

**Небанковская кредитная организация закрытое акционерное общество
«Национальный расчетный депозитарий»
(НКО ЗАО НРД)**

ПРОТОКОЛ № 1/2014

**заседания Комитета по репозитарной деятельности при Правлении НКО ЗАО НРД
(Комитет)**

Форма проведения заседания: совместное присутствие членов Комитета для голосования по вопросам повестки дня и принятия решений по вопросам, поставленным на голосование.

Дата проведения заседания: 20 февраля 2014 года

Место проведения заседания: г. Москва, ул. Спартаковская, дом 12

Время проведения заседания: 13:00 - 15:00 часов московского времени

Дата составления протокола: 21 февраля 2014 года

Члены Комитета, присутствовавшие на заседании:

1	Спыну Руслан Константинович
2	Пархоменко Евгения Сергеевна
3	Глушкова Ольга Вадимовна
4	Грицаюк Ольга Юрьева
5	Корсун Евгения Яковлевна
6	Ли Александр Романович
7	Преснякова Марина Игоревна
8	Бральнин Александр Владимирович
9	Фрадкина Елена Валерьевна
10	Усачева Арина Львовна

Члены Комитета, предоставившие письменное мнение по вопросам повестки дня:

1	Четверухин Александр Алексеевич
---	---------------------------------

Члены Комитета, отсутствовавшие на заседании:

1	Борзунова Эльвира Геннадиевна
2	Воропаева Евгения Михайловна
3	Жданкин Сергей Николаевич
4	Козырева Кира Владимировна
5	Корженевская Елена Владимировна
6	Орлов Алексей Константинович
7	Рябцева Екатерина Александровна
8	Салов Дмитрий Владимирович
9	Чумаков Алексей Сергеевич
10	Юрятина Виктория Викторовна

Заседание Комитета созвано в соответствии с п. 6.1. Положения о Комитете Председателем Комитета Спыну Р.К.

Число членов Комитета, присутствовавших на заседании, составило не менее половины от числа избранных членов Комитета. В соответствии с пунктом 6.5. Положения о Комитете кворум для проведения заседания имелся.

Приглашенные:

Шитикова О.Е.	Начальник управления СРО НФА
Смылова И.	ОАО АКБ «Связь-Банк»
Михайляк С.В.	Начальник Управления репозитарных операций НКО ЗАО НРД
Исаева Ю.И.	Главный специалист Отдела сопровождения клиентов НКО ЗАО НРД, Секретарь Комитета
Беляев В.И.	Главный специалист отдела разработки и сопровождения продуктов НКО ЗАО НРД
Лукьянчик В.В.	Руководитель проектов НКО ЗАО НРД
Костюкова Е.	Менеджер по проектам ООО «Барклайс Капитал»
Соловьев П.Ю.	Управляющий директор по репозитарной деятельности НКО ЗАО НРД
Ильина Я.М.	Главный специалист Управления развития репозитарной деятельности

Повестка дня заседания:

1. Утверждение согласованных Рабочей группой по технологическим вопросам рекомендаций-правил заполнения формата сообщений репозитория НРД по первому блоку отчетности.
2. Дополнение рекомендаций уточнениями:
 - Уточнение для договора валютный своп в части определения типа договора: «договор валютный своп, заключенный на основании Стандартной документации по срочным сделкам на российском финансовом рынке или стандартной документации ISDA, рекомендуется признавать производным финансовым инструментом»
 - Уточнение для определения коэффициента для расчета количества дней в процентном периоде в отношении договора репо: «в частности, в случае указания коэффициента для расчета количества дней в процентном периоде, характеризующем отношение фактического количества дней в процентном периоде к фактическому количеству дней в году, в отношении договора репо рекомендуется указывать значение «ACT/ACT.ICMA» - до внесения изменений в справочник соответствующих значений, предусматривающих иные допустимые варианты».
 - Уточнение определения параметра marginFactor формата продуктового блока для договора репо: «Начальный коэффициент обеспечения, под которым по умолчанию понимается величина, выраженная в процентах, отражающая отношение суммы денежных средств, подлежащей уплате по первой части договора репо, к стоимости ценных бумаг, являющихся предметом договора репо, рассчитанной исходя из цены договора репо. В общем случае соответствует значению, равному отношению разницы 100% и значения дисконта по договору к 100%. Значение указывается в форме десятичной дроби с точностью до 7 знаков после запятой».
3. Утверждение согласованного плана-графика разработки и согласования рекомендаций-правил заполнения формата сообщений репозитория НРД, порядка тестирования отдельных групп инструментов.
4. Согласование участниками Комитета проекта запроса в Банк России, сроков и порядка направления согласованного запроса регулятору.
5. Согласование новой схемы отправки счетов – счет, выставленный на основной код участника – клиента репозитория, направляется на один репозитарный код, указанный участником в анкете.
6. Обсуждение вопроса де-регистрации генерального соглашения с контрагентом, у которого отозвана лицензия.
7. Утверждение регламента работы Комитета по репозитарной деятельности.

Вопрос 1 повестки дня:

Утверждение согласованных Рабочей группой по технологическим вопросам рекомендаций-правил заполнения формата сообщений репозитория НРД по первому блоку отчетности.

Общее число членов Комитета – 21.

Число членов Комитета, принявших участие в заседании по вопросу повестки дня и проголосовавших – 11.

Кворум для принятия решения имелся.

Слушали: П.Ю. Соловьева, осветившего вопрос необходимости утверждения рекомендаций-правил заполнения формата сообщений по первому блоку отчетности.

Выступили: Соловьев П.Ю.
Преснякова М.И.
Пархоменко Е.С.
Костюкова Е.
Усачева А.Л.
Бральнин А.В.
Смылова И.
Спыну Р.К.

Обсуждалось:

- 1) Утверждение представленных рекомендаций-правил заполнения формата сообщений по первому блоку отчетности для технических специалистов и бизнес-аналитиков, в дальнейшем предоставление упрощенного варианта рекомендаций-правил для специалистов бэк-офиса;
- 2) Добавление в рекомендации-правила двух колонок: правила валидации, формат поля;
- 3) Процедура утверждения рекомендаций-правил: обсуждение и утверждение на Рабочей группе и Комитете по репозитарной деятельности; после утверждения размещение на сайте НКО ЗАО НРД; параллельно размещение на специальном разделе форума сайте НКО ЗАО НРД для обсуждения.

Вопросы, поставленные на голосование:

- 1) Утвердить предоставленный вариант рекомендаций-правил по первому блоку отчетности. Разместить рекомендации-правила на сайте для дальнейшего обсуждения на форуме сайта НКО ЗАО НРД.

Итоги голосования:

«за» - 11;
«против» - нет;
«воздержался» - нет.

Решение принято.

Принятое решение:

- 1) Утвердить предоставленный вариант рекомендаций-правил по первому блоку отчетности. Разместить рекомендации-правила на сайте НКО ЗАО НРД для дальнейшего обсуждения на форуме сайта НКО ЗАО НРД.

Вопрос 2 повестки дня:

Дополнение рекомендаций уточнениями:

- Уточнение для договора валютный своп в части определения типа договора: «договор валютный своп, заключенный на основании Стандартной документации по срочным сделкам на российском финансовом рынке или стандартной документации ISDA, рекомендуется признавать производным финансовым инструментом»
- Уточнение для определения коэффициента для расчета количества дней в процентном периоде в отношении договора репо: «в частности, в случае указания коэффициента для расчета количества дней в процентном периоде, характеризующем отношение фактического количества дней в процентном периоде к фактическому количеству дней в году, в отношении договора репо

рекомендуется указывать значение «АСТ/АСТ.ИСМА» - до внесения изменений в справочник соответствующих значений, предусматривающих иные допустимые варианты».

- Уточнение определения параметра marginFactor формата продуктового блока для договора репо: «Начальный коэффициент обеспечения, под которым по умолчанию понимается величина, выраженная в процентах, отражающая отношение суммы денежных средств, подлежащей уплате по первой части договора репо, к стоимости ценных бумаг, являющихся предметом договора репо, рассчитанной исходя из цены договора репо. В общем случае соответствует значению, равному отношению разницы 100% и значения дисконта по договору к 100%. Значение указывается в форме десятичной дроби с точностью до 7 знаков после запятой».

Общее число членов Комитета – 21.

Число членов Комитета, принявших участие в заседании по вопросу повестки дня и проголосовавших – 11.

Кворум для принятия решения имелся.

Слушали: П.Ю. Соловьева, озвучившего дополнения и уточнения к рекомендациям-правилам.

Выступили: Соловьев П.Ю.

Смыслова И.

Спыну Р.К.

Пархоменко Е.С.

Преснякова М.И.

Костюкова Е.

Ли А.Р.

Михайляк С.В.

Обсуждалось:

- 1) Утверждение уточнений и дополнений к рекомендациям-правилам;
- 2) Внесение изменений в процедуры репозитария относительно кода ПФИ – поле код ПФИ является обязательным полем для заполнения, но не является сверяемым полем при квитовке анкет (для любого способа квитовки);
- 3) Возможность одновременного проведения внутреннего и внешнего (опытная эксплуатация) тестирования;
- 4) Возможность внедрения более частого периода релизов для текущих исправлений;
- 5) Вопрос разработки и внедрения второго тестового контура.

Вопросы, поставленные на голосование:

1. Вынести на заочное голосование:

- вопрос утверждения дополнений и уточнений к рекомендациям-правилам;

- вопрос оптимальной периодичности будущих релизов, связанных с корректировкой схемы.

Итоги голосования: «за» - 11;
«против» - нет;
«воздержался» - нет.

Решение принято единогласно членами Комитета.

Принятое решение:

1. Вынести на заочное голосование:
 - вопрос утверждения дополнений и уточнений к рекомендациям-правилам;
 - вопрос оптимальной периодичности будущих релизов, связанных с корректировкой схемы.

Вопрос 3 повестки дня:

Утверждение согласованного плана-графика разработки и согласования рекомендаций-правил заполнения формата сообщений репозитория НРД, порядка тестирования отдельных групп инструментов.

Общее число членов Комитета – 21.

Число членов Комитета, принявших участие в заседании по вопросу повестки дня и проголосовавших – 11.

Кворум для принятия решения имелся.

Слушали: П.Ю. Соловьева, озвучившего план-график разработки рекомендаций-правил заполнения формата сообщений, а также порядок тестирования отдельных групп инструментов.

Выступили: Соловьев П.Ю.

Бральнин А.В.

Усачева А.Л.

Смыслова И.

Обсуждалось:

- 1) Утверждение плана-графика разработки рекомендаций-правил заполнения формата сообщений;
- 2) Утверждение порядка тестирования отдельных групп инструментов;
- 3) Необходимость добавить в план-график product id, а также цифровое обозначение формы анкеты.

Вопросы, поставленные на голосование:

- 1) Утверждение плана-графика разработки рекомендаций-правил заполнения форматов
- 2) Утверждение порядка тестирования отдельных групп инструментов.

Итоги голосования: «за» - 11;
«против» - нет;
«воздержался» - нет.

Решение принято единогласно членами Комитета.

Принятое решение:

- 1) Утверждение плана-графика разработки рекомендаций-правил заполнения форматов
- 2) Утверждение порядка тестирования отдельных групп инструментов.

Вопрос 4 повестки дня:

Согласование участниками Комитета проекта запроса в Банк России, сроков и порядка направления согласованного запроса регулятору.

Общее число членов Комитета – 21.

Число членов Комитета, принявших участие в заседании по вопросу повестки дня и проголосовавших – 11.

Кворум для принятия решения имелся.

Слушали: П.Ю. Соловьева, озвучившего финальную версию запроса в ЦБ РФ, а также порядок направления запроса в ЦБ РФ.

Выступили: Соловьев П.Ю.

Смыслова И.

Спыну Р.К.

Грицаюк О.Ю.

Пархоменко Е.С.

Обсуждалось:

- 1) Исключить из финальной версии запроса вопросы о квартальном отчете;
- 2) В случае необходимости/актуальности направить отдельный запрос в адрес ЦБ РФ с вопросами по квартальному отчету;
- 3) Направить запрос в адрес ЦБ РФ не позднее 28 февраля 2014 года.

Вопросы, поставленные на голосование:

- 1) Исключение из финальной версии запроса вопросы о квартальном отчете, утверждение запроса в адрес ЦБ РФ;
- 2) Направление запроса в адрес ЦБ РФ не позднее 28 февраля 2014 года.

Итоги голосования: «за» - 11;
«против» - нет;
«воздержался» - нет.

Решение принято единогласно членами Комитета.

Принятое решение:

- 1) Исключение из финальной версии запроса вопросы о квартальном отчете, утверждение запроса в адрес ЦБ РФ;
- 2) Направление запроса в адрес ЦБ РФ не позднее 28 февраля 2014 года.

Вопрос 5 повестки дня:

Согласование новой схемы отправки счетов – счет, выставленный на основной код участника – клиента репозитария, направляется на один репозитарный код, указанный участником в анкете.

Общее число членов Комитета – 21.

Число членов Комитета, принявших участие в заседании по повестке дня и проголосовавших – 11.

Кворум для принятия решения имелся.

Слушали: П.Ю. Соловьева, озвучившего результаты голосования участников рабочей группы и комитета по репозитарной деятельности по новой схеме отправки счетов клиентам.

Выступили: Соловьев П.Ю.
Костюкова Е.

Обсуждалось:

- 1) Новый порядок выставления счетов клиентам, а именно, счет выставляется на основной код участника-клиента репозитарий, направляется на один репозитарный код, указанный участником в анкете.
- 2) Возможность в дальнейшем доработки системы биллинга – выставление счетов по репозитарным кодам участника.

Вопросы, поставленные на голосование:

- 1) Утвердить новую схему отправки счетов – счет выставляется на основной код клиента репозитария, направляется на один репозитарный код, выбранный клиентом в анкете.

Итоги голосования: «за» - 11;
«против» - нет;
«воздержался» - нет.

Решение принято единогласно членами Комитета.

Принятое решение:

- 1) Утвердить новую схему отправки счетов – счет выставляется на основной код клиента репозитария, направляется на один репозитарный код, выбранный клиентом в анкете.

Вопрос 6 повестки дня:

Обсуждение вопроса де-регистрации генерального соглашения с контрагентом, у которого отозвана лицензия.

Общее число членов Комитета – 21.

Число членов Комитета, принявших участие в заседании по повестке дня и проголосовавших – 11.

Кворум для принятия решения имелся.

Слушали: Михайляк С.В, озвучившую возникшую у участника проблему с дерегистрацией ГС с контрагентом, у которого отозвана лицензия.

Выступили: Михайляк С.В.

Соловьев П.Ю.
Ли А.Р.
Спыну Р.К.
Бральнин А.В.
Усачева А.Л.

Обсуждалось:

- 1) Необходимость доработки систем для случаев, когда у контрагента отозвана лицензия и доступа к ЭДО он не имеет. Следовательно, анкеты, направляемые на его репозитарный код, в текущей настройке подтверждены им быть не могут;
- 2) Необходимость проработки данного вопроса с регулятором.

Вопросы, поставленные на голосование:

- 1) Утвердить необходимость доработки текущего регламента, предусмотрев данный случай.

Итоги голосования: «за» - нет;
«против» - 11;
«воздержался» - нет.

Решение принято единогласно членами Комитета.

Принятое решение:

- 1) Не изменять текущей настройки функционирования системы.

Вопрос 7 повестки дня:

Утверждение регламента работы Комитета по репозитарной деятельности.

Общее число членов Комитета – 21.

Число членов Комитета, принявших участие в заседании по вопросу повестки дня и проголосовавших – 11.

Кворум для принятия решения имелся.

Слушали: П.Ю. Соловьева, предложившего новый регламент работы Комитета по репозитарной деятельности.

Выступили: Соловьев П.Ю.
Пархоменко Е.С.
Усачева А.Л.

Обсуждалось:

- 1) Новый временной регламент работы Комитета, а именно каждая третья пятница месяца с 10:00 до 13:00.

Вопросы, поставленные на голосование:

- 1) Утвердить новый временной регламент работы Комитета по репозитарной деятельности – каждая третья пятница месяца с 10:00 до 13:00.

Итоги голосования: «за» - 11;
«против» - нет;
«воздержался» - нет.

Решение принято единогласно членами Комитета.

Принятое решение:

- 1) Утвердить новый временной регламент работы Комитета по репозитарной деятельности – каждая третья пятница месяца с 10:00 до 13:00.

**Председатель Комитета по
репозитарной деятельности при
Правлении НКО ЗАО НРД**

Р.К.Спыну