

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: **16 мая 2014 г.**

Время проведения заседания: **10:00 – 13:00**

1	<p>Идентификация клиентов-нерезидентов:</p> <ul style="list-style-type: none">• Планируемые доработки НРД в связи с ожидаемыми изменениями в регулировании, предусматривающими возможность оказания репозитарных услуг российским участникам вне зависимости от заключения репозитарием договора об оказании репозитарных услуг с иностранным участником:- реализация идентификации второй стороны в анкете в случае, когда второй стороной является участник сделки – нерезидент;- реализация односторонней сверки для участников – нерезидентов (в случае, когда участник не обязан рапортировать сделку в соответствии с изменениями в регулировании репозитарной деятельности);- изменение схемы сообщения;- изменение справочников участников.
<p>Рекомендации/решение рабочей группы:</p>	
<ol style="list-style-type: none">1. Зафиксировать в Условиях оказания репозитарных услуг процесс передачи отчетности в Репозитарий для клиентов-нерезидентов.2. Подготовить закрытый перечень кодов (включая коды SWIFT, Reuters, Bloomberg) для идентификации контрагентов-нерезидентов.	
2	<p>О релизах новых версий спецификации формата электронных сообщений Репозитария:</p> <ul style="list-style-type: none">• Подтверждение даты установки в промышленный контур релиза версии 3.1 patch (23 мая 2014 г.).• Планируемые изменения и дата релиза версии 3.2.• Перенос дат будущих релизов для предотвращения пересечений со сроками сдачи квартальной отчетности.
<p>Рекомендации/решение рабочей группы:</p>	
<ol style="list-style-type: none">1. Вынести для голосования на Комитете по репозитарной деятельности вопрос о переносе сроков релизов, попадающих на конец квартала (на неделю раньше <i>либо</i> позже окончания квартала), а также о целесообразности декабрьского релиза ПО репозитария.2. Релиз 3.2 перенесен быть не может (утвержденная дата – 27 июня 2014 г.).	
3	<p>Вопросы по тестовому контуру Репозитария:</p> <ul style="list-style-type: none">• Доступ к тестовому окружению НРД и своевременное информирование со стороны НРД о перерывах в работе.• Рассмотрение возможности предоставления НРД второго тестового окружения с копией живой конфигурации.
<p>Рекомендации/решение рабочей группы:</p>	

1. Предоставить на следующем заседании рабочей группы актуальную информацию по итогам совещания с IT-руководством НКО ЗАО НРД.

4	О развитии программной базы для отчетности в Репозитарий: <ul style="list-style-type: none">• Стратегия НРД по развитию программной базы для отчетности в Репозитарий (ПО «Луч», web- клиент, web-сервисы).
	Рекомендации/решение рабочей группы:
	<ol style="list-style-type: none">1. Организовать семинар/вебинар с демонстрацией сервисов IT Global (участникам рабочей группы предложено <i>подготовить перечень вопросов</i> для обсуждения).2. Рассмотреть возможность формирования архива в сервисах IT-Global с целью поиска информации.
5	Согласование рабочей группой рекомендаций НРД и сроков тестирования по сделкам с ценными бумагами (СМ041-СМ48): <ul style="list-style-type: none">• Согласно Протоколу рабочей группы от 25.04.2014 ожидается, что до пятницы 16 мая участники протестируют указанные инструменты и внесут предложения по правкам в рекомендации, если они необходимы. Соответствующие рекомендации опубликованы на странице http://repository.nsd.ru/recommendations/recommendations<ul style="list-style-type: none">- Спот-сделки с ценными бумагами (СМ041; СМ042; СМ046)- Форварды и опционы на акции (СМ047; СМ048)- Форварды и опционы на облигации (СМ043; СМ044; СМ045)
	Рекомендации/решение рабочей группы:
	<ol style="list-style-type: none">1. Передать рекомендации по сделкам с ценными бумагами (СМ041-СМ48) на утверждение Комитету по репозитарной деятельности.
6	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: <ul style="list-style-type: none">• Определение формата отчетности в репозитарий по форме СМ092.
	Рекомендации/решение рабочей группы:
	<ol style="list-style-type: none">1. Провести conference call для обсуждения деталей формата предоставления информации о плавающих маржевых суммах (формы СМ092) в четверг 22.05.2014.
7	Порядок направления в репозитарий информации о сделках покупки - продажи металла за валюту: <ul style="list-style-type: none">• Определение формата отчетности для сделок, при которых по первой ноге одна сторона продает другой металл за валюту (дата расчетов – Т+1), а по второй ноге первоначальный продавец выступает в качестве покупателя этого актива. Такие сделки предлагается отчитывать по аналогии с валютными свопами (как единую сделку, а не как совокупность двух разных сделок).
	Рекомендации/решение рабочей группы:

1. Подготовить форматы отчетности для сделок купли-продажи металла:
 - активация блока «стратегия»;
 - преобразование формы анкеты валютного свопа для товарных сделок.

Иные вопросы:

8

- О введении комбинированного способа сверки для квартального отчета (СМ091) и Анкеты о состоянии обязательств (СМ093) (в настоящее время используется последовательный способ сверки).

Рекомендации/решение рабочей группы:

1. По умолчанию предусмотреть только комбинированную сверку для отчетов СМ091, СМ093.

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

9

Расширение справочника для поля «Тип отчетности информирующего лица» (reportingType)

Рекомендации/решение рабочей группы:

- Рассмотреть возможность расширения справочника для поля «Тип отчетности информирующего лица» (reportingType) в анкете Генерального соглашения (замена справочника PartyRoleType на ProductType). Приоритет – расширение для fxSingleLeg, т.е. возможность отчитывать отдельные виды конверсионных сделок (валютные форварды) без привязки к другим типам конверсионных сделок (спот-сделкам).

Комментарий НРД: соответствующее изменение может быть внесено не ранее релиза 3.3 (15 августа 2014 г.) при принятии решения о его целесообразности. Вопрос о необходимости направлять в репозиторий сведения о конверсионных спот-сделках следует адресовать регулятору.

10 Семинар 28.05.2014

Рекомендации/решение рабочей группы:

- Участникам рабочей группы – направить НРД *вопросы* к представителю Банка России для рассмотрения на семинаре 28.05.2014

11 О заполнении поля «Тип маржи» (marginType)

Рекомендации/решение рабочей группы:

- Вынести вопрос для голосования на Комитете по репозитарной деятельности, внести соответствующие правки в рекомендации.

12 О полях, участвующих в проверке уникальности анкет

Рекомендации/решение рабочей группы:

- Рассмотреть возможность доработки функции проверки сообщений на ошибки перед их отправкой таким образом, чтобы проверка проводилась так же и на заполнение отправителем уникальных полей (альтернативный вариант – обеспечить, чтобы в перечень полей, определяющих уникальность анкеты, были включены только обязательные для заполнения поля).