

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 по репозитарной деятельности при Правлении НКО ЗАО НРД

Дата заседания: 11 Апреля 2014 г.

Время: 10:00 – 13:00

Планируемые изменения законодательства в части сроков отчетности.

- 1
- 1.1. Комментарий относительно заявленных регулятором изменений и планируемых сроков начала обязательной отчетности (анонсированы на семинаре НРД: <https://www.nsd.ru/ru/press/conference/index.php?id36=342419>)
 - 1.2. Комментарий относительно текущей работы регулятора в части переработки подзаконного акта
 - 1.3. Порядок и планируемые сроки внесения изменений в форматы сообщений в связи с предстоящими изменениями в регуляторных требованиях
 - 1.4. Возможные изменения в формате сообщений, в справочнике участников и в процедуре регистрации в связи с потенциальным отказом от обязательной отчетности для нерезидентов.
 - 1.5. Возможные изменения в перечне обязательных полей требуемых Регулятором.

Рекомендации/решение рабочей группы:

1. Подготовить предложения по изменению/уточнению Приложений к действующему «Порядку ведения реестра договоров, заключенных на условиях генерального соглашения (единого договора)», в частности:
 - статусам состояния обязательств;
 - кодам классификации ПФИ;
 - кодам амортизации
 - кодам взаимосвязи;
 - полям, обязательным и необязательным к заполнению, в том числе для кредитных деривативов.

Участникам рабочей группы предложено ознакомиться с таблицей основных и дополнительных полей Приложения №1 (материалы к повестке), сформировать и предоставить свои пожелания/замечания.
2. Продолжать подготовку рекомендаций в соответствии с опубликованным планом-графиком.
3. В связи с потенциальной отменой обязательной отчетности для нерезидентов к следующему заседанию рабочей группы НРД рекомендуется:
 - Предоставить список предложений в части изменений в формате сообщений с целью идентификации резидентов/нерезидентов;
 - Предоставить список возможных кодов для идентификации резидентов/нерезидентов;
 - Проанализировать с технологами НРД возможность использования поля «резидент/нерезидент» в качестве альтернативы кодам-идентификаторам.

Уточнения по отдельным формам

- 2
- 2.1. Отчёт о сообщениях, находящихся в ожидании и пожелания участников о возможных улучшениях в части запроса деталей сообщений в ожидании;
 - 2.2. Выписка о зарегистрированных сообщениях
 - 2.3. О возможности получения деталей, на основании которых выставляется счёт (в виде файла pdf, dbf).

Рекомендации/решение рабочей группы:

- 2.1. К следующему заседанию рабочей группы:
 - Проработать возможность разработки формата отдельного запроса к отчету о статусе ожидания для идентификации деталей сделок с технологами НРД.
 - Проработать возможность преобразования отчета о статусе ожидания в табличный формат.

- Проработать возможность опционального формирования детального сообщения к запросу о подтверждении стороне при встречной сверке (аналог сообщения при комбинированной сверке).
- 2.2. Рекомендовано:
- Доработать формат выписки о зарегистрированных сообщениях: сделать выписку более компактной, предусмотреть табличный формат.
- 2.3. Возможность получения деталей, на основании которых выставляется счёт (в виде файла pdf, dbf) в ПО «Луч» и web-кабинете реализована.

3	<p>Согласование срока установки версии 3.1_patch</p> <p>По результатам заочного голосования участников рабочей группы принято решение о переносе включения данной версии схемы в промышленную версию ПО с внеочередного релиза 15 апреля 2014 г. на очередной релиз, намеченный на 25 мая 2014 г. (продление срока тестирования, дополнение схемы очередными изменениями, согласование / утверждение изменений + 30 дней на раскрытие, включая 2 недели на тестирование на стороне участников).</p>
	<p>Рекомендации/решение рабочей группы:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Утвердить сроки изменения схемы на сайте НРД. • Раскрывать информацию о названии схемы и ее номере в ссылке на скачивание на сайте спецификации сообщений торгового репозитория НРД. • Сформировать архив (историю) публикаций предыдущих версий схемы на сайте спецификации сообщений торгового репозитория НРД.
4	<p>Согласование рабочей группой рекомендаций НРД по первому блоку работ. Вопрос о продлении сроков согласования с учетом изменений законодательства в части сроков отчетности.</p> <p>4.1. Валютные форварды и опционы</p> <ul style="list-style-type: none"> - Анкета договора конверсионной сделки (СМ022) - Анкета договора валютного опциона (СМ023) - Анкета договора валютного бинарного опциона (СМ024) <p>4.2. Процентные форварды и свопы</p> <ul style="list-style-type: none"> - Анкета соглашения о будущей процентной ставке (СМ031) - Анкета договора процентного свопа (СМ032) - Анкета договора фиксации максимальной-минимальной процентной ставки (СМ033) - Анкета договора свопциона (СМ034)
	<p>Рекомендации/решение рабочей группы:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Продлить сроки согласования рекомендаций по валютным и процентным инструментам до следующего заседания рабочей группы. • Участникам рабочей группы – протестировать соответствующие Анкеты договоров, направить свои комментарии и вопросы по рекомендациям на адреса ilyina@nsd.ru, karova.vs@nsd.ru либо на форум НРД (http://forum.nsd.ru/viewforum.php?f=7).
5	<p>Формат Анкеты об исполнении обязательств по зарегистрированным договорам (СМ092). Предоставление информации о произведенных сторонами платежах или передаче имущества во исполнение финансовых договоров в условиях отсутствия предусмотренного порядка со стороны Банка России. Планируемые изменения в формате сообщений по CSA.</p> <p>5.1. Структура и рекомендации по заполнению сообщения о маржевых суммах согласно действующему регулированию.</p> <p>5.2. Формат и состав данных в отчете о маржевых суммах и иных связанных данных согласно европейскому регулированию.</p> <p>5.3. Формирование запроса в Банк России по сохранению или изменению подхода в части отчетности о маржевых суммах.</p>
	<p>Рекомендации/решение рабочей группы:</p>

- НРД – подготовить для участников рабочей группы опрос для заочного голосования на основе сравнения действующих форматов и требований Regis-TR.
- По итогам заочного голосования НРД провести консультацию с Банком России.

6	<p>Возможные варианты изменения требований по предоставлению квартального отчета.</p> <p>6.1. Обсуждение возможных вариантов изменения требований Банка России в отношении предоставления квартального отчета, включая:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Исключение возможности направления квартального отчета, сохранение требования отчетности по коротким сделкам только на последельной основе; • Сохранение возможности направления квартальной отчетности как альтернативы последельной форме отчетности; корректировка требований к форме и порядку заполнения квартального отчета; • Отмена специальной формы квартального отчета и введение опциональной возможности направления в Банк России информации о коротких сделках пакетом по итогам календарного месяца в соответствии с форматом, используемым для последельной отчетности. <p>6.2. Формирование запроса в Банк России по изменению подхода в части квартальной отчетности.</p>
	<p>Рекомендации/решение рабочей группы:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Вынести данные вопросы на заочное голосование. • По итогам заочного голосования НРД провести консультацию с Банком России.

7	<p>Перечень иных видов договоров.</p> <p>7.1. Выбор между двумя возможными вариантами определения перечня:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Набор исключений, не подлежащих обязательной отчетности; • Явно определенный перечень видов договоров, подлежащих обязательной отчетности. <p>7.2 Формирование запроса в Банк России по сохранению или изменению подхода в части отчетности о маржевых суммах.</p>
	<p>Рекомендации/решение рабочей группы:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Вынести данные вопросы на заочное голосование. • По итогам заочного голосования НРД провести консультацию с Банком России.

8 Иные вопросы:

1. Реализация НРД подписки участников на новости, обновление рекомендаций, возможностях обсуждения на форуме.

Подписка на новости реализована и доступна для участников:
<https://www.nsd.ru/ru/services/repository/news/index.php?id36=342199>

Форум запущен и доступен для участников:
<https://www.nsd.ru/ru/services/repository/news/index.php?id36=341396>

2. Проблема заполнения блока «Cash» в СМ091 в квартальном отчете.

Блок «Cash» помечен в рекомендациях как неиспользуемый. При этом при не заполнении данного блока сообщения одной из сторон отчет не регистрируется.

В процессе создания сообщений в репозиторий приоритет следует отдавать опубликованным рекомендациям. Блок опциональный – в следующем релизе он будет удален.

3. Формы представления отчетности по сложным и структурным сделкам.

Отчетность по сложным и структурным сделкам предлагается предоставлять в форме Анкеты договора иного инструмента СМ081 (generalProduct) с приложением сканированных копий соответствующих документов по сделкам.

Вопросы, не вошедшие в повестку дня: обсуждение и принятые решения:

9 Значение «Тип маржи» в анкете РЕПО (СМ041)

Рекомендации/решение рабочей группы:

Предусмотреть две альтернативы при выборе значения поля «Тип маржи» (marginType): “Instrument” и “Cash” (в настоящее время во всех случаях рекомендуется указывать “Instrument”).

10 Фильтры в ПО «Луч»

Рекомендации/решение рабочей группы:

Расширить список фильтров в ПО «Луч» с целью возможности сортировки сообщений по дате и времени отправки сообщения, дате внесения в реестр. К следующей рабочей группе дать ответ о возможности реализации и сроках.

11 Публикация полученных от Банка России ответов по официальным запросам НРД

Рекомендации/решение рабочей группы:

Рекомендовано разместить в разделе «[Новости репозитория](#)» ответ Банка России на официальный запрос, согласованный ранее рабочей группой и отправленный НРД (после получения данного ответа).

12 Автоматизация кодов ПФИ

Рекомендации/решение рабочей группы:

Рассмотреть возможность создания «калькулятора» кодов ПФИ

13 Редактирование полей дополнительной сверки

Рекомендации/решение рабочей группы:

Обсудить с технологами возможность добавления в ПО «Луч» опции «отредактировать/согласовать» для полей дополнительной сверки.

14 Идентификация ошибок до отправления сообщения

Рекомендации/решение рабочей группы:

Уточнить возможность уведомления участника об ошибке до отправки им сообщения в репозиторий.

15 Об указании типа инструмента в анкете генерального соглашения

Рекомендации/решение рабочей группы:

Рассмотреть возможность использовать справочник [ProductType](#) (вместо [PartyRoleType](#)) для поля «Тип отчетности информирующего лица» (reportingType) в Анкете генерального соглашения (СМ010).

16 О плане по автоматизации по 2 квартал

Рекомендации/решение рабочей группы:

Предоставить рабочей группе план автоматизации (карту проекта) на 2 квартал.

17 О «десктопной» версии Web-кабинета

Рекомендации/решение рабочей группы:

Сообщить на следующем заседании рабочей группы о сроках реализации десктопной версии Web-кабинета.