

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

Дата проведения заседания: 24 августа 2016 г. (среда)

Время: 10:00 – 13:00

1 | Изменение форматов 4.3 – 4.4 в релизах 41 – 42 (до конца 2016 г.)

Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

1.1 Для приведения в соответствие форматов Репозитария НРД с изменениями в Указании 4104-У, Репозитарий НРД обновил справочники в схеме форматов 4.3. Анализ изменений содержится в презентации, озвученной на заседании. Схема является необязательной для установки на стороне участников, обновление форматов запланировано на дату вступления нового Указания 4104-У в силу (дата не определена ввиду процесса регистрации Указания в Минюсте).

Рекомендации рабочей группы:

Своевременно проинформировать участников о дате регистрации и дате вступления Указания в силу.

1.2 В рамках завершения проекта Репозитарий 2.0, планируется последнее обязательное обновление схемы форматов 4.4 в конце ноября 2016г. Доработки в схеме затронут:

- Новый тип операции для автоматизации коррекции информации в дерегистрированных договорах и отчетах в реестре;
- Функционал автоматического закрытия договоров в реестре;
- Дополнительные фильтры в запросе выписки RM004
- Прекращение поддержки репозитарных процессов в ПО «ЛУЧ».

Участникам был представлен обзор планируемых изменений.

Рекомендации рабочей группы:

Для механизма автоматического закрытия договора требуется убрать признак обязательной сверки для элемента automaticExecution, чтобы указание признака одной из сторон не приводило бы к отказу в регистрации договора в реестре. При этом, обе стороны должны получать информацию в RM001 о наличии признака в извещении, также информация должна быть доступна в интерфейсе Web-кабинете Репозитария НРД.

2 | Внедрение новых сервисов

Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

2.1 Для целей снижения риска претензий со стороны регулятора и повышения качества предоставляемой в Репозитарий НРД, с 1 ноября планируется к внедрению сервис форматно-логического контроля, который позволит контролировать:

- сроки по предоставленной отчетности в Репозитарий НРД;
- отклонение указанной процентной ставки в анкете договора;
- отклонение указанного курса от официального курса Банка России в анкете договора.

Участникам был предоставлен обзор по сервису, детальная информация в презентации к заседанию.

Рекомендации рабочей группы:

Предоставить детальное описание контролей.

3 | Отключение ПО «ЛУЧ»

Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

3.1 В рамках общей стратегии НРД по развитию электронного взаимодействия планируется прекращение поддержки репозитарных процессов в ПО «ЛУЧ».

Прекращение поддержки запланировано вместе с процессом перехода на новые форматы 4.4. в ноябре 2016г.

Рекомендации рабочей группы:

Отсутствуют

4

Изменение наименования файла сообщения НРД

Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

4.1 Репозитарий НРД просит согласовать возможность увеличения разрядности в наименовании файла исходящего сообщения Репозитария НРД до 25 символов.

Рекомендации рабочей группы

Согласованная позиция участников будет предоставлена на следующей Рабочей группе.

5

Прочие вопросы

Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

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

Приложение 1

Список вопросов для обсуждения на заседании Рабочей Группы

1. Вопросы по web-кабинету и файловому шлюзу

1.1 Технический Администратор

При подключении в Заявке на обеспечение ЭДО требуется указать сотрудника организации, на которого будут возложены функции Технического администратора, при этом объем его функционала устанавливается Руководством пользователя кабинета.

В интерактивном Руководстве пользователя на сайте ITGlobal указано, что тех. администратор выполняет следующие функции:

- создание и редактирование учетных записей и ролей (добавление, изменение, редактирование, удаление)
- просмотр результатов работы системы (журнал операций, уведомления системы, фоновые задачи, настройка режима импорта),
- создание и редактирование дополнительных ролей пользователей.

При этом, в Заявку можно включить только сотрудника с действующей доверенностью на подписание ЭД при репозитарном обслуживании в СЭД НРД.

Сопоставив функции и требования к Техническому администратору, у нас возник вопрос для чего тех. администратору с указанными функциями доверенность, если никаких ЭД он не может выполнить в силу своей роли – ведь он именно технический администратор. Кроме того, в рамках нашей организационной структуры такие функции технического администрирования обычно выполняет сотрудник ИТ-подразделения, тогда как формирование и отправку/получение ЭД выполняет, сотрудник казначейского бэк-офиса, действительно обладающий требуемой доверенностью.

По нашему мнению это не правильно и было бы хорошо эту «странность» исправить. Если позволите, вот правильная (в нашем понимании) «аналогия»: у коллег по группе Московской биржи, в Банке НКЦ при подключении к Вэб-Клирингу в составе Заявки на присоединение не требуется наличия действующей доверенности на технических специалистов, но их контактные данные необходимо указать в составе Заявки для последующего направления в их адрес инструкций по порядку подключения и настройки.

Ответ НРД: для решения вопроса, на стороне НРД была инициирована доработка новой области действия в системе ЭДО для технического администратора. Доработка позволит ограничить отправку и получение сообщений в Web-кабинете техническим администратором, а также ограничит его права по доступу к бизнес-информации в Web-кабинете. Доработка запланирована на конец 2016г. – начало 2017г.

1.2 Доработка интерфейса web-кабинета

Необходимо добавить отображение номеров входящих сообщений от участников, номеров регистрации в НРД в журнале учета входящих сообщений, номеров внесения записей о регистрации в табличных частях (отдельными колонками) разделов "Зарегистрировано", "Договоры", "Отправленные".

Ответ НРД: пожелание участника зафиксировано, НРД вернется с комментариями.

1.3 Настройка web-кабинета

К вопросу обсуждения работы web-кабинета репозитария мы хотели бы обсудить следующие моменты:

- Затруднена диагностика ошибок – сообщения web-кабинета не информативны.
- Инструкции по установке на сайте (Java версии web кабинета) устаревшие, не содержат моментов, критичных для работоспособности программы.
- На рабочем месте с полностью настроенными криптографией Валидата и рабочим местом ПО «Луч», тем не менее, web-кабинет не работает.
- Поддержка криптографии осуществляется Биржей, ПО web-кабинета – НРД, что приводит иногда к расхождению в рекомендациях.
- Используемая Биржей криптография Валидата конфликтует с используемой нами КриптоПро.

Ответ НРД: в НРД была организована отдельная рабочая группа для решения вопросов участника, в ближайшее время НРД вернется с рекомендациями.

1.4 Общие вопросы по web-кабинету и файловому шлюзу

1.4.1 Мы хотели бы вынести на обсуждение вопросы об имеющихся проблемах в части информирования участников и обсудить планы по доработкам web-кабинета. Вопрос ввиду возникшей, на прошлой неделе, ситуации с несвоевременным отражением информации, о смене сертификатов, на сайте НРД.

Ответ НРД: для решения вопроса, на стороне НРД была инициирована заявка на доработку Web-кабинета для получения рассылки информационных писем.

1.4.2 Как организовать взаимодействие через веб-сервис НРД? Есть инструкция по использованию этого канала? Как совместить использование шлюза и веб-кабинета? Есть инструкция, описание ограничений при совмещении каналов?

Ответ НРД: просим Вас направить вопросы на soed@nsd.ru

1.4.3 В процессе работы возникают сложности с подтверждениями запросов отдельных документов, например Товарный форвард (СМ051). Запрос, полученный через web-кабинет от контрагента, оказывается не валидным и его невозможно подтвердить и отправить. На наш взгляд, не валидные сообщения должны сразу же отказываться НРД, а не пересылаться контрагентам.

Ответ НРД: для решения вопроса Репозитария НРД внедрит проверку на серверной части на обязательное указание элемента "nsdext:CommodityBasket" в блоке nsdext:commodity.

1.4.4 На данный момент в веб-кабинете для просмотра доступны только последние данные о договоре и нет возможности просмотреть историю изменений, вносимых в параметры анкеты.

Для удобства пользователей просьба рассмотреть возможность отображение всех цепочек сообщений, связанных с договором, в виде сводной таблицы (содержащей номера соответствующих сообщений, даты и так далее) и с возможностью просмотра/печати/скачивания соответствующего сообщения в печатном виде и в формате xml.

Ответ НРД: в НРД была организована отдельная рабочая группа для решения вопросов участника, в ближайшее время НРД вернется с рекомендациями.

2. Доработка справочника участников

Возможность получения актуального справочника участников репозитория в ежедневной выписке (в конце опердню) в формате csv.

Ответ НРД: на следующей рабочей группе участники согласуют варианты для получения справочника участников Репозитария.

3. Доработка порядка двусторонней отчетности

В текущей реализации при регистрации анкеты двусторонним методом согласования возможны случаи получения отказа по причине отсутствия доступа к отчетности ИЛа второй стороны (ИЛ не назначен (не определен) по СМ016 либо отсутствует ЭДО ИЛа второй стороны). Таким образом, первая сторона не имеет возможности исполнить свои обязательства по отчетности справедливой стоимости (СМ094) и статусов исполнения обязательств (СМ093) по данным сделкам, несмотря на то, что первая сторона исполнила свои обязательства по отчетности самих сделок (данные договоры попали в ЖВС).

На данный момент первой стороне необходимо дождаться каких-то действий от своего контрагента и еще раз отправить анкету на регистрацию – это увеличивает размер выставяемого счета за услуги репортинга (так как тарифицируется каждое входящее сообщение) и возможен риск просрочки по исполнению обязательств по отчетности СМ093 и СМ094.

Предлагаемые решения:

- Получение репозитарного номера договора (анкеты) в первом сообщении RM003 (INCOMING_DOC);
- Перевод анкет в статус «ожидание» в аналогичных ситуациях (а не отказ в регистрации), чтобы исключить необходимость повторного отправления сообщения первой стороной после определения Ила второй стороны;
- Реализовать возможность предоставления отчетов о статусах (СМ093) и отчета о СС (СМ094) по таким сделкам.

Ответ НРД: в рамках дополнительных доработок по проекту Репозитарий 2.0 будет доработан механизм, позволяющий предоставлять отчеты по договорам в статусе отказано.

4. Доработка порядка назначения информирующих лиц с помощью СМ016

Алгоритм работы анкеты такой, что постоянно возникают проблемы:

- Нельзя внести изменения в существующую анкету, путем добавления только 1 нового лица - необходимо заново указывать каждого контрагента и его полномочия. (Трудозатратно и риск ошибки при больших объемах)
- Анкета автоматически направляется заново всем информирующим лицам, которые уже согласовали полномочия, без каких-либо комментариев (Занимает много времени проверить, почему пришел заново запрос и касаются ли изменения нас)

Ответ НРД: механизм назначения информирующих лиц был согласован с участниками Репозитария НРД, детальное описание

https://www.nsd.ru/common/img/uploaded/files/services/repository/instr_CM016_CM017.pdf

Анкета не направляется заново всем информирующим лицам, а только тем, по которым были внесены изменения.

5. Заполнение информации о плавающей ставке РЕПО

Отражение сделок РЕПО с плавающей ставкой. При заполнении регистрационной формы не удалось в полном объеме указать существенные условия сделок, так как не смогли конкретизировать, какая именно ставка LIBOR применяется (существуют различные сроки ставок – от овернайт до 1 года).

Ответ НРД: для указания срока ставки необходимо заполнить поля *Мультипликатор периода* и *Тип временного периода*.

6. Доработка запроса выписки RM004

В какие сроки НКО ЗАО НРД планирует осуществить возможность получения выписки за определенный период в разрезе контрагента и в рамках конкретного Генерального соглашения?

В данный момент можно запросить выписку только за период, но нельзя указать определенного контрагента или генеральное соглашение (даже несмотря на то, что по формату такие поля предусмотрены). Если в поле «Генеральное соглашение» указать репозитарный номер ГС, то приходит отказ.

Ответ НРД: доработка запланирована на конец ноября 2016г.

7. Требование по отчетности в новом проекте Указания Банка России

В п. 4. проекта Указания Банка России установлено, что «юридические лица, не указанные в пункте 3 настоящего Указания, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации, являющиеся сторонами договора, указанного в пункте 1 настоящего Указания, заключенного между такими юридическими лицами, обязаны предоставлять информацию в репозитарий: о договоре, указанном в пункте 1 настоящего Указания, заключенном с 1 октября 2016 года, сумма обязательств по которому на дату заключения договора в рублях или эквиваленте в иностранной валюте, рассчитанном по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России, превышает 1 миллиард рублей;

в случае если сумма неисполненных обязательств по договорам, указанным в пункте 1 настоящего Указания, заключенным с 1 октября 2016 года, на конец каждого месяца в течение трех месяцев подряд составляет не менее 10 миллиардов рублей или эквивалента в иностранной валюте, рассчитанного по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России на дату расчета – обо всех договорах, указанных в пункте 1 настоящего Указания, заключенных начиная с первого числа месяца, следующего за последним из трех указанных месяцев».

Следовательно, в случае соответствия сделки, заключенной между юридическими лицами (корпоратами) установленным в п.4 проекта критериям у корпоратов возникает обязанность направлять информацию о таких сделках в Репозитарий.

В случае, если сделка заключена между корпоратом и лицом, состоящим в перечне обязанных направлять информацию в Репозиторий, то у корпората обязанности репортинга не возникает.

Но, согласно действующим Правилам оказания репозитарных услуг НКО ЗАО НРД уведомление об отказе направления информации в Репозиторий подразумевает отказ по всем сделкам. Вне зависимости от вида сделки или контрагента. Следовательно, корпорат, не обязанный участвовать в репортинге по сделкам, заключенным с лицом, обязанным направлять информацию, должен участвовать в репортинге.

Просим НКО ЗАО НРД рассмотреть возможность разделения репортинга для корпоратов – принятия уведомления об отказе в части сделок с лицами, обязанными предоставлять информацию, и оставления в силе возможности направления информации по сделкам, указанным в п.4 проекта Указания Банка России.

Ответ НРД: для предотвращения конфликта по отчетности сделок между профучастник - корпорат и корпорат – корпорат, Репозитарий НРД до 1 октября 2016 г. планирует провести анализ и доработку необходимых изменений в системе.

8. Другие вопросы

- 8.1 Просим включить в форматы НРД единицу измерения «грамм» для сделок с драгоценными металлами в форматы НРД.
Аргументация следующая:
Стандартной единицей измерения массы драгоценных металлов является грамм и тройская унция в соответствии с Инструкцией Банка России от 30.11.2000 N 94-И "О порядке определения массы драгоценных металлов и драгоценных камней и исчисления их стоимости в Банке России и кредитных организациях". На практике, условия договоров с драгоценными металлами не предусматривают единицу измерения dag, следовательно, требуются дополнительные трудозатраты по контролю и пересчету суммы. Кроме того, теоретически, Банк России может квалифицировать предоставление такой информации, как информации, не соответствующей условиям договора, т.е. «недоверенной» в значении части 4 статьи 15.19 КоАП. Поэтому просим включить в стандартный справочник форматов единицу измерения «грамм».

Ответ НРД: в справочник будет добавлена единица измерения «грамм».

- 8.2 Добавить возможность электронно отправлять в НРД deregistration по сделкам (доп. код в СМ093)
- 8.3 Возможность BULK отчетности по сделкам с участниками репозитария, в части РЕПО
(сейчас только для сделок с НЕ участниками)
- 8.4 Встроенный протокол состояний всех отправленных сделок (в том числе и в процессе на отправку). На тесте получение ответов «тормозит» отправку оставшихся сообщений.

Ответ НРД: 8.2 доработка для подачи коррекции изменения статуса по deregistered договорам с помощью СМ093 будет осуществлена до конца ноября 2016г.

8.3 В виду ограничений по обработке бал-формата внедрение сделок, где обе стороны являются клиентами Репозитария не планируется.

8.4 Просим направить запрос на soed@nsd.ru

Вопрос не включенный в Приложение 1 о невозможности запуска Web-кабинета Репозитария некоторыми участниками, находящимися за границей, из-за ограничения к доступу домена IT Global.

Ответ НРД: в ближайшее время Web-кабинет Репозитария НРД будет перемещен на домен *nsd.ru*.