



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА



06.09.2017

**Рабочая группа по
технологическим вопросам при
Комитете пользователей
репозитарных услуг**

ПЛАН-ГРАФИК РЕАЛИЗАЦИИ ДОРАБОТОК ПО РЕПОЗИТАРИЯ НА СЕНТЯБРЬ – ДЕКАБРЬ 2017



UAT: 08.08.2017 – дата начала опытной эксплуатации (тестирования)

R: 04.09.2017 – дата ввода изменений в промышленную эксплуатацию

РАНЕЕ В 2017 БЫЛИ ДОРАБОТАНЫ

- | | |
|--------------------|---|
| 42 релиз (февраль) | • разработка криптосервиса для WEB-кабинета |
| 43 релиз (март) | • публикация обобщенных показателей Репозитария |
| 44 релиз (май) | • передача информации о клиентах сторон |
| 45 релиз (июнь) | • передача информационных сообщений в WEB-кабинет |

Комментарий

Разработано [описание](#) доработок ПО Репозитария в 2017

ТЕКУЩИЕ ДОРАБОТКИ РЕПОЗИТАРИЯ (I)

ПЕРЕДАЧА СПРАВОЧНИКА УЧАСТНИКОВ ЧЕРЕЗ ФШ (04.09)

- Выгрузка Справочника каждый рабочий день в 0:30 (в т.ч. по запросу)
- Формат выгрузки XML и CSV
- В Справочник добавлена колонка "Резидент" РФ <Y/N>

РАЗГРАНИЧЕНИЕ ПРАВ ПОЛЬЗОВАТЕЛЯ В КАБИНЕТЕ (04.09)

- Введение нового варианта полномочий №10 в доверенности ЭДО
- Текущие пользователи – админы с действующими полномочиями
- Новые пользователи – админы (с 04.09) с полномочием №10

ИЗМЕНЕНИЕ РЕГЛАМЕНТА ОПЕРАЦИОННОГО ДНЯ (25.09)

- Операционный день = рабочий день с 0:00 до 23:59:59 (MSK)
- Отправка ежедневных отчетов после смены операционного дня
- Автоматическое закрытие договоров до смены операционного дня

ПОВЫШЕНИЕ ИНФОРМАТИВНОСТИ СООБЩЕНИЙ (25.12)

- В рамках доработки проходит аналитика соответствия причин отказов и текста формулировок в Извещениях об отказах (RM002)

ТЕКУЩИЕ ДОРАБОТКИ РЕПОЗИТАРИЯ (II)

РАЗВИТИЕ СЕРВИСА ФЛК (30.10)

- Введение контролей по инициативе Банка России, вызывающих отказы в обработке
- Доработка контролей, вызывающих отказы в обработке
- Дополнительные уведомительные контроли в рамках платного сервиса

КОНТРОЛИ, ВЫЗЫВАЮЩИЕ ОТКАЗЫ

- **РЕПО (СМ041)**
 - ✓ Тип срока OPEN – контроль заполнения поля Валюта суммы расчетов второй части
 - ✓ Дата поставки второй части \geq Дата поставки первой части
 - ✓ Валюта расчетов первой части = Валюта расчетов второй части
- **Валютные (СМ021, СМ022, СМ023, СМ024)**
 - ✓ Корректное указание валютной пары в анкетах договоров (валюты не совпадают)
 - ✓ Дата начала наблюдения $= <$ Дата конца наблюдения (СМ024)
- **Опционы (СМ023, СМ024, СМ033, СМ034, СМ044, СМ045, СМ048, СМ052, СМ054, СМ072)**
 - ✓ Корректное соответствие информации в анкете о стороне Покупателе/Продавце договора и Плательщике/Получателе премии по опциону
- **Анкеты СМ021, СМ022, СМ023, СМ071**
 - ✓ Корректное соответствие Метода расчетов (С,Р) с указанным Типом продукта
- **Все анкеты**
 - ✓ Корректное заполнение реквизитов стороны– не клиента Репозитария
 - ✓ Соответствие Типа продукта и Кода классификации ПФИ
 - ✓ Положительные значения в суммах, включая нулевые

ТЕКУЩИЕ ДОРАБОТКИ РЕПОЗИТАРИЯ (III)

КОНТРОЛИ, ВЫЗЫВАЮЩИЕ ОТКАЗЫ

- ✓ Проверка кода ПФИ на количество и состав символов для выбранной анкеты в соответствии с 4104-У (Прил. 3)
 - Исключение для UKNW – анкеты свопов, форвардов
- ✓ Премия опциона не превышает номинальную сумму договора
- ✓ Корректное заполнение кол-во акций: Лот актива=Кол-во опционов*Объем опциона для CM048
- ✓ Дата сделки =< Дата поставки для CM041, CM042, CM046, CM051
- ✓ Корректное заполнение процентной ставки (десятичная дробь)
 - Допустимое значение от -2 до 2 (200%) для CM031-CM034, CM041-CM045, CM061, CM062, CM071, CM072
- ✓ Корректное заполнение цены облигации в процентах (не в виде десятичной дроби)
 - Допустимые значения от +(-) 200 до +(-) 5 для CM041-CM045
- ✓ Корректное заполнение номинальной суммы в CM043, CM045
 - Поиск номинала облигации в ЦЦ НРД по идентификатору ценной бумаги
- ✓ Корректное заполнение реквизитов клиента стороны (по маске кода):
 - P + RU = PASS_ или SNILS_
 - L или F + RU = LEI_ или INN_
 - P + не RU = OWN_ или PASS_
 - L или F + не RU = LEI_ или SWIFT_ или BLOOM_ или THRTR_ или OWN_ или INN_
- ✓ Корректное заполнение наименования для не клиента: не допускается значение NONREF, NONAME и [пробел]

ТЕКУЩИЕ ДОРАБОТКИ РЕПОЗИТАРИЯ (III)

ФЛК – ДОПОЛНИТЕЛЬНЫЕ УВЕДОМИТЕЛЬНЫЕ КОНТРОЛИ (ПЛАТНЫЙ СЕРВИС)

- ✓ Контроль соблюдения сроков отчетности о состоянии обязательств СМ093
 - Анализ дат исполнения договора
 - Отчет в начале дня (Т+3) со списком договоров
- ✓ Контроль соблюдения сроков отчетности Справедливой стоимости
 - Анализ открытых договоров в отчетном периоде и наличии СМ094 по договору
 - Отчет в начале дня (Т+4) со списком договоров
- ✓ Проверка на дубликат сообщения при указании разных UTI
- ✓ Отклонение цены БА на >20% для СМ042-48 (кроме СМ045)
 - Поиск номинала облигации в ЦЦ НРД по идентификатору ценной бумаги
- ✓ Контроль Дата погашения облигации <= Дата расчетов/истечения для СМ041-СМ044
 - Поиск информации по облигации в ЦЦ НРД по идентификатору ценной бумаги
- ✓ Контроль заполнения процентной ставки (десятичная дробь) от -1 до 1 (100%) для СМ031-СМ034, СМ041-СМ045, СМ061, СМ062, СМ071, СМ072
- ✓ Контроль Дата окончания срока действия договора < Дата расчетов/истечения
- ✓ Контроль на нулевые значения в суммах
- ✓ Контроль на значения в суммах, превышающие астрономические значения, текущая настройка < 1 трл. руб. (по официальному курсу ЦБ на дату сделки)
- ✓ Контроль значения премии опциона к номинальной сумме договора: <25%
- ✓ Разработка сводного отчета о сработавших контролях в интерфейсе WEB-кабинета

ДОРАБОТКИ В 2017-2018 ГОДУ

РАЗВИТИЕ СОПУТСТВУЮЩИХ УСЛУГ

АНАЛИТИЧЕСКАЯ ИНФОРМАЦИЯ

- Раскрытие на сайте обобщенных показателей за период (новое Указание Банка России)
- Расчет аналитических показателей по запросу участников (платный сервис)

РЕФОРМА РЫНКА ПФИ – ВВЕДЕНИЕ ОБЯЗАТЕЛЬНОГО МАРЖИРОВАНИЯ В 2018

- Расчет пороговых значений для начала обязательного маржирования сделок ПФИ
- Предложения участников по развитию сопутствующих сервисов Репозитария

РАЗВИТИЕ УСЛУГ ИНФОРМИРУЮЩЕГО ЛИЦА - НРД

- Аутсорсинг не репозитарной отчетности в Банк России
- Передача первичной документации о договорах в НРД для отчетности в Репозитарий
- Делегирование всей отчетности по договорам по аналогии с сервисами СУО
- Расчет и отчетность справедливой стоимости по договорам в Банк России
- Предложения участников по развитию услуг



ДОРАБОТКИ В 2017-2018 ГОДУ

СТАТУС ДОГОВОРА «SO», BULK-ФОРМАТ

ОДНОВРЕМЕННАЯ ЗАПИСЬ ДВУХ СТАТУСОВ

- Предложение об одновременной записи Статусов «SO» и «T» по договору
- Ответ Банка России

ДОБАВЛЕНИЕ КОДА «SO» В BULK-ФОРМАТ

- Доработка текущего функционала по добавлению статуса «SO»

ДОРАБОТКА ФОРМАТА

- Предложение о внедрении новых признаков для отнесения клиентов сторон к buyer-seller. Пример в сообщении: `client i="SNILS_000-000-000 01" t="P" n="Иванов ИИ" c="RU" s="B (или) S"/>`
- Согласование изменений в текущей схеме на 2018 – приемлемые сроки изменений
- SWOT анализ по переходу на новую версию FpML (5.10) (следующий слайд)

ОТЧЕТНОСТЬ НЕРЕЗИДЕНТОВ ПО ГЕНЕРАЛЬНЫМ СОГЛАШЕНИЯМ

- Текущая ситуация – сложившаяся практика
- Позиция Репозитария



SWOT-АНАЛИЗ

S

- Контроль изменений в новых версиях
- Использование новых фичей формата
- Замена кастомных полей НРД в блоке nsdSpecificFields на поля, которые присутствуют в новой версии
- Постоянная оптимизация действующего формата отчетности

W

- Формат не распространен во внутренних системах участников
- Отсутствие драйверов для внедрения формата
- Слабое продвижение формата ISDA в Европе для целей подтверждения сделок и их отчетности в Репозитории

O

- Развитие формата для нужд локального рынка по запросу участников
- Участие в Рабочей группе разработчика формата ISDA
- Возможные требования по внедрению новой версии формата на уровне Указания Банка России

T

- Дополнительные расходы на ежегодный переход на новую версию формата на стороне НРД и, возможно, участников

ОБСУЖДЕНИЕ ВОПРОСОВ

ПЛАНЫ РАЗВИТИЯ В 2018

ЦЕНТРАЛИЗОВАННАЯ МЭТЧИНГОВАЯ ПЛАТФОРМА

- Создание центральной мэтчинговой платформы для OTC сделок с использованием технологий репозитарной системы
- Мнение участников

ПРОЧИЕ ВОПРОСЫ

- Вопросы участников

**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.