

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

Дата проведения заседания: 8 июня 2016 г. (среда)

Время: 10:00 – 12:00

1 Порядок тестирования участниками модернизированной структуры отчетности

Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

1.1 Тестовый контур Репозитария доступен для тестирования новых форматов версии 4.2 с 28 апреля 2016г. Для участия в тестировании: настройки тестового профайла(ов) для своей компании и тестовых контрагентов, подключения Web-кабинета и файлового шлюза, участникам необходимо направить запрос на soed@nsd.ru с копией сотрудников операционного управления.

При возникновении ошибок/вопросов/предложений необходимо обращаться на soed@nsd.ru или repository@nsd.ru. Для эскалации необходимо обращаться на mikhalyak@nsd.ru и(или) tiurin.mn@nsd.ru.

При оформлении запроса необходимо указывать свой репозитарный код, подробное описание ошибки с приложением сообщений в формате xml и(или) скриншота, а также версию тестового контура – PL, GEUST или промышленный контур - ПРОМ. В зависимости от типа запроса, ему будет присвоен уровень приоритета, решение запроса может занимать от 1 до 3 дней в зависимости от сложности и уровня приоритета.

Рекомендации рабочей группы:

Более оперативно отвечать на запросы, направленные на soed@nsd.ru.

1.2 Участники отметили недостаточно высокую скорость НРД в решении запросов, а также отсутствие информации о недоступности тестовых контуров заблаговременно, а не по факту обращения в НРД.

Рекомендации НРД:

Для приоритизации запросов необходимо эскалировать на контакты mikhalyak@nsd.ru и(или) tiurin.mn@nsd.ru.

Информирование участников с помощью публикации новости происходит в случае недоступности контуров более одного дня, если сбой контура удастся решить в течение операционного дня, новость не публикуется. В тоже время, в случае появления информации об остановке работы контура, участникам рекомендуется направлять запрос по контактам, указанным в пункте 1.1., обработка и решение такого запроса будет осуществляться в приоритетном порядке.

2 Изменение форматов 4.2 в релизе 39

Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

2.1 На основании пожеланий участников НРД предложил рассмотреть введение обязательности заполнения полей в формате сообщений 4.2:

- Поле executionVenueType «Место заключения сделки»
- Порядок указания дат: start/endAgreementDate
- Порядок указания типа договора nonStandardTerms

Рекомендации рабочей группы:

Не вводить обязательность для заполнения полей.

До конца августа участникам необходимо провести анализ продуктов, отчетность по которым они направляют в Репозитарий для обсуждения обязательности заполнения полей start/endAgreementDate на одной из Рабочих групп.

Рекомендации НРД:

Для поля executionVenueType «Место заключения сделки» признак сверки будет изменен на afr. Также, поле будет удалено из анкеты СМ016.

Для указания типа договора nonStandardTerms будет введена проверка на серверной части Репозитария: либо указывается nonStandardTerms со значением TRUE, либо указывается признак генерального соглашения - linkID.

3 Bulk-отчетность: открытые вопросы

Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

- 3.1 Для корректного формирования отчетности по анкетам СМ083-СМ085 необходимо следовать рекомендациям в инструкции, опубликованной на сайте НРД.

Подача анкет осуществляется только через Файловый шлюз, без возможности их редактирования в Web-кабинете.

Регистрация договоров, указанных в анкетах происходит только в одностороннем порядке.

Информация о регистрации сообщения и договоров в реестре доступна в Web-кабинете, а также направляется через файловый шлюз.

Рекомендации рабочей группы:

Отсутствуют

- 3.2 Ответы на открытые вопросы участников содержатся в Приложении 1 к Протоколу.

4 Заявление о назначении ИЛ – анкеты СМ016

Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

- 4.1 С 27 июня 2016 г. полномочия о предоставлении информации в Репозиторий будут зафиксированы путем поданных Заявлений по форме анкеты СМ016. Если участник не подал анкету СМ016, то по каждому своему репозитарному коду участник будет выполнять функции информирующего лица самостоятельно. В случае подачи анкеты СМ016, Репозитарий зафиксирует указанные полномочия (подтвержденные или неподтвержденные Информирующим лицом) в базе данных, таким образом, дальнейшее изменение полномочий или назначение Информирующих лиц будет происходить посредством СМ016.

Инструкция по предоставлению анкеты СМ016 размещена на сайте НРД.

Рекомендации рабочей группы

Изменить логику указания признаков в анкете СМ016 для отчетности анкет СМ092, СМ094: указывая в поле «Тип продукта» значение «ALLD», клиент уполномочивает Информирующее лицо отчитывать в Репозитарий все анкеты ГС и анкеты договоров, за исключением полномочий по анкетам СМ092 (Отчет об уплате маржевых сумм) и СМ094 (Отчет о расчете справедливой (оценочной) стоимости). Наличие полномочий по данным отчетам, определяется в соответствии с признаком «Да», указанным в полях «Отчет об уплате маржевых сумм» и «Отчет о расчете справедливой (оценочной) стоимости».

- 4.2 Ответы на открытые вопросы участников содержатся в Приложении 1 к Протоколу.

5 Дополнительные доработки по проекту Репозитарий 2.0 и прочие вопросы

Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

- 5.1 Дополнительные доработки по проекту Репозитарий 2.0 будут подробно обсуждены на следующей Рабочей группе.

- 5.2 Ответы на открытые вопросы участников содержатся в Приложении 1 к Протоколу.

Приложение 1

Список вопросов для обсуждения на заседании Рабочей Группы

1. Порядок тестирования участниками модернизированной структуры отчетности

1.1. Вопрос об оповещении репозитарием участников о статусах тестовых контуров.

Просим НРД предусмотреть порядок оповещения всех заинтересованных лиц об актуальных статусах тестовых контуров (PL, GUEST). Заблаговременное извещение о сроках и продолжительности регламентных работ, процедурах обновлений тестовых контуров, и возникшими в следствие этого проблемами, а также о произошедших сбоях, что позволит всем участникам опытной эксплуатации заранее планировать процессы по тестированию на своей стороне. На текущий момент актуальную информацию о недоступности тестовых контуров можно получить только при обращении в службу технической поддержки НРД.

Ответ НРД: будет учтено при планировании работы и поддержке тестовых контуров.

1.2. Единый общий стандартный формат файлов примеров Bulk-формата по каждой форме анкеты только с обязательными для отчетности колонками для заполнения:

- для автоматизации необходимо чтобы примеры заполненные файлов Bulk-форматов содержали полный состав всех обязательных полей, а заполненными были только обязательные поля, необходимые для отчета соответствующего типа сделки
- заключение сделки с участником репозитария 1 стор. отч.;
- заключение сделки с участником репозитария 2-стор. отч.;
- заключение сделки с НЕ участником репозитария;
- внесение изменений в ранее отчитанную сделку с участником репозитария 1 стор. отч.;
- внесение изменений в ранее отчитанную сделку с участником репозитария 2-стор. отч.;
- внесение изменений в ранее отчитанную сделку с участником репозитария НЕ участником репозитария).

Эти единые файлы заполненных анкет-примеров необходимы, т.к. у каждого участника, который будет отчитывать свои полномочия и типы контрагентов, но предусмотреть все варианты необходимо на этапе автоматизации, т.к. срок отчетности в боевом режиме всего 3 дня..

В случае наличия ошибок по регистрации не просто присылать сообщение, в котором указывается ошибка, но и выделять ошибки в отправленной нами анкете.

Ответ НРД: на сайте НРД представлены общие примеры заполнения полей в сообщениях. Если участнику необходимо сформировать сообщения для конкретного бизнес-кейса, необходимо воспользоваться: Web-кабинетом или Альбомом экранных форм, размещенных на сайте <http://repository.nsd.ru> по адресу <http://repository.nsd.ru/services/printforms>. В качестве вспомогательной информации по заполнению полей можно воспользоваться рекомендациями на сайте <http://repository.nsd.ru>.

1.3. В данный момент при наличии ошибок в первый раз мы узнаем только о первой ошибке и только при повторной регистрации о 2-ой ошибке.

Необходимо реализовать получение сразу в первом сообщении репозитария об отказе всех ошибок списком, которые не позволяют зарегистрировать анкету, т.к. по проекту Указания ЦБ если сделка не зарегистрирована после 2-ой попытки, последующая регистрация - это уже нарушение сроков.

Ответ НРД: функционал будет доработан в ближайших релизах, согласно релизной политики НРД.

1.4. Возможность сразу через WEB-кабинет отправлять сообщения со скринами ошибок и файлами анкет на ИТ Репозитария НРД

Ответ НРД: данная функция не предусмотрена в Web-кабинете, для оформления запросов необходимо пользоваться стандартной процедурой.

1.5. Добавление в колонки табличных отчетов или колонки реестров Договоров/Зарегистрированных контрактов:

- номера сообщения отправленного нами в Репозитарий
- номера сообщения от репозитария о принятии анкеты
- номера сообщения от репозитария о регистрации анкеты

Сейчас эти данные не присутствуют в строке со сделкой в WEB-кабинете, и можно увидеть только по конкретной сделке.

Ответ НРД: табличный отчет будет доработан в ближайших релизах, согласно релизной политики НРД.

1.6. Планируются ли еще изменения в формате сообщений 4.2 до момента внедрения?

2. Vult-отчетность: открытые вопросы

2.1. Возможно ли в одном файле Vult-отчета отчитывать (через загрузку в WEB-кабинете черновики) и заключение сделок и внесение изменений в ранее отчитанные сделки (разными строками)?

Например в СМ041:

- 1-я строка - сделка заключение Репо технического с участником Репозитария
- 2-я строка - сделка заключение Репо с открытой датой с не участником Репозитария
- 3-я строка - внесение изменений в отчитанную ранее сделку Репо с открытой датой

Ответ НРД: в Vult-отчете возможно указание первичной регистрации анкеты договора, а также анкеты о состоянии обязательств по договорам.

2.2. Договоры, отчитанные в балк-формате вносят в реестр договоров?

Ответ НРД: Да.

3. Заявление о назначении ИЛ – анкета СМ016

3.1. Возможность редактировать СМ016, полученное от контрагента – сейчас вариант либо принять, либо отказать,

а также возможность редактировать СМ016, направленное со своей стороны, сейчас ни редактировать, ни отозвать возможности не предоставлено. Это вызывает ряд сложностей.

В случае необходимости внесения изменений в связи с несогласием по предоставленным полномочиям возникает необходимость согласовывать такие изменения по телефону, email, что затрудняет процесс регистрации СМ0116.

Ответ НРД: участникам рекомендовано перед формированием анкеты СМ016, предварительно, согласовывать параметры полномочий с информирующим лицом. Для повышения прозрачности механизма назначения информирующего лица была разработана упрощенная схема, предполагающая согласование либо отказ в согласовании, по аналогии с согласованием анкет договоров. При отказе в согласовании, у информирующего лица есть возможность в запросе на согласование указать причину отказа, которая будет доступна участнику.

3.2. Прошу скорректировать инструкцию по заполнению СМ016 в части описания полномочий по предоставлению отчета об уплате маржевых сумм и отчета о расчете справедливой стоимости.

В настоящее время по инструкции флаг «**да**» в поле отчет об уплате маржевых сумм может быть указан только в том случае, если в поле тип документа указано значение **master agreement**, НО при указании **ALLD** (включает отчет об уплате маржевых сумм и отчет о расчете справедливой стоимости), как выяснилось опытным путем при регистрации СМ016 с контрагентами, можно также проставлять флаг «**да**» при указании **ALLD**, дополнительно блок с **master agreement** в этом случае включать некорректно.

Ответ НРД: изменения были внесены в инструкция по заполнению СМ016.

3.3. Возможность направлять анкету СМ016 отдельно по каждому ИЛ.

Ответ НРД: Нет, для повышения прозрачности механизма назначения информирующего лица, участнику необходимо подавать одну анкету с перечислением всех информирующих лиц и параметров по их отчетности. Каждая новая анкета будет являться обновлением предыдущей.

4. Прочие вопросы

4.1. В настоящее время отсутствует возможность редактирования анкеты СМ093 после 3-х дней с момента ее отправки в НРД. Планируется ли доработка, позволяющая направить изменения в анкете в любое время?

Ответ НРД: Редактирование анкеты СМ093 не предусмотрено. Для изменения статуса обязательств по договору, необходимо подавать новую анкету СМ093.

4.2. В каком режиме будет работать ПО Луч после 28 июня 2016г? В какие сроки предполагается отключение ПО Луч? Возможно ли продлить использование ПО до 01 января 2017г?

Ответ НРД: ПО ЛУЧ после 27 июня 2016г. будет работать только в режиме авто-импорт экспорт. Продление использование ПО ЛУЧ предполагается до момента обновления схемы форматов 4.3, по текущей дорожной карте конец октября 2016г.

4.3. Каковы сроки предоставления информации по разовым сделкам? Есть ли единое понимание участников рынка?

Ответ НРД: просьба обращаться в Банк России

4.4. Каковы последствия для сторон и их информирующих лиц, когда:

стороны не договорились о формирующем лице кода UTI и каждая сторона решила формировать такой код самостоятельно, при условии, что обе стороны являются лицами обязанными направлять сведения в репозитарий?

стороны договорились о формирующем лице кода UTI согласно алгоритму, представленному в Указании ЦБ, но при неисполнении этим лицом своей обязанности присвоить такой код, в согласованный сторонами срок, другая сторона получает право сформировать код UTI самостоятельно?

обе ситуации будут вести к задвоению предоставления информации по сделкам.

Ответ НРД: просьба обращаться в Банк России

4.5. Будут ли зарегистрированы в Журнале учета входящих сообщений анкеты, направленные без кода UTI?

Ответ НРД: Да.

4.6. Вопрос по доработке выписок, предоставляемых репозитарием клиентам.

Необходимо доработать выписки, предоставляемые репозитарием по запросу клиентов, добавив в них дополнительные параметры отбора, позволяющих запрашивать информацию по любому контрагенту, за любой период времени, по любому ГС, при возможности выбора одновременно нескольких параметров. Также необходимо иметь возможность получения сведений только о зарегистрированных сделках, дата исполнения которых еще не наступила.

Ответ НРД: доработка запланирована в конце ноября 2016 г.

4.7. Когда НРД планирует предоставить клиентам функционал, позволяющий генерить УТИ код в Web-кабинете Репозитария?

Ответ НРД: функционал реализован и доступен в тестовой версии Web-кабинета. В промышленной среде функционал станет доступен с 27 июня 2016 г.