

**Небанковская кредитная организация закрытое акционерное общество
«Национальный расчетный депозитарий»
(НКО ЗАО НРД)**

ПРОТОКОЛ № 4/2014

**заседания Комитета по репозитарной деятельности при Правлении НКО ЗАО НРД
(Комитет)**

Форма проведения заседания: заочное голосование (без совместного присутствия членов Комитета для обсуждения вопросов повестки дня и принятия решения по вопросам, поставленным на голосование).

Дата и время подведения итогов голосования: 20 июня 2014 года, 15 час. 00 мин.

Место подведения итогов голосования: 105066, г. Москва, ул. Спартаковская, д. 12.

Дата составления протокола: 27 июня 2014 года.

Члены Комитета, принявшие участие в голосовании:

- 1 Бральнин Александр Владимирович
- 2 Пьянова Татьяна Константиновна
- 3 Козырева Кира Владимировна
- 4 Пархоменко Евгения Сергеевна
- 5 Глушкова Ольга Вадимовна
- 6 Корсун Евгения Яковлевна
- 7 Преснякова Марина Игоревна
- 8 Фрадкина Елена Валерьевна
- 9 Четверухин Александр Алексеевич
- 10 Усачева Арина Львовна
- 11 Спыну Руслан Константинович
- 12 Воропаева Евгения Михайловна

Члены Комитета, не принявшие участие в голосовании:

- 1 Юрятина Виктория Викторовна
- 2 Рябцева Екатерина Александровна
- 3 Лукашов Анатолий Александрович
- 4 Ли Александр Романович
- 5 Борзунова Эльвира Геннадиевна
- 6 Корженевская Елена Владимировна
- 7 Орлов Алексей Константинович
- 8 Грицаюк Ольга Юрьева

Заочное голосование Комитета проведено по решению Председателя Комитета Спыну Р.К. в соответствии с п. 6.6. Положения о Комитете.

Вопрос 1 повестки дня:

О перечне сведений, подлежащих обязательному включению в реестр договоров, заключенных на условиях генерального соглашения

Общее число членов Комитета НКО ЗАО НРД – 20.

Число членов Комитета НКО ЗАО НРД, принявших участие в голосовании по данному вопросу – 12.

Кворум для принятия решения имелся.

Вопрос, поставленный на голосование:

Утвердить «Рекомендации Комитета по репозитарной деятельности при Правлении НКО ЗАО НРД по внесению изменений/уточнений в Приложения к Указанию Банка России от 30 апреля 2014 года № 3253-У».

Итоги

голосования:

«за» - 10 (Четверухин А.А., Спыну Р.К., Бральнин А.В., Усачева А.Л., Пархоменко Е.С., Козырева К.В., Корсун Е.Я., Пьянова Т.К., Фрадкина Е.В., Воропаева Е.М.);

«против» - 2 (Преснякова М.И., Глушкова О.В.);

«воздержался» - 0.

Решение принято большинством голосов членов Комитета, принявших участие в заочном голосовании.

Принятое решение:

Утвердить «Рекомендации Комитета по репозитарной деятельности при Правлении НКО ЗАО НРД по внесению изменений/уточнений в Приложения к Указанию Банка России от 30 апреля 2014 года № 3253-У».

Комментарий Четверухина А.А. (ООО «Барклайс Капитал»): За утверждение рекомендаций с учётом правок в приложенном файле Ms Excel.

Комментарий Преснякова М.И. (ООО «Дж.П.Морган Банк Интернешнл»): Комментарии изложены в документе об Изменениях вносимых в Указание Банка России

Комментарий Пархоменко Е.С. (ООО «Меррилл Линч Секьюритиз»): За утвержденные рекомендации с учетом правок участников

Комментарий Козырева К.В. (ЗАО АКБ «НКЦ»): За утверждение рекомендаций с учётом правок в приложенном файле Ms. Excel

Комментарий Корсун Е.Я. (ОАО «Брокерский дом «Открытие»): Замечания и правки в приложенном файле Ms. Excel

Комментарий Глушкова О.В. (ОАО «Сбербанк России»): в текущей редакции Приложение 4 (обеспечение) мы принять не можем. В случае его удаления из предлагаемых изменений (то есть оставить блок в том виде, в котором он есть в текущей редакции Указания 3253-У) мы готовы проголосовать за внедрение остальных изменений. Также мы не сможем в ближайшее время реализовать переход на T+1 (Приложение 1, строка 73). Для нас оба момента критичны. Причины подробно изложены в сопроводительном e-мэйле.

Вопрос 2 повестки дня:**Об отказе технической поддержки Конвертора сообщений xml <-> FrML**

Общее число членов Комитета НКО ЗАО НРД – 20.

Число членов Комитета НКО ЗАО НРД, принявших участие в голосовании по данному вопросу – 12.

Кворум для принятия решения имелся.

Вопрос, поставленный на голосование:

Осуществить с 01.10.2014 отказ от технической поддержки Конвертора сообщений xml <-> FrML в связи с полным переходом клиентов Репозитория на формат FrML, а также с необходимостью минимизации трудозатрат со стороны НРД, требуемых для поддержания Конвертора. Опубликовать на сайте НРД соответствующее информационное письмо.

**Итоги
голосования:**

«за» - 12 (Четверухин А.А., Спыну Р.К., Преснякова М.И., Бральнин А.В., Усачева А.Л., Пархоменко Е.С., Козырева К.В., Корсун Е.Я., Пьянова Т.К., Глушкова О.В., Фрадкина Е.В., Воропаева Е.М.);

«против» - 0;

«воздержался» - 0.

Решение принято большинством голосов членов Комитета, принявших участие в заочном голосовании.

Принятое решение:

Осуществить с 01.10.2014 отказ от технической поддержки Конвертора сообщений xml <-> FrML в связи с полным переходом клиентов Репозитория на формат FrML, а также с необходимостью минимизации трудозатрат со стороны НРД, требуемых для поддержания Конвертора. Опубликовать на сайте НРД соответствующее информационное письмо.

Вопрос 3 повестки дня:**О порядке перепривязки зарегистрированных в реестре репозитория договоров при подписании нового генерального соглашения**

Общее число членов Комитета НКО ЗАО НРД – 20.

Число членов Комитета НКО ЗАО НРД, принявших участие в голосовании по данному вопросу – 11.

Кворум для принятия решения имелся.

Вопрос, поставленный на голосование:

1. Новое генеральное соглашение, заключаемое вместо действовавшего ранее, регистрируется как изменение (amendment) к старому (ранее зарегистрированному) генеральному соглашению с приложением сканированной копии. В этом случае нет возможности присвоить новому генеральному соглашению уникальный ID.
2. Не закрывать старое генеральное соглашение до исполнения всех действующих в рамках него договоров, параллельно зарегистрировать новое генеральное соглашение, в рамках которого осуществлять регистрацию новых договоров.

Итоги

голосования:

«за вариант 1» - 1 (Пьянова Т.К.);

«за вариант 2» - 9 (Спыну Р.К., Преснякова М.И., Бральнин А.В., Усачева А.Л., Пархоменко Е.С., Козырева К.В., Корсун Е.Я., Глушкова О.В., Фрадкина Е.В.);

«против всех вариантов» - 0;

«воздержался по всем вариантам» - 1 (Четверухин А.А.)

Решение принято большинством голосов членов Комитета, принявших участие в заочном голосовании.

Принятое решение:

2. Не закрывать старое генеральное соглашение до исполнения всех действующих в рамках него договоров, параллельно зарегистрировать новое генеральное соглашение, в рамках которого осуществлять регистрацию новых договоров.

Вопрос 4 повестки дня:

О заполнении полей «Тип маржи» (marginType) и «Коэффициент обеспечения» (marginFactor) в Анкете договора РЕПО (СМ041)

Общее число членов Комитета НКО ЗАО НРД – 20.

Число членов Комитета НКО ЗАО НРД, принявших участие в голосовании по данному вопросу – 12.

Кворум для принятия решения имелся.

Вопрос, поставленный на голосование:

1. Рекомендовать отметить элементы «Тип маржи» (marginType) и «Коэффициент обеспечения» (marginFactor) (группа элементов «Коэффициент обеспечения» - margin) неиспользуемыми (заменить признак дополнительной сверки afг на признак несверяемого поля ncf).

2. Рекомендовать указывать «Cash» в качестве значения элемента «Тип маржи» (marginType). При этом в качестве значения элемента «Коэффициент обеспечения» (margin) указывается величина, соответствующая разнице между единицей и значением дисконта (haircutValue) в форме десятичной дроби с точностью до 7 знаков после запятой.

Итоги

голосования:

«за вариант 1» - 1 (Четверухин А.А.);

«за вариант 2» - 6 (Спыну Р.К., Преснякова М.И., Усачева А.Л., Козырева К.В., Корсун Е.Я., Глушкова О.В.);

«против всех вариантов» - 0;

«воздержался по всем вариантам» - 5 (Бральнин А.В., Пархоменко Е.С., Пьянова Т.К., Фрадкина Е.В., Воропаева Е.М.)

Решение не принято

Для принятия решения вопрос выносится на дополнительное очное согласование ввиду отсутствия большинства голосов в пользу одного из вариантов.

Комментарий Четверухина А.А. (ООО «Барклайс Капитал»): Второй вариант также выглядит приемлемым. Голосую за первый на случай, если Банку России все-таки необходимо это поле.

Комментарий Козырева К.В. (ЗАО АКБ «НКЦ»): Предлагается реализовать оба варианта. Один не исключает другого. П.1 приводит рекомендации по заполнению в соответствии стандартам НФА. Но не обязывает обе стороны заполнять поле одним и тем же значением. Так как, когда у одной стороны сделки репо обеспечением в виде Cash, у другой стороны в это же время обеспечение Instrument. И обе стороны будут правы, если укажут в этом поле разное. Но в этом случае поля не должны сверяться.

Вопрос 5 повестки дня:

Утверждение рекомендаций для анкет по сделкам с ценными бумагами (СМ041-СМ048), валютным (СМ022-СМ024) и процентным сделкам (СМ031-СМ034)

Общее число членов Комитета НКО ЗАО НРД – 20.

Число членов Комитета НКО ЗАО НРД, принявших участие в голосовании по данному вопросу – 12.

Кворум для принятия решения имелся.

Вопрос, поставленный на голосование:

Утвердить рекомендаций для анкет по сделкам с ценными бумагами (СМ041-СМ048), валютным (СМ022-СМ024) и процентным сделкам (СМ031-СМ034), опубликованным на сайте Спецификации сообщений торгового репозитория НКО ЗАО НРД (<http://repository.nsd.ru/recommendations/recommendations>).

Итоги
голосования:

«за» - 9 (Четверухин А.А., Преснякова М.И., Усачева А.Л., Пархоменко Е.С., Козырева К.В., Пьянова Т.К., Глушкова О.В., Фрадкина Е.В., Воропаева Е.М.);

«против» - 0;

«воздержался» - 3 (Спыну Р.К., Бральнин А.В., Корсун Е.Я.)

Решение принято большинством голосов членов Комитета, принявших участие в заочном голосовании.

Принятое решение:

Утвердить рекомендаций для анкет по сделкам с ценными бумагами (СМ041-СМ048), валютным (СМ022-СМ024) и процентным сделкам (СМ031-СМ034), опубликованным на сайте Спецификации сообщений торгового репозитория НКО ЗАО НРД (<http://repository.nsd.ru/recommendations/recommendations>).

Комментарий Глушкова О.В. (ОАО «Сбербанк России»): при внедрении изменений, предлагаемых ЦБ, рекомендации просим доработать и обновить.

Председатель Комитета



Р.К. Спыну