

## Протокол заседания рабочей группы по технологическим вопросам при Комитете по репозитарной деятельности при Правлении НКО ЗАО НРД (с участием Банка России)

Дата проведения заседания: 26 августа 2015 г. (среда)

Время: 10:00 – 12:00

### 1. Состав и особенности 34 релиза ПО Репозитария (плановая дата установки – 30 сентября 2015) Тестирование НРД

#### Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы (РГ)

1.1. В состав 34 релиза по Репозитарию войдут исключительно доработки по изменению форматов схемы 3.7. Предварительный объем изменений был представлен на Рабочей группе 6 июля 2015. По рекомендациям участников в формате был внесен ряд изменений: элемент «Аффилированность сторон» был перенесен из анкеты договора в анкету генерального соглашения, из анкеты СМ092 был удален элемент «Подтверждающая отчет сторона».

По новым форматам участниками были заданы вопросы, которые будут уточнены в пункте 8.

1.2. С 20 августа новые форматы находятся в тестовом контуре. На 27 августа семь клиентов и три вендора начали тестирование. При отсутствии доступа в тестовый контур участникам рекомендовано направлять запрос на soed@nsd.ru.

#### Рекомендация РГ

Рекомендовано начать тестирование форматов заблаговременно.

1.3. В соответствии с пожеланиями участников и Банка России, НРД провел опрос среди участников о планируемых объемах сообщений, направляемых в Репозиторий с 1 октября 2015. Проведенное нагрузочное тестирование показало, что возможности системы покрывают пятикратное увеличение от ежедневного максимального объема сообщений - около 5000: НРД гарантирует прием 25 000 входящих сообщений и 75 000 исходящих сообщений в день.

1.4. Дата ввода новой версии форматов запланирована на 30.09.2015 (вечер).

Ввиду операционной нагрузки по отчетности исторических и текущих сделок в новом и старом формате а также рисков вывода изменений в середине недели, участники рекомендовали перенести релиз ПО по Репозитарию на 25.09.2015 (вечер).

#### Комментарий НРД

Ввиду того, что введение нового формата версии 3.7 с 25.09.2015 сделает невозможным использование текущего формата 3.6 до 1 октября, существует значительный юридический риск для репозитария по неправомерному отказу в приеме сообщений от участников, которые в соответствии с регулированием будут иметь право использовать текущую версию формата до даты официального перехода. Одновременно с этим, некоторые участники проинформировали о готовности начать тестирование только в последнюю неделю сентября, по причине задержек на стороне вендоров, другими словами, перенос релиза может означать невозможность провести какое-либо тестирование ПО до момента начала фактической отчетности клиентов таких вендоров.

Для обеспечения дополнительного времени на прохождение процедур управления изменениями клиентов, НРД также готов предложить сборку промышленного ЛУЧа 25 сентября, таким образом, у участников появится неделя для решения внутренних организационных вопросов.

#### Рекомендация РГ

Так как вопрос переноса релиза, в первую очередь, был связан с необходимостью отчитать старые сделки до 1 Октября, а значит, с учетом комментариев НРД, в формате 3.6, рекомендуется отчитать исторические сделки как можно раньше в сентябре, чтобы иметь время исправить возможные ошибки в используемом программном обеспечении.

### 2. Порядок указания кода о состоянии обязательств договора

#### Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

В Указании № 3253-У с учетом изменений, определенных редакцией Указания №

3567-У от 16.02.2015 коды о состоянии обязательств, по договору T, TD, R, P и D требуют единообразия в подходах использования.

### **Рекомендации РГ**

При досрочном исполнении обязательств по договору участниками было рекомендовано, сначала вносить изменения в анкеты договоров и, затем, направлять анкету о состоянии обязательств со статусом T.

При ошибочно сформированном сообщении на стороне участника, информацию о таких сообщениях и последующие сообщения с указанием статуса R, направлять в Репозитарий не требуется.

В случае, когда дата окончания сделки приходится на выходной день, в первый следующий рабочий день для закрытия сделки указывается код T.

Коды P и D заполняются по согласованию сторон, исходя из описания в графе 5 Таблицы 2 Приложения 1 к Указанию 3253-У.

## **3. Уточнение по предоставлению информации по сделкам своп в репозитарий с 1 октября 2015/Классификация сделок/кода ПФИ (Банк России)**

### **Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы**

- 3.1. В статьях 2 и 3 в Указании 3253-У упоминается предоставление отчетности по договорам своп как ПФИ, так и не ПФИ. Одновременно с этим, в Указании 3565-У уточняется определение для договоров своп как ПФИ. Необходимо уточнить сохранится ли отчетность по договорам своп не ПФИ.

#### **Рекомендация Банка России**

Отчетность предоставляется единожды по договорам своп ПФИ и не ПФИ в анкете СМ021.

- 3.2. Ввиду разного подхода к идентификации сделок как ПФИ и не ПФИ, участники сталкиваются со сложностями в мэтинге сообщений на стороне репозитария по коду классификации ПФИ.

#### **Рекомендация Банка России**

На данный момент отсутствует рекомендации по единому подходу. Регулятор вернется к участникам с уточнениями.

- 3.3. Необходимость отчетности сделок в Репозитарий, при отсутствии указания в тикете/договоре, что сделка является ПФИ, но в тоже время, по формальным признакам сделки, ее можно отнести к ПФИ.

#### **Рекомендация Банка России**

В случае, когда сделка не специфицирована как ПФИ в тикете/договоре, информация может не предоставляться в Репозитарий.

Уточнение: конверсионные сделки сроком менее трех дней не являются обязательными для отчетности в Репозитарий.

## **4. Уточнения по заполнению элемента Голосовой брокер в анкете договора (Банк России)**

### **Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы**

На уровне законодательства Российской Федерации отсутствует определение понятия «Голосовой брокер». Таким образом, у участников нет однозначного понимания, в каких случаях необходимо заполнять данную информацию.

#### **Комментарий Банка России**

В изменениях к Указанию № 3253 уточнена формулировка – «Код брокера». Изначально подразумевалось, что указывается идентификатор посредника, в

## 5. Определение понятия Портфель договоров

### Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

У участников отсутствует понимание, что подразумевается под понятием портфель договоров и когда договор следует считать включенным/исключенным в/из портфеля.

#### Рекомендации Банка России

Указывается некий идентификатор, когда обеспечение по договорам осуществляется на валовой основе в рамках одного генерального соглашения.

**Комментарий НРД:** По результатам проведенной Рабочей группы и совещания с Регулятором было решено не заполнять поля «Дата включения/исключения договора в/из портфеля договоров».

## 6. Порядок указания кода классификации договора РЕПО/ формирование Кода ПФИ

### Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

6.1. Участниками был задан вопрос в отношении выбора корректного атрибута кода классификации договора РЕПО.

#### Рекомендации Банка России

Термин корзины ценных бумаг на данный момент применяется только к специфическим сделкам РЕПО с Банком России, которые не отчитываются в Репозиторий участниками самостоятельно.

По внебиржевым сделкам возможно несколько выпусков ценных бумаг в обеспечении. В этом случае, в анкете СМ041 необходимо указывать значение атрибута W.

6.2. Уточнен порядок формирования кода ПФИ в отношении стиля опциона.

#### Рекомендации Банка России

В примере участника в случае указания кода ПФИ для опциона при азиатском стиле определения цены, необходимо в четвёртом атрибуте указать L – плавающая цена исполнения. Одновременно с этим следует уточнить, что опцион с азиатским стилем может быть, как американским, европейским или бермудский, поэтому третий атрибут кода заполняется исходя из условий договора по типу даты.

## 7. Порядок указания кода участника клиринга

### Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

Требуются уточнения в отношении указания кода участника клиринга в анкете договора, а также элемента «Дата включения обязательств из договора в клиринговый пул».

#### Рекомендации Банка России

В качестве кода участника клиринга указывается код одной из сторон сделки по согласованию сторон.

В случае если по условиям договора, сделка подлежит клирингу, то «Дату включения обязательств из договора в клиринговый пул» может быть равна дате заключения сделки.

## 8. Обсуждение Проекта Указания

### Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

8.1. Регулятор планирует внести ряд комментариев по применению процедуры ликвидационного неттинга и правок по срокам предоставления отчетности по

справедливой (оценочной) стоимости и уплаты маржевых сумм в Указание № 3253 с датой вступления 1 октября 2015. Есть риск того, что правки вступят в действие после 1 октября, в этом случае Банк России планирует выпустить информационное письмо, в котором будет уточнен порядок отчетности. В результате внесения правок в Указании НРД возможно будет вынужден внести изменения в схему спецификации форматов 3.7.

#### **Рекомендация Банка России**

Регулятор попросил, по возможности, не использовать проекты/драфты нормативных актов Банка России как руководство к действию для изменения процедур и систем на стороне участников, а дожидаться финальной версии этих документов.

Участники выразили общее мнение, что существует риск недостатка времени на разработку и тестирование систем, в случае ожидания выхода финальной версии.

- 8.2. Участники попросили уточнить корректное указание Идентификационного кода договора в Таблице 1 Приложения 2.

#### **Рекомендация Банка России**

Указывается номер договора, заключенного в целях обеспечения обязательств (договор о порядке уплаты маржевых сумм или CSA), допускается указание UTI такого договора.

- 8.3. Участники попросили уточнить порядок заполнения Таблицы 1 Приложения 2 в случае, когда договор не предполагает уплаты маржевых сумм. Необходимость указания значения – U, для таких случаев по умолчанию, даже если обеспечение по договору предусмотрено, не по стандартному договору.

#### **Рекомендация Банка России**

Информация по уплате маржевых сумм предоставляется в обязательном порядке только в случае наличия отдельного договора о порядке уплаты маржевых сумм. В случае отсутствия стандартного договора о порядке уплаты маржевых сумм НАУФОР, для отчета сведений об обеспечительных договорах для целей ликвидационного неттинга, в репозитарий направляются сведения по таблице 1 приложения 2: номер договора об обеспечении, тип и форма обеспечения заполняются символом «U». Описание признака U в новой редакции Указания предполагается следующим: «U - договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм не заключен».

- 8.4. Порядок отчетности информации по уплате плавающих маржевых сумм и справедливой стоимости в Репозитарий.

#### **Рекомендация Банка России**

Информация об уплате плавающих маржевых сумм обязательно предоставляется при наличии отдельного стандартного договора в соответствии со стандартной документацией НАУФОР. В случае заключения договора о порядке уплаты маржевых сумм не по стандартам НАУФОР информация, также может добровольно предоставляться в Репозитарий.

- Информация о плавающих маржевых суммах предоставляется по форме анкеты СМ092 по всем сделкам, обеспеченным в рамках одного договора о порядке уплаты маржевых сумм (в рамках одного генерального соглашения). Этот отчет предоставляется в течение 5 рабочих дней месяца следующего за месяцем, в котором возникло требование/обязательство по выплате маржевых сумм (уточненная информация по порядку отчетности ожидается в новом Указании до 1 октября). В случае неоднократного возникновения требования/обязательства по выплате маржевых сумм в течение месяца, эти события предоставляются в рамках отдельных отчетов по форме СМ092 с указанием даты возникновения обязательства. НРД доработает анкету для обеспечения возможности принимать сведения о всех внутримесячных выплатах маржевых сумм в одном файле. Одновременно с этим, участник имеет возможность/право предоставлять информацию отдельно по каждому событию, связанному с уплатой маржевых сумм, в течение трех рабочих дней с

даты события.

- Информация о справедливой (оценочной) стоимости предоставляется по форме анкеты СМ094 как в одном отчете одной суммой по открытым договорам, так и отдельными отчетами по каждому открытому договору. Данная информация должна предоставляться не позднее 5 рабочих дней следующего за месяцем, в котором произведена переоценка, по состоянию на последний рабочий день указанного месяца или на дату переоценки (уточненная информация по порядку отчетности ожидается в новом Указании до 1 октября). Информация в Репозитарий предоставляется в случае заключенного отдельного договора о порядке определения справедливой (оценочной) стоимости или в соответствии с бухгалтерским учетом участника (при наличии такого договора/при определении справедливой стоимости в бухгалтерском учете). В случае, если справедливая стоимость не определена в учетных системах участников, отчетность в Репозитарий не предоставляется.

В случае, когда дата исполнения договора выпадает на внутримесячную дату, сведения о справедливой стоимости по итогам месяца не предоставляются. В случае, когда требования по выплате маржевой суммы возникли в последний рабочий день месяца, но платежи еще не перечислены, сведения предоставляются по итогам месяца, в котором возникли требования/обязательства.

Сведения о маржевых суммах и справедливой стоимости не проходят сверку со встречным сообщением и должны заноситься в реестр независимо друг от друга.

- 8.5. Вопрос по поводу жизненного цикла анкеты СМ094 и заполнению блока Collateral в анкете договора.

#### **Рекомендация Банка России**

Анкета СМ094 может формироваться по каждому открытому договору на отчетную дату или по пулу открытых договоров в рамках одного генерального соглашения. Каждый месяц подается новая анкета СМ094 с информацией по справедливой стоимости по каждому открытому договору; изменения к анкетам, направленным в предыдущем месяце не подаются.

При регистрации информации о Типе и Форме обеспечения в анкете договора, в качестве идентификационного кода договора указывается номер договора, заключенного в целях обеспечения обязательств (договор о порядке уплаты маржевых сумм или CSA). Даты включения/исключения договоров в/из портфеля не указываются - будут удалены из формата.

## **9. Предложения участников по доработкам ПО Репозитария**

### **Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы**

- 9.1. Участники попросили прокомментировать подход по отчетности маржевых сумм и справедливой стоимости в отношении сделок РЕПО.

#### **Рекомендация Банка России**

Информация по отчетности маржевых сумм и справедливой стоимости в отношении сделок РЕПО не предоставляется в Репозитарий.

- 9.2. Возможное требование по переходу участников на стандарты НАУФОР.

#### **Комментарий Банка России**

Регулятор не планирует вводить обязательное требование по использованию стандартной документации НАУФОР.

## **10. Прочие вопросы**

### **Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы**

Обсуждался подход Репозитария к исправлению ошибок в промышленной среде и пожелания участников по порядку внедрения обновленного ПО.

#### **Рекомендации РГ**

Уменьшить количество версий ПО «ЛУЧ». Заблаговременно сообщать об обнаружении критических ошибок, направляя уведомительное письмо участникам Рабочей группы. Отводить на внедрение исправленного ПО минимум одну неделю с момента публикации новой сборки ЛУЧа на сайте НРД для его ввода в эксплуатацию.