

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

ПРОТОКОЛ № 6/2013

**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: 14 октября 2013 года

Место проведения заседания: г. Москва, ул. Воздвиженка, дом 4/7

Время проведения заседания: 14:00 - 18:20 часов московского времени

Дата составления протокола: 14 октября 2013 года

Члены Комитета, присутствовавшие на заседании:

1. Спыну Руслан Константинович
2. Акчурина Алина Фатиховна
3. Борзунова Эльвира Геннадиевна
4. Глушкова Ольга Вадимовна
5. Ли Александр Романович
6. Преснякова Марина Игоревна
7. Рябцева Екатерина Александровна
8. Соловьев Павел Юрьевич
9. Фрадкина Елена Валерьевна
10. Четверухин Александр Алексеевич
11. Корженевская Елена Владимировна
12. Козырева Кира Владимировна
13. Юрятина Виктория Викторовна
14. Жданкин Сергей Николаевич

Члены Комитета, отсутствовавшие на заседании:

1. Орлов Алексей Константинович
2. Ильинская Ольга Александровна
3. Салов Дмитрий Владимирович
4. Чумаков Алексей Сергеевич
5. Воропаева Евгения Михайловна
6. Грицаюк Ольга Юрьевна

Заседание Комитета создано 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:

Семина А.П.	Директор Департамента нормативно-технологического обеспечения НКО ЗАО НРД
Чумаченко А.В.	Советник Председателя Правления НКО ЗАО НРД
Дадашева О.Ю.	Советник Председателя Правления НКО ЗАО НРД
Ненахова Е.С.	Начальник отдела развития финансовых рынков Управления развития рынков и инфраструктуры Департамента финансовой стабильности Банка России
Лангуш М.Н.	Вице-Президент по развитию и работе с клиентами
Кумирова Т.Д.	Зам. начальника управления, начальник отдела сопровождения клиентов, Секретарь Комитета
Михайляк С.В.	Начальник Управления репозитарных операций НКО ЗАО НРД
Филимоненкова Ю.В.	Главный специалист Отдела сопровождения клиентов НКО ЗАО НРД
Беляев В.И.	Главный специалист отдела разработки и сопровождения продуктов НКО ЗАО НРД
Травин Я.О.	Зам начальника операционного управления по вопросам контроля и управления операционными рисками, ЗАО "БАНК КРЕДИТ СВИСС (МОСКВА)"

Повестка дня заседания:

1. Основные направления совершенствования законодательства и нормативных документов, регулирующих репозитарную деятельность в России. Работа НРД с регуляторами.
Докладчик: О.Ю. Дадашева.
2. Об отчетности по внебиржевым сделкам РЕПО и валютный своп с Банком России, по которым НРД не выполняет функции Базового информирующего лица.
Докладчик: П.Ю. Соловьев.
3. Порядок развития формата сообщений репозитария НРД: периодичность изменений и дополнений спецификации формата; переход на новые версии FrML, интеграция расширений НРД в официальную спецификацию FrML. Согласование предложенного варианта (материал направлялся ранее, прилагается).
Докладчик: П.Ю. Соловьев.
4. Процедура регистрации сообщений с согласованием по умолчанию. Одобрение предложенной процедуры. Согласование внесения дополнений в условия репозитарной деятельности и справочник формата (материал направлялся ранее, прилагается).
Докладчик: П.Ю. Соловьев.

5. Письмо ISDA с рекомендациями о внесении изменений и дополнений в процедуры и формат репозитария. Согласование рекомендаций для целей реализации в репозитарии НРД, определение приоритетов (прилагается).
Докладчик: П.Ю. Соловьев.
6. Встречная квитанка сообщений о статусах обязательств и исполнении, квартального отчета. Рекомендации по заполнению формата (без сопроводительных материалов).
Докладчик: П.Ю. Соловьев.
7. Разное:
 - Качество операционной поддержки тестирования отчетности в репозитарий со стороны НРД;
 - Порядок присвоения репозитарных кодов участникам.
Предложение ограничить количество присваиваемых кодов одним (одно юр. лицо = один репозитарный код);
 - О квитанке значений кода российской валюты: RUB и RUR;
 - О заполнении и обработке сообщений в репозитарий в случае отсутствия репозитарного соглашения у второй стороны;
 - О целесообразности изменения сортировки анкеты с одинаковыми параметрами для целей мэтчинга с варианта LIFO на FIFO;
 - Присвоение репозитарного кода филиалам иностранных компаний;
 - Об определении списка полей по типам сделок, изменение которых должно повлечь обязательное направление отчета об таких изменений в Репозитарий.
Стоит ли ограничиться только обязательными полями или необходимо расширить этот список (вопрос для обсуждения).
 - Отчитывание валютных свопов (FX SWAP): как ПФИ или как не-ПФИ.
Изменения в нормативные документы ЦБР, вступающие в силу с 01.01.2014, предполагают отказа от деления сделок на спот, срочные и ПФИ. Ожидается только спот и ПФИ. Необходима ли в таком случае анкета для срочных сделок с делением на ПФИ или не-ПФИ;
 - Варианты коллективного участия участников в нормотворческой деятельности в отношении отчетности в репозитарий;
 - Иное.

Вопрос 1 повестки дня:

Основные направления совершенствования законодательства и нормативных документов, регулирующих репозитарную деятельность в России. Работа НРД с регуляторами.

Общее число членов Комитета – 20.

Число членов Комитета, принявших участие в заседании по вопросу повестки дня и проголосовавших – 14.

Кворум для принятия решения имелся.

Слушали: О.Ю. Дадашеву, осветившую основные направления совершенствования законодательства и нормативных документов, регулирующих репозитарную деятельность в России, в том числе основные тезисы проекта федерального закона о внесении

изменений и дополнений в ФЗ «О рынке ценных бумаг» и ряд иных законодательных актов в части регулирования репозитарной деятельности.

Выступили: Спыну Р.К.

Козырева К.В.

Соловьев П.Ю.

Ненахова Е.С.

Борзунова Э.Г.

Чумаченко А.В.

Преснякова М.И.

Обсуждалось: возможность упразднить необходимость согласованных действий контрагентов при отчетности сделок в рамках выполнения обязательств перед регулятором и установить единые требования к информации в отчете о сделках; необходимость в отношении сделок, попавших в клиринг, установить обязательство клиринговых организаций выступать Информирующими лицами; возможные варианты организации канала общения с регулятором в процессе формирования законодательства и регулирования репозитарной деятельности (рабочие группы, экспертные советы, в рамках ассоциаций).

Вопросы, поставленные на голосование:

Принять к сведению основные направления совершенствования законодательства и нормативных документов, регулирующих репозитарную деятельность в России.

Итоги голосования: «за» - 14;
«против» - нет;
«воздержался» - нет.

Решение принято единогласно членами Комитета.

Принятое решение:

Принять к сведению основные направления совершенствования законодательства и нормативных документов, регулирующих репозитарную деятельность в России.

Вопрос 2 повестки дня:

Об отчетности по внебиржевым сделкам РЕПО и валютный своп с Банком России, по которым НРД не выполняет функции Базового информирующего лица.

Общее число членов Комитета – 20.

Число членов Комитета, принявших участие в заседании по вопросу повестки дня и проголосовавших – 14.

Кворум для принятия решения имелся.

Слушали: П.Ю. Соловьева, озвучившего существующий вопрос относительно отчетности по внебиржевым сделкам РЕПО и валютный своп с Банком России, по которым НРД не выполняет функции Базового информирующего лица, требующей направление информации в репозитарий двумя сторонами, в том числе Банком России как стороной таких сделок.

Выступили: Борзунова Э.Г.

Спыну Р.К.

Вопросы, поставленные на голосование:

1. Поручить НВА составить коллективное письмо с запросом разъяснений по вопросу отчетности по внебиржевым сделкам РЕПО и валютный своп с Банком

России, по которым НРД не выполняет функции Базового информирующего лица, в адрес Банка России. НРД рассмотреть возможность присоединения к данному письму.

Итоги голосования: «за» - 14;
«против» - нет;
«воздержался» - нет.

Решение принято единогласно членами Комитета.

Принятое решение:

1. Поручить НВА составить коллективное письмо с запросом разъяснений по вопросу отчетности по внебиржевым сделкам РЕПО и валютный своп с Банком России, по которым НРД не выполняет функции Базового информирующего лица, в адрес Банка России. НРД рассмотреть возможность присоединения к данному письму.

Вопрос 3 повестки дня:

Порядок развития формата сообщений репозитария НРД: периодичность изменений и дополнений спецификации формата; переход на новые версии GrML, интеграция расширений НРД в официальную спецификацию GrML. Согласование предложенного варианта (материал направлялся ранее, прилагается).

Общее число членов Комитета – 20.

Число членов Комитета, принявших участие в заседании по вопросу повестки дня и проголосовавших – 14.

Кворум для принятия решения имелся.

Слушали: П.Ю. Соловьева, рассказавшего о порядке развития формата сообщений репозитария НРД: периодичность изменений и дополнений спецификации формата; переход на новые версии GrML, интеграция расширений НРД в официальную спецификацию GrML.

Выступили: Четверухин А.А.

Вопросы, поставленные на голосование:

1. Согласовать предложенный вариант с уточнением в части срока вступления в силу изменений – не менее 1 месяца.
2. Рекомендовать НРД уведомлять клиентов об изменении форматов не менее, чем за 1 месяц.

Итоги голосования: «за» - 14;
«против» - нет;
«воздержался» - нет.

Решение принято единогласно членами Комитета.

Принятое решение:

1. Согласовать предложенный вариант с уточнением в части срока вступления в силу изменений – не менее 1 месяца.
2. Рекомендовать НРД уведомлять клиентов об изменении форматов не менее, чем за 1 месяц.

Вопрос 4 повестки дня:

Процедура регистрации сообщений с согласованием по умолчанию. Одобрение предложенной процедуры. Согласование внесения дополнений в условия репозитарной деятельности и справочник формата (материал направлялся ранее, прилагается).

Общее число членов Комитета – 20.

Число членов Комитета, принявших участие в заседании по вопросу повестки дня и проголосовавших – 14.

Кворум для принятия решения имелся.

Слушали: П.Ю. Соловьева, предложившего рассмотреть процедуру регистрации сообщений с согласованием по умолчанию и согласовать внесение дополнений в условия репозитарной деятельности и справочник формата.

Вопросы, поставленные на голосование:

1. Принять процедуру регистрации сообщений с согласованием по умолчанию и согласовать внесение дополнений в условия репозитарной деятельности и справочник формата.
2. Поручить НРД назвать сроки внедрения новой процедуры в документацию и технологии репозитария НРД.

Итоги голосования: «за» - 14;
«против» - нет;
«воздержался» - нет.

Решение принято единогласно членами Комитета.

Принятое решение:

1. Принять процедуру регистрации сообщений с согласованием по умолчанию и согласовать внесение дополнений в условия репозитарной деятельности и справочник формата.
2. Поручить НРД назвать сроки внедрения новой процедуры в документацию и технологии репозитария НРД.

Вопрос 5 повестки дня:

Письмо ISDA с рекомендациями о внесении изменений и дополнений в процедуры и формат репозитария. Согласование рекомендаций для целей реализации в репозитарии НРД, определение приоритетов (прилагается).

Общее число членов Комитета – 20.

Число членов Комитета, принявших участие в заседании по вопросу повестки дня и проголосовавших – 14.

Кворум для принятия решения имелся.

Слушали: П.Ю. Соловьева, предложившего к рассмотрению письмо ISDA с рекомендациями о внесении изменений и дополнений в процедуры и формат репозитария, а также согласовать рекомендации для целей реализации в репозитарии НРД и определить приоритеты (прилагается).

Выступили: Спыну Р.К.
Козырева К.В.
Соловьев П.Ю.
Ненахова Е.С.
Травин Я.О.
Ли А.Р.
Чумаченко А.В.
Преснякова М.И.
Четверухин А.А.

Обсуждалось:

- 1) Тезисы письма ISDA с рекомендациями российским репозитариям.
- 2) Увеличение срока квартальной отчетности на 3 дня либо предоставление Банком России разъяснений, в соответствии с которыми в квартальный отчет включается информация о количестве сделок и оговоренных суммах – по дате заключения сделок, о переданных суммах – по дате расчетов.
- 3) Порядок и сроки изъятия сделок из реестра в случаях неподтвержденных и ошибочно заключенных сделок.

Предложение НРД подготовить письмо с запросом в Банк России.

Вопросы, поставленные на голосование:

1. Предоставление участникам технической возможности отчитываться о сделках FX Swap двумя способами: единой анкетой FX Swap или двумя анкетами FX Single Leg (spot + forward или forward + forward) – и обеспечение квитанки информации, представляемой в репозитарий участниками различными способами;
2. Включение в формат сообщений репозитария НРД дополнительного поля, добавленного в FrML, - поля masterAgreementId – для указания идентификатора генерального соглашения, высвободив поле linkId;
3. Предоставление участникам технической возможности квитанки квартальных отчетов о коротких сделках с отчетами по каждой такой сделке. Выработка рекомендаций по заполнению квартального отчета, в том числе запрос Банку России о продлении срока предоставления квартального отчета на 3 дня;
4. Использование для указания статуса состояния обязательств по сделкам имеющегося элемента в формате FrML – category.
5. Введение дополнительного статуса состояния обязательств по договору, характеризующего отзыв зарегистрированной информации ввиду аннулирования ошибочно заключенного договора.

Итоги голосования:

«за» - 14;

«против» - нет;

«воздержался» - нет.

Решение принято единогласно членами Комитета.

Принятое решение:

1. Рекомендовать обеспечить техническую возможность предоставлять отчетность по сделкам валютный своп двумя способами: в виде единой анкеты FX Swap и в виде двух связанных единым идентификатором анкет FX Single Leg – с обеспечением квитовки направляемых анкет вне зависимости от способа предоставления отчетности. В целях реализации разработать технологическую схему и предоставить членам Комитета на согласование. Утвердить, что в случае использования указанной возможности, правовой характер отчитываемых сделок сохраняется, в том числе за счет указания в анкетах кода продукта валютный своп вне зависимости от способа предоставления информации. Составить письмо в ЦБ РФ с просьбой рассмотреть возможность отчетности по сделкам валютный своп двумя описанными выше способами с вложением разработанной технологической схемы;
2. Одобрить использование в формате сообщений репозитория НРД нового элемента FrML - поля masterAgreementId, высвободив элемент linkId. Проработать вопрос включения данного элемента в схему сообщений в соответствии с согласованным графиком внедрения изменений в формат сообщений репозитория НРД, представив информацию на Рабочую группу по технологическим вопросам при Комитете;
3. Признать предоставление участникам технической возможности квитовки квартальных отчетов о коротких сделках с отчетами по каждой такой сделке на данном этапе технически не реализуемым. Направить в Банк России запрос о предоставлении рекомендаций по заполнению квартального отчета и/или о продлении срока предоставления квартального отчета на 3 дня. Признать необходимость сохранения возможности отчитывать короткие сделки как в форме квартального отчета, так и в форме отчетов по отдельным сделкам. Вынести вопрос о разработке предложений по изменению квартального отчета на Рабочую группу по технологическим вопросам при Комитете с целью формирования предложений регулятору;
4. Признать использование для указания статуса состояния обязательств по сделкам имеющегося элемента в формате FrML – category – технически возможным, но на данном этапе нецелесообразным. Сохранить разработанный механизм отчетности о статусах состояния обязательств по договорам с рекомендацией об указании в одном сообщении информации по одной сделке;
5. Подготовить запрос в Банк России относительно введения дополнительного статуса состояния обязательств по договору, характеризующего отзыв зарегистрированной информации ввиду аннулирования ошибочно заключенного договора. Предложить установить ограничение срока на направление указанного дополнительного статуса до 15-30 дней с момента регистрации договора.

Вопрос 6 повестки дня:

Встречная квитовка сообщений о статусах обязательств и исполнении, квартального отчета. Рекомендации по заполнению формата.

Общее число членов Комитета – 20.

Число членов Комитета, принявших участие в заседании по вопросу повестки дня и проголосовавших – 14.

Кворум для принятия решения имелся.

Слушали: П.Ю. Соловьева, предложившего к рассмотрению вопрос встречной квитанки сообщений о статусах обязательств и исполнении квартального отчета. Рекомендации по заполнению формата.

Обсуждалось:

Внедрение встречного способа квитанки для квартального отчета и отчета о статусах состояния обязательств; предложена реализация комбинированного способа квитанки; Рекомендации Рабочей группы по технологическим вопросам по порядку заполнения квартального отчета (указание количества сделок и оговоренных сумм и объема актива – по дате заключения сделок; указание сумм и количества актива переданных – по дате расчетов) и отчета о статусах состояния обязательств (указание в отчете информации по одной сделке).

Вопросы, поставленные на голосование:

1. Рекомендовать реализовать комбинированный способ квитанки для квартального отчета и отчета о статусах состояния обязательств (в соответствии с рекомендациями Рабочей группы по технологическим вопросам)
2. Учесть рекомендации Рабочей группы по технологическим вопросам по заполнению формата указанных отчетов.

Итоги голосования:

«за» - 14;

«против» - нет;

«воздержался» - нет.

Решение принято единогласно всеми членами Комитета.

Принятое решение:

1. Рекомендовать реализовать комбинированный способ квитанки для квартального отчета и отчета о статусах состояния обязательств.
2. Учесть рекомендации Рабочей группы по технологическим вопросам по заполнению формата указанных отчетов.

Вопрос 7 повестки дня Разное:

Общее число членов Комитета – 20.

Число членов Комитета, принявших участие в заседании по вопросу повестки дня и проголосовавших – 14.

Кворум для принятия решения имелся.

Обсуждалось:

- Качество операционной поддержки тестирования предоставления отчетности в репозитарий со стороны НРД.
- Порядок присвоения репозитарных кодов участникам

Предложение ограничить количество присваиваемых кодов одним (одно юр. лицо = один репозитарный код).

- О квитовке значений кода российской валюты: RUB и RUR.
- О заполнении и обработке сообщений в репозитарий в случае отсутствия репозитарного соглашения у второй стороны.
- О целесообразности изменения сортировки анкеты с одинаковыми параметрами для целей мэтчинга с варианта LIFO на FIFO.
- Присвоение репозитарного кода филиалам иностранных компаний
- Об определении списка полей по типам сделок, изменение которых должно повлечь обязательное направление отчета о таких изменениях в Репозитарий. Стоит ли ограничиться только обязательными полями или необходимо расширить этот список (вопрос для обсуждения).
- Отчитывание валютных свопов (FX SWAP): как ПФИ или как не-ПФИ
Изменения в нормативные документы ЦБР, вступающие в силу с 01.01.2014, предполагают отказа от деления сделок на спот, срочные и ПФИ. Ожидается только спот и ПФИ. Необходима ли в таком случае анкета для срочных сделок с делением на ПФИ или не-ПФИ.
- Варианты коллективного участия участников в нормотворческой деятельности в отношении отчетности в репозитарий
- Вопрос работы репозитарной системы НРД в выходные, а также работы поддержки в выходные и в поздние часы
- Включение дополнительного подтверждения со стороны репозитария, когда сообщение с анкетой договора попадает в журнал входящих сообщений репозитария
- Выставление счетов на основной депозитарный код участника и вопросы биллинга
- Вопрос обязательного указания сокращенного наименования участника на русском языке
- Обязательность заполнения кода ПФИ
- Иное.

Рекомендовано НРД:

- Признать недостаточный ресурс на период запуска обязательной отчетности. Довести данную информацию до руководства НРД. Обеспечить улучшение сервиса и качества операционной поддержки, в т.ч. реализовать вечернюю поддержку клиентов репозитария на период подключения и тестирования. Рассмотреть вопрос работы в ноябрьские праздники. Предоставить рекомендации участникам по порядку действий по подключению к репозитарию НРД и тестированию;
- Запросить членов комитета (крупных клиентов Репозитария) на предмет определения правила задания и использования множества репозитарных кодов;
- Обеспечение квитовки двух значений кода российской валюты (RUB и RUR) признать нецелесообразной, сохранить обработку только действующего значения кода валюты RUB из справочника.
- Предоставить участникам рекомендации по заполнению сообщений в репозитарий в случае отсутствия репозитарного соглашения у второй стороны, представить описание результатов обработки сообщений в этом случае.

- Провести заочное голосование о целесообразности изменения сортировки анкеты с одинаковыми параметрами для целей мэтчинга с варианта LIFO на FIFO; предоставить сопроводительные материалы.
- Подготовить запрос в Банк России об определении списка полей по типам сделок, изменение которых должно повлечь обязательное направление отчета о таких изменениях в Репозиторий. Запросить мнение регулятора о роли сканов документов в реестре репозитария по отношению к процедурам ликвидационного неттинга.
- Отчетность валютных свопов в качестве ПФИ или не-ПФИ осуществляется согласно первичной документации. Информация о валютных свопах, относящихся к ПФИ, согласно текущему регулированию включает код ПФИ.
- Предоставить информацию по вопросу работы репозитарной системы НРД в выходные, а также работы поддержки в выходные и в поздние часы.
- Реализовать в возможно краткие сроки дополнительное подтверждение со стороны репозитария в случае, когда сообщение с анкетой договора попадает в журнал входящих сообщений репозитария.
- Выставление счетов на основной депозитарный код участника представляется неверным. Для детального обсуждения вопроса требуется дополнительная информация. Необходимо предоставить участникам примеры счетов и счетов-фактур, а также порядок предоставления счетов участникам.
- Вопрос обязательного указания сокращенного наименования участника на русском языке будет закрыт к 1 ноября в тестовой и промышленной системах. Будет обеспечена возможность указания англоязычного сокращенного наименования – из справочника, включающего русскоязычные и англоязычные краткие наименования. При этом будет обеспечен мэтчинг русскоязычных и англоязычных наименований с предоставлением в подтверждениях русскоязычных наименований.
- Подготовить запрос в Банк России относительно обязательности заполнения кода ПФИ.

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

Р.К.Спыну