

Протокол заседания рабочей группы по технологическим вопросам при Комитете по репозитарной деятельности при Правлении НКО ЗАО НРД

Тема: Очередное заседание рабочей группы по технологическим вопросам при Комитете репозитарной деятельности при Правлении НКО ЗАО НРД

Дата заседания: **14 Марта 2014 г.**

Время: **10:00 – 13:00**

Повестка дня: обсуждаемые вопросы и принятые решения

1 Правила заполнения полей.

Решения:

1.1. НРД – по итогам тестирования рекомендаций предоставить клиентам выгрузку по всем техническим ошибкам.

1.2 НРД – в срок до 18.03.2014 г. опубликовать первый блок рекомендаций на русском и английском языках.

1.3. Участникам рабочей группы – подготовить список вопросов по рекомендациям, которые вызывают противоречия. НРД – дать централизованный ответ по вопросам участников рабочей группы.

2 Отчет НРД о состоянии готовности принятия отчетности по всем видам инструментов.

2.1. Все форматы с формальной точки зрения готовы. Проблемы могут быть выявлены в процессе тестирования их клиентами репозитария. Оптимизация существующих форматов будет вестись и в дальнейшем, с учетом выявленных рабочей группой проблем.

2.2. Формально все типы сделок можно отчитывать с 1 октября 2013 г.

Остаются открытыми вопросы отчетности по иным сделкам, в частности по структурированным продуктам. На данный момент используется форма «Иные сделки» (generalProduct). В целях детализации предлагается прикладывать отсканированную копию условий соответствующего договора.

3 Отчет сделок через центрального контрагента в НРД в рамках требований европейского регулятора EMIR.

3.1. НРД приступило к работе по вопросу отчетности по требованиям EMIR, в том к переговорам с зарубежными репозитариями о двустороннем сотрудничестве.

За введение таких услуг проголосовало большинство участников Рабочей группы и Комитета, в настоящий момент такая отчетность рассматривается в качестве дополнительной услуги со стороны НРД.

3.2. НРД направит Банку России вопросы:

1) о необходимости (обязательности направления) отчета по сделкам в рамках требований EMIR в Репозитарий;

2) о том, какая из сторон будет отчитываться по сделке в случае ее «новации» (перехода обязательств по договору одной из сторон к центральному контрагенту), когда одной из сторон которой является участник-нерезидент, другой – российский участник.

4 Развитие репозитария НРД в 2014 г. Задачи, цели, план-график работ. Отчет о проделанной работе.

План развития Репозитария на 2014 г. не прошел процедуру полного внутреннего согласования. Точные сроки будут предоставлены на ближайших заседаниях рабочей группы.

Проект плана-графика развития Репозитария.

Первое полугодие:

1. Разработка и согласование рекомендаций по группам инструментов в рамках рабочей группы.
2. Введение кодов ПФИ, правил их формирования к 25 июня 2014 г. (вынесено на заочное голосование Комитета).
3. Формирование документов биллинга на английском языке. Рассылка документов биллинга на репозитарный код, рассылка по web-сервисам/web-кабинету, e-mail, FileAct Swift. Разработка и внедрение нового алгоритма квитовки сообщений.

Предварительные сроки реализации:

- ✓ Web-кабинет и e-mail – середина-конец апреля
- ✓ Личный кабинет – конец мая
- ✓ File Act Swift – конец июня.
- ✓ Формат Dbf – второй квартал (сказать к следующей группе точнее).
- ✓ Реализация нового метода регистрации сообщений «сверка по умолчанию» – 3-й квартал
- ✓ Комбинированная сверка – второй квартал
- ✓ Заполнение серверной стороной наименования – 3й квартал
- ✓ Внедрение авансовых платежей – 2й квартал
- ✓ Справочники отказов – 3й квартал, в том числе ошибки, которые операционисты указывают – 2й квартал
- ✓ Разработка и реализация функционала «Массовая загрузка отчетности в репозитарий НРД/Bulk-reporting» – 2й квартал

Второе полугодие:

1. Возможность отчитывать сделки в рамках односторонней отчетности.
2. Проведение работ в рамках проекта в части регистрации сделок в рамках EMIR и разработка информационных сервисов в части push-рассылок.

5 Обсуждение, согласование структуры форума, предложенной участниками. Сроки разработки, принципы работы. Организация англоязычного форума.

Форум запущен: <http://forum.nsd.ru/viewforum.php?f=7>

6 Рассмотрение вопроса изменения типа полей «информация об источниках курса» на поля дополнительной сверки.

В Анкете договора валютного опциона (СМ023) и Анкете договора конверсионной сделки (СМ022) поле «Источник данных» (код, идентифицирующий организацию, публикующую цены) является обязательным к заполнению в соответствии с требованиями регулятора. Однако у многих участников нет возможности получать из фронт-офисных систем информацию об источнике курса, поскольку системы сами отслеживают курс и экспортируют в бэк-офисную систему зафиксированное значение курса.

Решение: Данная проблема будет представлена регулятору.

7 Обновление справочника «Источник данных» (<http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/information-provider>)

Необходимо добавить в справочник «Источник данных» курсы, устанавливаемые Чикагской товарной биржей (Chicago Mercantile Exchange) и объявляемый Ассоциацией трейдеров развивающихся рынков (Trade Association for the Emerging Markets, ЕМТА), а также значение "Прочее/Other".

Решение: НРД включит обновление справочников в один из ближайших релизов.

8	Обновление справочника для индекса плавающей ставки (http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/floating-rate-index)
---	---

8.1. В справочнике индексов плавающих процентных ставок отсутствует ставка RUONIA.

8.2. В справочнике индексов плавающих процентных ставок отсутствует ставки Национальной Валютной Ассоциации NFEA SWAP Rate.

Решение: НРД включит обновление справочников в один из ближайших релизов.

9	Рассмотрение возможности регистрации двух Анкет Генерального соглашения (Форма CM010) по одному Генеральному соглашению (ISDA Master Agreement) в Репозитории НРД.
---	---

Структура ISDA Master Agreement позволяет зафиксировать, через какие офисы возможно заключение сделок для каждой стороны соглашения. В текущей Анкете Генерального соглашения технически не предусмотрена возможность разделения сделок в рамках ГС по разным филиалам стороны по сделке, возможно только разделить по разным видам сделок (свопы, форварды и т.п.). В таком случае если контрагент планирует разделить полномочия по отчетности сделок в репозитарий внутри группы, то необходимо зарегистрировать две Анкеты Генерального соглашения по одному Генеральному соглашению (ISDA Master Agreement).

Комментарий НРД. Система репозитария технически не может разделять данное соглашение, в этом случае анкеты будут зарегистрированы как два генеральных соглашения.

Список вопросов для согласования ответа на стороне НРД к ближайшему заседанию рабочей группы:

1. Рассмотреть возможность не исключать из доверенности пункта о предоставлении доверенности на БИЛ/ИЛ.
2. Рассмотреть вопрос о синхронизации дат в расчетных документах в ПО «ЛУЧ».
3. Рассмотреть возможность предоставления в отчетных реестрах НРД дополнительной информации о контрагенте (помимо кода).
4. Рассмотреть возможность оплаты бумажных счетов нерезидентами в течение месяца (требуется изменение условий оказания репозитарных услуг).