

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

Тема: Очередное заседание Рабочей группы по технологическим вопросам при Комитете по репозитарной деятельности при Правлении НКО ЗАО НРД

Дата: 13 Декабря 2013 г.

Время: 15:15 – 20:00

Присутствовали: от НКО ЗАО НРД: А.Булыгин, А.Ермаков, П.Соловьев, М.Ельцов, В.Лукьянчик, Я.Ильина, Ю.Ходакова, Н.Положенцева
от ООО "АйТи Глобал" П.Корякин, А.Мешков

Повестка дня: обсуждаемые вопросы и принятые решения

1	Исключение двойного набора сообщений (о статусах, об отказах и о регистрации), направляемых клиенту, являющемуся ИЛом для обеих сторон по одной и той же сделке.
---	--

Рекомендации/решение рабочей группы:

Неудобство зафиксировано не всеми участниками.

Включить в план доработок репозитария НРД.

НРД представить информацию о возможных сроках доработок.

Срок на представление информации от НРД: 16 января 2014 г.

Приоритет доработок (1-высший, 3-низший) 3

2	Порядок формирования закрытого списка отклоненных НРД сообщений, в которых присутствуют комментарии операциониста. Проблемы с автоматизацией таких сообщений на стороне участников. Предложения по минимизации списка по двух критериям: не совпадает часть полей, сделка ошибочна. Предложения по введению поля «иное».
---	--

Рекомендации/решение рабочей группы:

Сформировать начальный список, включив значения:

- не совпадает часть полей;
- сделка ошибочна;
- ошибка в репозитарном коде;
- иное.

Участникам рабочей группы в срок до 20 декабря 2013 г. уточнить значения предлагаемого списка и при необходимости дополнить.

НРД проинформировать о сроках доработок.

Срок на представление информации от НРД: 16 января 2014 г.

Приоритет доработок (1-высший, 3-низший) 1

3	Необходимость проверки даты формирования сообщения. В настоящее время допустимый период составляет 3 календарных дня. Возможность отмены данного ограничения или увеличения до 15 календарных дней, как в условиях депозитарной деятельности, либо до более длительного срока.
---	--

Рекомендации/решение рабочей группы:

НРД до январских праздников 2014 г. реализовать контроль даты формирования сообщения из расчета 9 календарных дней.

В дальнейшем доработать контроль даты формирования сообщения исходя из 3 рабочих дней.

НРД проинформировать о сроках доработок.

Срок на представление информации от НРД: **16 января 2014 г.**

Приоритет доработок (1-высший, 3-низший) **1**

4 **Возможность указания в ответном письме участнику референсов сделок или иных ссылок, позволяющих идентифицировать ответные сообщения, при пакетной отправке в репозитарий нескольких сделок.**

Рекомендации/решение рабочей группы:

Технологическая доработка в части указания в теме или тексте сообщения ссылки на исходный messageId на стороне НРД в настоящее время невозможна ввиду ограничений в требованиях Правил ЭДО.

Вопрос требует дополнительной проработки.

Участник рабочей группы - инициатор вопроса - уточняет проблему.

НРД поставлена задача доработать интерфейс ПО ЛУЧ в части вынесения на панель "кнопки" переключения между автоматическим и ручным экспортом / импортом.

НРД проинформировать о сроках доработок.

Срок на представление информации от НРД: **16 января 2014 г.**

Приоритет доработок (1-высший, 3-низший) **3**

5 **Необходимость и приоритетность направления уведомления второму контрагенту при поступлении сообщения от первого контрагента при встречной схеме сверки.**

Рекомендации/решение рабочей группы:

Необходимость реализации, как в случае комбинированного варианта сверки.

НРД проинформировать о сроках доработок.

Срок на представление информации от НРД: **16 января 2014 г.**

Приоритет доработок (1-высший, 3-низший) **1**

6 **Действующий порядок квитовки полей, содержащих данные о валютах, порядок заполнения данных полей. Разъяснения НРД в отношении доработок действующих технологий, позволяющих квитовать анкеты вне зависимости от порядка валют.**

Рекомендации/решение рабочей группы:

Оптимизация алгоритмов квитовки в репозитарной системе НРД включена в состав проектов развития на 2014 год.

По мнению рабочей группы доработка алгоритма квитовки не носит высший приоритет (приоритетнее завершение работы над инструкциями, которые надо утвердить как Правила заполнения полей сообщений репозитария и опубликовать в составе документации на сайте НРД).

! По итогам дополнительного обсуждения на заседании Комитета по репозитарной деятельности 17 декабря 2013 г. приоритет задачи предложено повысить до 1 !

Участникам рабочей группы подготовить предложения по участию в подготовке детального задания на доработку алгоритма квитовки.

НРД проинформировать о возможных сроках доработок в части квитовки при условии совместной с участниками разработки задания.

Срок на представление информации от НРД: **16 января 2014 г.**

Приоритет доработок (1-высший, 3-низший) **1 (2)**

7 **Рекомендации по заполнению формата по сделкам, существенные параметры**

которых не фиксируются в момент заключения сделки, а определяются расчетным путем в период действия сделки. Регистрация таких сделок как general product с приложением скана.

Рекомендации/решение рабочей группы:

Общие рекомендации для сделок, формализовано не описанных в формате сообщений репозитория НРД, будут разрабатываться в январе-феврале 2014 г.

Представленные примеры условий сделок с плавающей ценой исполнения для валютных сделок были направлены на рабочую группу ISDA по формату FpML для валютных инструментов в составе предложений НРД на доработку формата FpML.

При условии положительного решения ISDA о доработке FpML аналогичные изменения будут сделаны в качестве расширений в формате НРД - заинтересованные участники смогут осуществить соответствующие доработки.

Подобный порядок предлагается использовать по всем дополнительным инструментам. В остальных случаях необходимо будет использовать формат GeneralProduct.

Участникам рабочей группы предложено направлять примеры подтверждений в рамках каждой группы внедряемых до 25 июня 2014 г. инструментов для оценки необходимости доработок формата или рекомендаций по заполнению.

Предложение одобрено рабочей группой.

Срок на представление информации от НРД: -

Приоритет доработок (1-высший, 3-низший) -

8 **Рекомендации по правилу заполнения тега: nsdext:narrativeDescription. Предложение игнорировать данное поле, если в masterAgreementType стоит что-либо отличное от OTHER.**

Рекомендации/решение рабочей группы:

Предложение использовать указанный элемент только в случае указания значения "Other" в полях типа и версии генерального соглашения.

Детальное разъяснение будет включено в составе инструкций по заполнению формата сообщений репозитория.

Срок на представление информации от НРД: **20 декабря 2013 г.**

Приоритет доработок (1-высший, 3-низший) **1**

9 **Рекомендации по правилу заполнения тега: dealtCurrency. Согласование предложенного рабочей группой подхода.**

Рекомендации/решение рабочей группы:

Рабочая группа одобрила предложение в части валютного свопа.

НРД представить инструкцию заполнения поля для валютного форварда.

Срок на представление информации от НРД: **20 декабря 2013 г.**

Приоритет доработок (1-высший, 3-низший) **1**

10 **Рекомендации по порядку заполнения полей относящихся к базовому активу, отмеченных признаком mfr, по сделкам, в которых автоматическое определение базового актива невозможно. Предложения по проработке исключений.**

Рекомендации/решение рабочей группы:

Поля, не имеющие признака обязательного заполнения, но помеченные признаком обязательной сверки, требуются к обязательному заполнению, согласно Приказу ФСФР, при наличии соответствующих параметров в условиях сделок. В связи с этим, значения, указанные в соответствующих полях, подлежат обязательной сверке.

Рекомендация принята к сведению рабочей группой.

Срок на представление информации от НРД: -

Приоритет доработок (1-высший, 3-низший) -

11 Реализация сверки русских и английских наименований из справочника. Исправление в xsd схеме признака afr по полю PartyName.

Рекомендации/решение рабочей группы:

Информация о сверке русских и английских вариантов краткого наименования стороны, взятых из справочника НРД, с представлением в подтверждении о регистрации русского варианта наименования принята рабочей группой к сведению.

Ошибка в схеме в части признака дополнительной сверки для указанного поля будет исправлена - поле partyName обязательно к заполнению и сверке.

НРД проинформировать об исправлении ошибки в схеме.

НРД проинформировать о сроках и вариантах возможных доработок в части заполнения краткого наименования на стороне НРД.

Срок на представление информации от НРД: **16 января 2014 г.**

Приоритет доработок (1-высший, 3-низший) **3**

12 Реализация на сайте НРД отображения опциональных выборов (например, «mre+afr» - опциональный).

Рекомендации/решение рабочей группы:

Данная ситуация возможна в табличных описаниях формата в случаях, когда элементы представлены в форме выбора из нескольких значений и когда сама структура выбора не является обязательной. Требуется исправление представления табличных описаний формата.

НРД исправляет табличные представления на сайте спецификации до 30 декабря 2013 г.

НРД проинформировать о внесении исправлений.

Срок на представление информации от НРД: -

Приоритет доработок (1-высший, 3-низший) -

13 Предложения участников по разработке регламента изменений «живой» и «тестовой» среды, способы подачи информационных сообщений.

Рекомендации/решение рабочей группы:

Участниками рабочей группы предложено осуществлять публикацию детальной информации об изменениях в "живой" среде за месяц до введения их в действие и об изменениях в тестовой среде минимум за 1 день до введения изменений в действие.

Участниками рабочей группы будет предложен проект регламента до следующего заседания рабочей группы.

Проект регламента будет вынесен на обсуждение на заседании Комитета по репозитарной деятельности.

Срок на представление информации от НРД: -

Приоритет доработок (1-высший, 3-низший) -

14 О целесообразности рассылки информации обо всех изменениях в репозитории, в т.ч. об обновлении ПО ЛУЧ и других сервисов, включая плановое, и исправлениях.

Рекомендации/решение рабочей группы:

Рабочей группой указано размещение информационных сообщений на сайте НРД в разделе «Репозитарий» как основной канал информирования на начальном этапе.

До следующего заседания рабочей группы участники рабочей группы направляют в НРД предложения по иным каналам информирования, а также по списку событий, включая:

- проблемы с тестовой или "живой" средой и сроки возобновления операций;
 - детальная информация об изменениях;
 - иные события,
- а также о сроках информирования.

Срок на представление информации от НРД:	-
Приоритет доработок (1-высший, 3-низший)	1

15 План внедрения новых продуктов на ближайшие полгода. Приоритеты по тестированию / доработке форматов.

Рекомендации/решение рабочей группы:

НРД готовит таблицу внедряемых продуктов для рейтингования участниками рабочей группы.

Впоследствии, после получения рейтингов со стороны участников рабочей группы, НРД представляет план подготовки рекомендаций по заполнению форматов и тестирования сообщений по соответствующим группам продуктов.

Срок на представление информации от НРД:	20 декабря 2013 г. (анкета) 16 января 2014 г. (план)
Приоритет доработок (1-высший, 3-низший)	1

16 Рекомендации НРД по репортиingu «коротких» сделок в квартальном отчете. Регуляторные требования к квартальному отчету. Подтверждение согласованного правила и согласование запроса регулятору.

Рекомендации/решение рабочей группы:

НРД представит согласованные ранее рекомендации в составе первого комплекта инструкций по заполнению формата репозитария.

На Комитет будут представлены предложения запроса регулятору, направленные по итогам предыдущего заседания Комитета по репозитарной деятельности.

Подход к сроку формирования и дате, на которую формируется квартальный отчет:

- 1) С учетом отсутствия комментария регулятора относительно продления срока для предоставления квартального отчета рекомендуется предоставлять данный отчет в репозитарий НРД в течение 3-х рабочих дней (на третий рабочий день) после окончания отчетного квартала.
- 2) В отчет за отчетный квартал включается агрегированная информация по параметрам:
 - Количество (заключенных) своп договоров;
 - Денежные обязательства (в том числе иностранная валюта) – Сумма оговоренная (по обеим «ногам» валютного свопа независимо от того, когда они отчитываются и на какой период приходятся расчеты по ним);
 - Базовый (базисный) актив – Объем (количество) базового (базисного) актива оговоренный (в перспективе – для сделок с ценными бумагами).в отношении сделок, заключенных в отчетном квартале, т.е. дата заключения сделки (tradeDate) для которых приходится на отчетный квартал (критерий включения сделок – попадание в отчетный период, указанный в отчете, - рекомендуется указывать календарный квартал).
- 3) В отчет за отчетный квартал включается агрегированная информация по параметрам:

- Денежные обязательства (в том числе иностранная валюта) – Сумма переданная (по соответствующим «ногам» валютного свопа в зависимости от того, на какой период приходятся расчеты по ним);
- Базовый (базисный) актив – Объем (количество) базового (базисного) актива переданный (в перспективе – для сделок с ценными бумагами)

в отношении сумм денежных обязательств / обязательств по поставке ценных бумаг, фактически рассчитанных в течение отчетного периода, т.е. дата расчетов для которых приходится на отчетный квартал (критерий включения сумм – попадание в отчетный период, указанный в отчете, - рекомендуется указывать календарный квартал).

Агрегированная информация по указанным параметрам в отношении сумм денежных обязательств / обязательств по поставке ценных бумаг, дата расчетов для которых приходится на следующий за отчетным квартал, включается в следующий квартальный отчет.

- 4) Исключение согласовано для первого отчетного периода (с 05 ноября – по 31 декабря 2013 г.): в отчет за первый отчетный период также включается информация по перечисленным в пункте (2) и (3) параметрам (количество договоров своп, денежные обязательства - сумма оговоренная и сумма переданная) о «коротких» сделках валютный своп, заключенных до 05 ноября 2013 г., но исполнение обязательств по которым приходится на даты после 05 ноября 2013 г.

На рабочей группе принято решение о направлении в Банк России письма-запроса по разъяснению порядка предоставления квартального отчета.

В запрос войдут предложения по продлению сроков предоставления отчета и по согласованию **вышеописанного подхода**.

В следующем отчетном периоде НРД опубликует правила предоставления отчета, содержащие рекомендации / требования Банка России в случае предоставления таковых.

Срок на представление информации от НРД:	20 декабря 2013 г.
Приоритет доработок (1-высший, 3-низший)	1

17 **Готовность рекомендаций по заполнению формата сообщений для регистрации генеральных соглашений, сделок валютный своп и репо, квартального отчета и отчета о статусах. Рекомендации по изменению признака обязательности заполнения для элементов margin и dayCountFraction в формате сделок репо.**

Рекомендации/решение рабочей группы:

НРД направит проект рекомендаций на неделе с 16 декабря 2013 г. для заочного согласования на рабочей группе и Комитете.

После согласования рекомендации будут опубликованы в качестве Правил заполнения.

! На Комитете принято решение о публикации рекомендаций в виде проекта сразу за рассылкой, с последующим уточнением после согласования Комитетом !

В части элемента margin решено сделать элемент опциональным с признаком дополнительной сверки.

Срок на представление информации от НРД:	20 декабря 2013 г.
Приоритет доработок (1-высший, 3-низший)	1

18 **Выставление счетов на английском языке для участников-нерезидентов. Согласование формы и требований к документам.**

Рекомендации/решение рабочей группы:

Признать доработку приоритетной.

По запросу участников представлять англоязычный вариант в соответствии с согласованным вариантом.

НРД представить информацию о возможных сроках разработки вариантов счета на английском языке:

- только англоязычный вариант как альтернатива русскоязычному;
- англоязычный вариант в качестве приложения к русскоязычному;
- двуязычный вариант вместо русскоязычного.

Срок на представление информации от НРД:	16 января 2014 г.
Приоритет доработок (1-высший, 3-низший)	1

19 Выставление счетов на репозитарный код. Возможности изменения действующей процедуры.

Рекомендации/решение рабочей группы:

НРД проинформировать о сроках доработок в части:

- отправки счетов и приложений на один репозитарный код, указанный участниками;
- выставления и отправки счетов на каждый репозитарный код (с соответствующей разбивкой информации).

Срок на представление информации от НРД:	16 января 2014 г.
Приоритет доработок (1-высший, 3-низший)	1

20 Возможность отправки счетов и приложений к ним, а также информационных сообщений через вэб-сервисы и вэб-кабинет.

Рекомендации/решение рабочей группы:

Приоритетность задачи отправки счетов и приложений, а также информационных сообщений через вэб-сервисы / вэб-кабинет.

НРД проинформировать о возможных сроках доработок.

Срок на представление информации от НРД:	16 января 2014 г.
Приоритет доработок (1-высший, 3-низший)	1

21 Порядок учета изменений стороны-плательщика в анкете генерального соглашения.

Рекомендации/решение рабочей группы:

Участниками рабочей группы согласовано использование последней зарегистрированной информации для целей выставления счетов.

Срок на представление информации от НРД:	-
Приоритет доработок (1-высший, 3-низший)	-

22 Действие доверенностей на получение счетов. Действующее «правило последней доверенности».

Рекомендации/решение рабочей группы:

Логика последней доверенности не принимается.

НРД проработать вопрос разграничения полномочий на получение и оплату счетов, представить дополнительную информацию к следующей рабочей группе.

Срок на представление информации от НРД:	16 января 2014 г.
Приоритет доработок (1-высший, 3-низший)	1

23 Проведение встреч рабочей группы на регулярной основе в период до 25 июня.**Рекомендации/решение рабочей группы:**

Принято решение о проведении рабочих групп 2 раза в месяц: во второй и четвертый четверг месяца во второй половине дня; первое заседание должно проводиться в комбинированной форме (очно плюс телефонная связь), второе в форме вебинара.

НРД предложен канал проведения удаленных встреч через GoToWebinar. К следующему заседанию рабочей группы НРД представить / подтвердить информацию об удаленном подключении.

Первая рабочая группа назначена на 16 января 2014 г.

НРД предложено избрать председателя рабочей группы из числа представителей участников рынка. Предложить кандидатуру председателя к следующему заседанию.

Срок на представление информации от НРД: 16 января 2014 г.**Приоритет доработок (1-высший, 3-низший) 1****24 Определение логики для присвоения нескольких репозитарных кодов. Установление сроков для направления предложений.****Рекомендации/решение рабочей группы:**

Участникам рабочей группы до следующего заседания представить используемые / требуемые принципы выделения репозитарных кодов для возможного закрепления на уровне нормативной документации.

Информация об указании назначения репозитарных кодов в справочнике принята к сведению.

Срок на представление информации от НРД: -**Приоритет доработок (1-высший, 3-низший) -****25 Возможность авансовых платежей.****Рекомендации/решение рабочей группы:**

По информации НРД до внедрения новой системы биллинга реализация маловероятна.

Срок на представление информации от НРД: -**Приоритет доработок (1-высший, 3-низший) -****26 Необходимость второй тестовой среды.****Рекомендации/решение рабочей группы:**

Необходимо поставить вопрос на обсуждение Комитетом. По информации НРД, присутствуют существенные организационные издержки в части поддержки и эксплуатации.

Срок на представление информации от НРД: 23 января 2014 г.**Приоритет доработок (1-высший, 3-низший) 1****27 Уведомления об отзыве лицензий у участников репозитария НРД.****Рекомендации/решение рабочей группы:**

НРД представить информацию о возможности e-mail рассылок.

Срок на представление информации от НРД: 16 января 2014 г.**Приоритет доработок (1-высший, 3-низший) -**