТРОЛЬ (II)**

### ОТКЛОНЕНИЕ ОТ ОФИЦИАЛЬНОГО КУРСА

- Отклонение от официального курса иностр. валюты Банка России

Условие:

- Валютные инструменты
- Сопоставление расчетного курса по 1 и 2 частям сделки с официальным курсом Банка России
- Допускается отклонение в пределах 10%





# 41 РЕЛИЗ (ПАТЧ): СХЕМА 4.4 (ОБЯЗАТЕЛЬНАЯ ДЛЯ УСТАНОВКИ) **ФОРМАТНО-ЛОГИЧЕСКИЙ КОНТРОЛЬ (III)**

## **1. ПОРЯДОК ПОДКЛЮЧЕНИЯ/ОТКЛЮЧЕНИЯ СЕРВИСА**

- Анкета СМ018 по одному из репозитарных кодов

## **2. УЧАСТНИКИ**

- Информирующее лицо

## **3. ОТЧЕТНОСТЬ**

- Отчет о контроле в сообщении RM006 при записи ЖУС
- Отчет о контроле в сообщении RM006 при записи в реестре договоров
- Маркирование сообщений/договоров в интерфейсе Web-кабинета

## **4. ТАРИФ**

- 3 000 руб./мес.
- Подключение всех репозитарных кодов Информирующего лица

**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 (б) 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 (б) 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.