

## 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 проведения заседания: 25 Апреля 2014 г.

Время: 10:00 – 13:00 (ауд. 1.5)

<b>1</b>	<b>Карта проектов репозитария на II квартал 2014 г.</b> 1.1. Отчёт НРД о ходе доработок, ранее инициированных рабочей группой и Комитетом по репозитарной деятельности. 1.2. Информация по доработкам, планируемыми НРД к выводу во втором квартале и список доработок, которые ожидают дальнейшей приоритизации рабочей группой/Комитетом по репозитарной деятельности.
----------	--

### Рекомендации/решение рабочей группы по итогам обсуждения карты проектов репозитария:

- Рекомендовано перенести сроки релизов №24 (Схема 3.2), №26 (Схема 3.4) на одну неделю ранее назначенных сроков для предотвращения пересечений со сроками сдачи квартальной отчетности;
- Проанализировать возможность идентификации сообщений в журнале входящих сообщений (присвоение идентификатора сообщений);
- Проанализировать возможности клиента в web-кабинете и в ПО «Луч» в части управления выписками и счетами при условии, что БИЛом и ИЛом является третье лицо;
- Разработать формат запроса о детализации отчета о сообщениях в режиме ожидания;
- Обсудить возможность формирования второго тестового контура, дать ответ на заседании рабочей группы 16 мая. Сформировать технические требования;
- Рассмотреть возможность расширения фильтров для ПО «Луч» и web-кабинета в части отражения информации о сделках (все входящие сообщения/прошедшие валидацию/только зарегистрированные);
- Проанализировать к следующему заседанию возможность получения счетов в новой версии ПО «Луч» через web-сервис.

### Комментарии НРД по итогам дополнительного совещания с IT-директором НРД (Сергеем Путятинским).

#### 1) Перенос дат релизов.

Релиз №24 (вступающий в действие 30 июня 2014 г.) перенесен быть не может, т.к. под него распланировал конкретный перечень работ, включая тестирование, - перенос сделает невозможным выполнение заложенного плана.

Следующий релиз, попадающий на конец квартала, 26-й (предварительно вступающий в действие 29 сентября 2014 г.), может быть смещен на неделю ранее (с вступлением в действие с 22 сентября 2014 г.); последующие релизы будут выстраиваться в соответствии с примерным интервалом в 1,5 месяца от релиза №26.

#### 2) Введение второго тестового контура.

Обсуждаемое предложение: поддерживать тестовый контур, полностью отражающий боевой контур (в части схемы сообщений), на регулярной основе и вводить на периодической основе второй тестовый контур, отражающий планируемые к введению изменения (в части измененной схемы сообщений), - за 2 недели / 1 месяц до введения изменений в действие.

Точная информация о возможности формирования дополнительного (второго) тестового контура в соответствии с постановкой задачи будет предоставлена НРД дополнительно на следующем заседании рабочей группы.

<b>2</b>	<b>Согласование рекомендаций по валютным и процентным инструментам (СМ022, СМ023, СМ024, СМ031, СМ032, СМ033, СМ034).</b>
----------	---

Согласно Протоколу рабочей группы от 11.04.2014 ожидается, что до пятницы 25 апреля участники протестируют указанные инструменты и внесут предложения по правкам в рекомендации, если они необходимы. В случае отсутствия замечаний и предложений рекомендации будут признаны утвержденными (для того чтобы поставщики программного обеспечения могли использовать их как официальные). Соответствующие рекомендации опубликованы на странице <http://repository.nsd.ru/recommendations/recommendations>.

#### **2.1. Валютные форварды и опционы**

- Анкета договора конверсионной сделки (СМ022)
- Анкета договора валютного опциона (СМ023)
- Анкета договора валютного бинарного опциона (СМ024)

#### **2.2. Процентные форварды и свопы**

- Анкета соглашения о будущей процентной ставке (СМ031)
- Анкета договора процентного свопа (СМ032)
- Анкета договора фиксации максимальной-минимальной процентной ставки (СМ033)
- Анкета договора свопциона (СМ034)

#### **Рекомендации/решение рабочей группы:**

Рекомендации по валютным и процентным инструментам (СМ022, СМ023, СМ024, СМ031, СМ032, СМ033, СМ034) решено передать на утверждение Комитету. Возникающие правки утверждать в том же порядке.

#### **Идентификация клиентов-нерезидентов.**

3

Предложения по внесению изменений в формат сообщений с целью идентификации резидентов/нерезидентов (в связи с потенциальной отменой обязательной отчетности для нерезидентов).

#### **Рекомендации/решение рабочей группы:**

Сформировать приоритетный перечень кодов для идентификации клиентов-нерезидентов с целью присвоения им особого статуса и обеспечения возможности односторонней регистрации для клиентов-резидентов, контрагентами которых являются нерезиденты. Разослать материалы для заочного рассмотрения. Результаты представить на заседании 16 мая 2014.

4

#### **Необходимость и перспективы внедрения «десктопной» версии Web-кабинета**

**Комментарии НРД по итогам дополнительного совещания с IT-директором НРД (Сергеем Путятинским).**

Создание нового решения с размещением локальной базы данных на стороне клиентов не соответствует ИТ-стратегии НРД. В этой связи необходимо предоставить перечень проблем, связанных с эксплуатацией текущей версии ПО «Web-Кабинет», либо перечень недостающего функционала. Данный перечень будет проанализирован на стороне НРД, после чего на обсуждение с пользователями будет вынесен проект обновлений решения.

Участниками совещания названы текущие проблемы ПО «Луч» и ПО «Web-кабинет»:

- 1) Отсутствие англоязычной версии для автоматизированной работы Луча;
- 2) Работа ПО «Луч» только в режиме приложения, а не в режиме сервиса (для автоматизированного обмена сообщениями с НРД);
- 3) Затруднена работа ПО «Луч» на больших объемах при транспорте через почту (больше 200 сообщений в очереди на загрузку из Outlook);
- 4) Затруднено подключение к web-сервисам при наличии более-менее строгих корпоративных политик у клиента;
- 5) Без ПО «Луч» нет возможности распечатать сообщения в НРД в случае отсутствия доступа сети для ручной отправки, либо сформировать/сохранить FrML сообщения для полу-ручной отправки;
- 6) Web-клиент зависит от версии браузера, которая в глобальных корпорациях может достаточно долго не обновляться;

- 7) Web-клиент требует разных наборов компонентов для работы с электронной подписью ГОСТ и Микрософт RSA;
- 8) Медленно работает подпись документов через web-клиент из-за особенностей работы с Java.

Требование к ПО, которое должно представить альтернативу ПО «Луч» (т.е. к веб-кабинету или другому приложению):

- Возможность формирования пакета сообщений для отправки независимо от сервиса по приемке/передаче пакетов, т.е. должна быть обеспечена функциональность, которая позволяет подписать ключом готовые xml-файлы и сформировать пакет для отправки независимо от наличия выхода в Интернет/доступности веб-сервисов (возможно как отдельный модуль). Также должна быть возможность отправить подписанный пакет как онлайн, так и позже через разные каналы, например как через веб-сервис, так и через Outlook.
- Возможность генерации PDF и печати документов;
- Возможность сохранять полученные сообщения Репозитория – квитанции, выписки из реестра и другие как с подписью (csg-файлы), так и в виде xml.

#### Согласование срока тестирования и утверждения рекомендаций по сделкам с ценными бумагами (СМ042-СМ048).

Соответствующие рекомендации опубликованы на странице <http://repository.nsd.ru/recommendations/recommendations>.

5

- a. Спот-сделки с ценными бумагами
  - i. Анкета договора купли-продажи облигации (СМ042)
  - ii. Анкета договора купли-продажи акции (СМ046)
- b. Форварды и опционы на акции
  - iii. Анкета договора форварда на акции (СМ047)
  - iv. Анкета договора опциона на акции (СМ048)
- c. Форварды и опционы на облигации
  - v. Анкета договора форварда на облигации (СМ043)
  - vi. Анкета договора опциона на облигации (СМ044)
  - vii. Анкета договора опциона на корзину облигации (СМ045)

**Рекомендации/решение рабочей группы:**

Решено продлить сроки тестирования рекомендаций II блока (СМ042-СМ048) до 16 мая 2014.

#### 6 Иные вопросы:

##### 6.2. О формате указания чистой цены облигации (проценты либо десятичные дроби) в Анкете договора РЕПО (СМ041).

В форме СМ041 решено указывать значение элемента «cleanPrice» в процентах от номинала, а элементам «accruals» и «dirtyPrice» присвоить статус ncf (не используемых), если нет противоречий с другими формами. Вопрос будет вынесен для рассмотрения на Комитете.

##### 6.3. О синхронизации правила заполнения поля «процентная ставка» формы СМ041 (РЕПО), в которой процентные ставки отражаются в виде десятичной дроби, и отчетов системы СУО НРД (системы управления обеспечением) для РЕПО с корзиной, где процентная ставка указывается в процентах.

Решено в III квартале синхронизировать правила заполнения поля «процентная ставка» формы СМ041 и системы СУО НРД, закрепить формат заполнения в виде десятичной дроби.

##### 6.4. О заполнении поля «Тип маржи» (marginType).

Формат FrML позволяет указать, какой тип margin ratio используется в сделке (Cash или Instrument). Однако «по умолчанию» в поле «Тип маржи» (marginType) рекомендуется указывать значение «Instrument». При этом поле «Коэффициент обеспечения» (marginFactor) рекомендуется заполнять согласно стандартам НФА, которые соответствуют типу маржи «Cash» (т.е. cash margin ratio и «haircut of money»).

*Предлагается обсудить возможность изменения рекомендации по заполнению поля Margin Type на «Cash» либо оставить обе альтернативы (Cash и Instrument).*

Решено включить вопрос в анкету заочного голосования.

#### **6.5. О необходимости операционной поддержки 02.05.2014 и открытия опердня 02.05.2014.**

Решено не открывать операционный день 02.05.2014. (См. новость <https://www.nsd.ru/ru/press/services/index.php?id36=376815>)

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

#### **7 Сроки публикации англоязычных версий рекомендаций**

**Рекомендации/решение рабочей группы:**

Рекомендовано публиковать англоязычные версии рекомендаций в течение двух недель после публикации русскоязычных версий.

#### **8 Подготовка рекомендаций в соответствии с версией 3.2.**

**Рекомендации/решение рабочей группы:**

Рекомендовано подготовить отдельный список изменений в версии 3.2 по сравнению с версией 3.1 patch.

#### **9 Возможности ПО «Луч»**

**Рекомендации/решение рабочей группы:**

Уточнить возможность получения и трансляции информации от EMIR в ПО «Луч».

#### **10 Получение счетов 3-им лицом**

**Рекомендации/решение рабочей группы:**

Предусмотреть в анкете возможность закрепления функции получения счетов за 3-им лицом (в виде прямой инструкции, без требования письменной доверенности).

#### **11 Порядок действия участников для регистрации новации в отношении зарегистрированного договора (охват старых сделок новыми Генеральными Соглашениями)**

**Рекомендации/решение рабочей группы:**

Сформировать и направить запрос Регулятору о возможности разделения технической реализации (Протокол № 3/2014 заседания Комитета по репозитарной деятельности при Правлении НКО ЗАО НРД) и юридического толкования данного вопроса.

#### **12 Расширение справочников**

**Рекомендации/решение рабочей группы:**

Рассмотреть возможность досрочного (до релиза 23 мая) расширения справочников по типам договоров. (Приоритет – справочник к ГС по fxSingleLeg.)

#### **13 Отзыв квартального отчета**

**Рекомендации/решение рабочей группы:**

Предусмотреть специальный статус или другую альтернативу для отмены регистрации квартального отчета ввиду операционной ошибки.

#### **14 Собрание рабочей группы**

**Рекомендации/решение рабочей группы:**

Запланировать следующее заседание рабочей группы на 16 мая 2014 года.