

ПРОТОКОЛ № 30
заседания Комитета по расчетно-депозитарной деятельности и тарифам
НКО ЗАО НРД

Дата проведения заседания: 13.11.2014.

Место проведения заседания: Москва, Спартаковская, д. 12, переговорная 1.7.

Форма проведения заседания: очная (совместное присутствие для обсуждения вопросов повестки дня и принятия решений по вопросам, поставленным на голосование).

Присутствовали:

ФИО	Должность
1 Владислав Викторович Власенко	Начальник Депозитария, ОАО «МДМ Банк»
2 Игорь Викторович Железный	Заместитель директора Депозитария, ОАО «Сбербанк России»
3 Дмитрий Вигальевич Зализняк	Начальник отдела развития депозитарных услуг, КБ «Дж.П. Морган Банк Интернешнл» (ООО)
4 Анна Александровна Зубанова	Начальник Депозитария, ОАО «СЭБ Банк»
5 Дмитрий Владимирович Ишутин	Заместитель начальника Депозитарного Управления, ООО «Дойче Банк»
6 Юлия Евгеньевна Умнова	Начальник Отдела коммерческого планирования и развития, ЗАО ЮниКредит Банк
7 Алексей Владимирович Федотов	Директор, Начальник Департамента ценных бумаг, Россия и СНГ, ЗАО КБ «Ситибанк»

Отсутствовали, но прислали письменное мнение:

ФИО	Должность
1 Оксана Викторовна Маркова	Руководитель Блока Операционного развития, ВТБ Капитал

Отсутствовали:

	ФИО	Должность
1	Сергей Юрьевич Данилин	Операционный директор, ООО «Компания БКС»
2	Анатолий Александрович Матюхин	Заместитель директора департамента Депозитарий, ОАО АКБ «Росбанк»

Приглашенные:

	ФИО	Организация
1	М. Барбашина	Барклайс
2	С. Бывшев	ОАО Банк ВТБ
3	В. Волков	ООО «Дойче Банк»
4	А. Граник	КБ «Дж.П. Морган Банк Интернешнл» (ООО)
5	И. Гурова	ВТБ Капитал
6	А. Клочков	ООО «Дойче Банк»
7	К. Малинин	ООО «Дойче Банк»
8	О. Сурженко	ЗАО КБ «Ситибанк»
9	А. Шарыкин	ЗАО ЮниКредит Банк
10	К. Щербова	Барклайс

Кворум для принятия решений по всем вопросам повестки дня имелся.

Председательствующий на заседании – Д.В. Зализняк

Секретарь заседания – В.И. Беляев

ПОВЕСТКА ДНЯ ЗАСЕДАНИЯ:

- 1. Ключевые вопросы, связанные с запуском сервиса предварительной квитовки в рамках проекта «Электронный мэтчинг».**

Докладчик: С.Г. Кузьмин

ВОПРОС № 1

Ключевые вопросы, связанные с запуском сервиса предварительной квитанки в рамках проекта «Электронный мэтчинг»

Слушали: С.Г. Кузьмина

Обсуждалось:

Особенности запуска продукта (услуги) в промышленную эксплуатацию с учетом принятой в НРД релизной политики.

Ход тестирования (опытной эксплуатации) предварительной квитанки и предварительные результаты тестирования.

Особенности получения отчетов через ПО «ЛУЧ» и SWIFT.

Предложения членов Комитета в части подбора параметров поручений (инструкций) для предварительной квитанки.

Рекомендации членов Комитета:

1. При запуске 1ого этапа проекта «Электронный мэтчинг» использовать только одно расхождение для поиска потенциальных встречных поручений и не определять в качестве потенциально встречных поручения в которых «количество ценных бумаг» не совпадает.
2. Опубликовать на сайте НРД информацию об этапах запуска проекта «Электронный мэтчинг», включающих в себя в обязательном порядке:
 - Необходимость и сроки внедрения механизма Hold & Release.
 - Чёткое указание на то, что на первом этапе подключение к услуге осуществляется на уровне счёта депо и обозначение намерения внедрить возможность подключения к услуге на уровне раздела (с дополнительной проработкой на рабочей группе вопроса о возможности применения других уровней подключения, в частности на уровне поручения).
 - Необходимость и сроки внедрения функционала поиска потенциальных встречных поручений между поручениями FOP и DVP.
3. Провести дополнительный семинар для всех участников рынка с целью разъяснения целей внедрения и деталей услуги, а также стимулирования массового подключения к ней.
4. Рабочей группе продолжить обсуждение развития услуги, в частности по тем результатам обсуждения на текущем заседании, которые отдельно сформулированы в Приложении к настоящему протоколу.

Вопрос, поставленный на голосование:

Рекомендовать НРД ввести в промышленную эксплуатацию «17» ноября 2014 года функционал предварительной квитанки встречных поручений (электронного мэтчинга) с учетом особенностей и параметров, рассмотренных в Пояснительной записке к текущему заседанию. Считать введенный функционал первым этапом внедрения услуги и продолжить работу над её развитием и дополнением с учетом рекомендаций членов Комитета и рабочей группы.

Итоги голосования: «За» - 8; «Против» - 0; «Воздержался» - 1.

РЕШЕНИЕ ПРИНЯТО.

Приложение к вопросу №1 повести дня «Рекомендации, полученные в ходе заседания Комитета по расчетно-депозитарной деятельности и тарифам НРД»:

1. Обеспечить поиск потенциальных встречных поручений между поручениями FOP и DVP (код ошибки FRAP).
2. Рассмотреть на ближайшем заседании рабочей группы возможность по ограничению количества сообщений и «привязать» отправку сообщений о найденных встречных поручениях к определенным временным рамкам (например, один раз в день).
3. При поиске встречных рассматривать счет депо и раздел счета депо совместно, а не по отдельности. Рассмотреть другие возможные сочетания полей, участвующих в поиске потенциальных встречных поручений.
4. Проработать вопрос об отображении в ПО «ЛУЧ» дополнительных статусов к инструкциям (поручениям). Отображать в журнале «Принятых поручений» статус «сквитовано/несквитовано», статус поручения «для сверки/для исполнения».
5. Рассмотреть вопрос об установлении пороговых значений, при достижении которых поручения не будут считаться потенциально встречными поручениями. Установить параметры допустимых расхождений на ближайшем заседании рабочей группы.
6. Рассмотреть возможность подключения услуги «Электронный мэтчинг» не только на уровне счета депо, но и на уровне раздела счета депо. Рассмотреть на рабочей группе поход, когда необходимость предварительной квитанции устанавливается на уровне отдельного поручения.
7. Направлять отчет только инициатору поручения об отсутствии встречного поручения (NMAT//CMIS), если единственное / последнее потенциальное встречное поручение было сквитовано или отменено.
8. Проработать вопрос об унификации сроков исполнения поручений на расчеты и поручений на отмену, переданных через систему СВИФТ и через систему ЛУЧ.
9. Отказаться от квитанции по основанию. Перейти на использование даты расчетов вместо периода исполнения. Унифицировать квитанцию и обеспечить поиск потенциальных встречных поручений между поручениями с референсом и поручениями без референса.
10. Рассмотреть вопрос об уведомлении о возможном дубликате поручения в системе НРД (PODU)
11. Рассмотреть вопрос о введении статусов расчетов PEND/PENF.
12. Рассмотреть подход к поиску встречного поручения по методу один к одному или методом FIFO согласно предложению представителя Дойче банка.