

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

Дата проведения заседания: 26 апреля 2016 г. (вторник)

Время: 10:00 – 13:00

1 Вопросы к Банку России

Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

1. Банк России представил краткий обзор планируемых изменений в законодательстве по репозитарной деятельности. В частности, регулятор обратил внимание участников на предстоящие изменения в Указании 3253-У, с которыми можно ознакомиться в Проекте документа и предоставить комментарии.

Рекомендации рабочей группы:

1. Участники уведомили регулятора о сложностях в формировании кода UTI:
 - а) отсутствие рыночной практики по согласованию кода между сторонами;
 - б) отсутствие практики по формированию кода для Генеральных соглашений с нерезидентами;

Комментарий Банка России:

Введение кода вызвано проходящими процессами гармонизации российского и европейского рынка по отчетности в репозитарии, где основным идентификатором сделок выступает код UTI. Описанный порядок формирования кода в Указании 4001-У предлагается рассматривать как рекомендацию.

Банк России готов собирать вопросы от участников, которые могут быть направлены напрямую регулятору в виде официальных писем или по эл. почте, для подготовки общего информационного письма для ответов на вопросы участников.

2. Ответы на открытые вопросы участников представлены в Приложении 1 к Протоколу.

2 Внедрение кода UTI

Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

Репозитарий НРД представил обзор по предоставлению сервиса для формирования кода UTI в Web-кабинете Репозитария:

- а) формирование кода UTI в Web-кабинете будет осуществляться самим Информирующим лицом (отправителем сообщения) на базе своего кода LEI;
- б) алгоритм формирования кода будет соответствовать Указанию Банка России: в качестве префикса будет использоваться код LEI ИЛа (20 символов), остальные символы – код самой сделки, которые будут формироваться по алгоритму GUID, состоящий из 32 символов;
- в) при заполнении анкеты договора в Web-кабинете, в поле UTI договора появится возможность формирования кода UTI. Также, при массовой загрузке сделок в балк-формате, будет возможно сформировать код сразу для выбранного массива сделок;
- г) при отправке сообщения в Репозитарий в Web-кабинете, кабинет отправит черновик сообщения ИЛу контрагента, который попадет в специальную папку. Далее ИЛ контрагента примет решение об использовании черновика для формирования своего сообщения в Репозитарий или об использовании информации о коде UTI из черновика для формирования собственного сообщения;
- е) Репозитарий НРД будет осуществлять проверку сообщений на наличие заполненного кода UTI, а также на ограничение количества символов – не более 52-х;
- ф) подбор встречного сообщения в Репозитарии будет осуществляться по коду UTI, указанному в анкете договора.

Рекомендации рабочей группы:

Необходимо предусмотреть выгрузку сообщений из Web-кабинета после формирования кода UTI для дальнейшей загрузки сообщений в Репозитарий НРД через файловый шлюз.

Комментарий НРД:

выгрузка сообщения предусмотрена в Web-кабинете, в тоже время в Web-кабинете был

разработан функционал, позволяющий отправить сразу несколько сообщений с помощью групповой операции, таким образом участникам не потребуются совершать лишние действия по выгрузке сообщений из Web-кабинета для их загрузки через файловый шлюз.

3

Отказ от БИЛов

Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

Участнику – клиенту Репозитария НРД необходимо до 27 июня подать анкету по форме СМ016 для определения своих Информировующих лиц (ИЛ).

Назначение ИЛа происходит только после акцептования им анкеты, которая придет на согласование от Репозитария НРД. Участник имеет возможность подать анкету СМ016 в НРД как через Web-кабинет, так и на бумаге.

При формировании анкеты СМ016 важно определить для каждого ИЛа полномочия, в рамках которых он будет осуществлять отчетность в Репозитарий.

Основным параметром является Тип документа, по которому ИЛ будет направлять отчетность.

При наличии нескольких ИЛов и необходимости отчетности этими ИЛаи одних и тех же Типов документов, необходимо использовать Дополнительные параметры, которые позволят разграничить полномочия, например, этими параметрами могут быть номер Генерального соглашения, Контрагент или Место заключения сделки. Данные параметры могут потребоваться для корректного определения ИЛа контрагента.

В анкете СМ016 есть возможность указания дополнительных признаков для возможности подачи ИЛом анкет СМ092 и СМ094 в рамках тех Типов документов, по которым ИЛ уполномочен осуществлять отчетность, а также признак для возможности запроса ИЛом исторических данных по репозитарному коду участника.

Рекомендации рабочей группы:

- а) Необходима возможность назначения ИЛа только для регистрации им анкет Генеральных соглашений (ГС). Назначенный ИЛ по ГС должен иметь возможность просмотра зарегистрированных договоров в интерфейсе Web-кабинета Репозитария по зарегистрированным им ГС;
- б) необходимы уточнения по порядку указания информации в анкете СМ016 для возможности отправки ИЛом анкет СМ092 и СМ094.

Комментарий НРД:

- а) Для возможности назначения ИЛа только для регистрации им ГС участнику необходимо выбрать Тип документа – Masteragreement;
- б) На сайте НРД в разделе Репозитария «Форматы. Рекомендации. Тестирование» размещена инструкция по описанию анкет СМ016 и СМ017, в которой описан порядок заполнения анкет, в том числе для признаков отчетности ИЛом СМ092 и СМ094.

4

Открытые вопросы участников

Комментарии НРД/рекомендации рабочей группы

Ответы на открытые вопросы участников содержатся в Приложении 2 к Протоколу.

Рекомендации рабочей группы

Участники пожелали ознакомиться с проектом изменений к Условиям осуществления репозитарной деятельности, описывающем процессы для новой модели отчетности Информировующих лиц и новый порядок тарификации, заранее до момента официальной публикации Условий на сайте НРД.

Участники пожелали ознакомиться с перечнем предстоящих доработок по Репозитарию в 2016 году.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1

Вопросы к Банку России от участников Рабочей группы по технологическим вопросам при Комитете по репозитарной деятельности НРД

- 1.1** Если заключается договор (сделка) с контрагентом нерезидентом, каким образом можно получить идентичный код УТИ? Необходимо ориентироваться на код нерезидента? Что будет в случае, когда наш код и его код не совпадут? Какие варианты возможны, чтобы избежать подобных ситуаций?

Ответ: формирование и присвоение УТИ осуществляется в соответствии с требованиями Указания Банка России № 4001-У. При этом у договора не может быть несколько УТИ, поэтому крайне важно согласовать, кто формирует УТИ с контрагентом по договору.

- 1.2** Может ли участник (Сторона 1) указать в сообщении свой УТИ код, если стороны не договорились о формирующем УТИ лице, приоритет по формированию УТИ согласно Указанию ЦБ принадлежит его контрагенту (Стороне 2), а он не прислал сообщение со своим УТИ (не проинформировал вторую сторону)? Нарушит ли Сторона 1 в таком случае Указание регулятора? Какая мера ответственности может быть применена за подобное "нарушение"?

Ответ: в соответствии с Указанием Банка России № 4001-У формирование и присвоение УТИ договора осуществляет сторона такого договора либо третье лицо.

В случае если между сторонами договора не достигнуто соглашение в отношении выбора формирующего лица, формирующим лицом является сторона договора, обязанная предоставлять информацию в репозитарий в соответствии с пунктом 1¹ Указания Банка России № 3253-У.

В случае, когда обе стороны договора являются лицами, обязанными предоставлять информацию в репозитарий в соответствии с пунктом 1¹ Указания Банка России № 3253-У, формирующим лицом является лицо, LEI которого, начиная с седьмого символа, содержит символы, приоритет которых установлен в следующем порядке: Z, Y, X, W, V, U, T, S, R, Q, P, O, N, M, L, K, J, I, H, G, F, E, D, C, B, A, 9, 8, 7, 6, 5, 4, 3, 2, 1, 0.

Формируя УТИ с нарушением установленного порядка возникает риск предоставления информации в репозитарий об одном и том же договоре с различными УТИ, что в случае двустороннего «репортинга» повлечет невозможность внесения записи о таком договоре в реестр договоров репозитария.

- 1.3** С какой целью устанавливается требование по формированию УТИ для генерального соглашения в момент его заключения? Просим рассмотреть возможность исключить требование по формированию УТИ для генерального соглашения и в момент его заключения.

Ответ: в соответствии с Указанием Банка России № 4001-У (направлено на государственную регистрацию в Минюст России), УТИ формируется и присваивается договору, а также генеральному соглашению не позднее момента предоставления в репозитарий информации о его заключении. [Текст Указания № 4001-У](#) размещен на официальном сайте Банка России в сети интернет.

- 1.4** Отчетность разовых договоров.

Какие типы сделок по разовым договорам необходимо будет отчитывать.

Будет ли изменение по типам сделок? (обязанность репортировать «иные» сделки).

Когда можно ожидать изменений в 3253-У по вопросу разовых сделок?

Ответ: в настоящее время планируется в качестве договоров, информация о которых подлежит предоставлению в репозитарий, определить РЕПО и ПФИ, в том числе заключенные не на условиях генерального соглашения. - нормативный акт Банка России, содержащий соответствующие положения, планируется к опубликованию в июне 2016 года.

- 1.5** Будет ли введена обязанность передавать в репозитарий информацию по "Иным" договорам, не являющимся ПФИ, объектом которых являются ценные бумаги, иностранная валюта и (или) драгоценные металлы и как Регулятор квалифицирует данные типы сделок?

Ответ: в настоящее время планируется в качестве договоров, информация о которых подлежит предоставлению в репозитарий, определить РЕПО и ПФИ, в том числе заключенные не на условиях генерального соглашения.

1.6 Обязаны ли Форекс-дилеры предоставлять информацию в репозитарий?

Ответ: в настоящее время обязанность по предоставлению информации в репозитарий в отношении форекс-дилеров нормативно не установлена.

1.7 Просим обозначить плановый срок опубликования проекта нормативного акта, в котором будут определены: итоговый список ЮЛ, обязанных отчитываться в репозитарий, сроки отчетности, виды сделок для обязательной отчетности?

Ответ: нормативный акт Банка России, содержащий соответствующие положения, планируется к опубликованию в июне 2016 года.

1.8 Срок вступления в силу 430-ФЗ 28/06/2016 - окончательный? Или в данный момент вопрос о переносе срока вступления в силу открыт?

Ответ: срок вступления в силу Федерального закона от 30.12.2015 № 430-ФЗ является окончательным. При этом необходимо учитывать, что обязанность по предоставлению информации в репозитарий на основании пункта 1 статьи 15.8 Федерального закона от 30.12.2015 № 430-ФЗ возникает с момента вступления в силу соответствующего нормативного акта Банка России.

1.9 После вступления изменений в Указание 3253-У при заключения сделки, подлежащей отчетности в Репозитарий, по поручению своего клиента, так же являющегося лицом, обязанным предоставлять информацию в репозитарий, Брокер обязан при направлении анкеты договора в информации о клиенте указать тип и код клиента в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора согласно Приложению 8. В описанном случае, клиентом Брокера является юридическое лицо, также обязанное предоставить информацию в репозитарий и этот клиент обязательно должен получить LEI-код и направить информацию о нем вышестоящему Брокеру.

1.10 Планируется ли внесение изменений в части снятия обязанности направления сделок в репозитарий, если они были заключены через вышестоящего брокера? Если такая обязанность будет снята, то возможно ли применение для направления информации о договоре руководствоваться п.2 Приложения 8 и указать тип кода отличный от LEI?

Ответ: если договор заключен брокером по поручению клиента, обязанного предоставлять информацию в репозитарий, то брокер является лицом, обязанным предоставить информацию о таком договоре в репозитарий. При этом при предоставлении информации о таком договоре в репозитарий указывается LEI клиента – обязанного предоставлять информацию в репозитарий, а также информирующего лица.

1.11 Просим исключить требование о необходимости указания UTI в случае заключения договора путем обмена сообщениями, содержащими существенные условия такого договора.

В случае, если требование останется, просим исключить требование по включению в документацию по сделке UTI кода для сделок, заключаемых со Сторонами, не обязанными предоставлять информацию в Репозитарий. Особенно для сделок, заключаемых с нерезидентами. На практике, довольно часто в Соглашениях ISDA установлено, что нерезидент обязан направить резиденту Подтверждение первым. Таким образом, нерезидент- необязанная Сторона должна выполнять функции Формирующей стороны. Следовательно, потребуются убедить необязанную Сторону соблюдать нормы российского законодательства, что представляется проблематичным.

В случае, если требование о формировании УТИ в момент заключения договора не будет исключено, то в части возможности формирования УТИ кода Третьим лицом, хотелось бы отметить, что вовлечение Третьего лица представляется нереалистичным. В этой же связи план НРД о разработке сервиса по формированию УТИ кода идет в разрез с позицией Банка России, поскольку технически НРД не сможет предоставить код до момента заключения сделки.

Ответ: Указанное требование исключено из Указания Банка России № 4001-У.

- 1.12** Предлагаем Банку России рассмотреть вопрос об опциональности формирования УТИ. Для сообщений, содержащих УТИ код, предлагаем упростить процедуру мэтчинга в Репозитории, и осуществлять мэтчинг по УТИ коду, для остальных сообщений – мэтчинг по обязательным полям.

Ответ: в соответствии с пунктом 25 Указания Банка России № 3253-У отсутствие в сообщении, представляемом в репозиторий, УТИ договора, заключенного с 1 июля 2016 года, повлечет отказ во внесении записи в реестр договоров. Таким образом, опциональность формирования УТИ исключена.

В случае осуществления мэтчинга исключительно по УТИ, возникает риск предоставления в репозиторий информации, содержащей различные сведения о договоре от каждого из информирующих лиц, и как следствие, возникает проблема с внесением записи в реестр договоров репозитория.

- 1.13** Если сделки с контрагентом нерезидентом, каким образом должен быть идентичный код УТИ? Мы должны ориентироваться на его код?

Если да, то что будет в случае когда наш код и его не совпадут?

Какие варианты возможны для избежания подобных ситуаций?

Ответ: формирование и присвоение УТИ осуществляется в соответствии с требованиями Указания Банка России № 4001-У. При этом у договора не может быть несколько УТИ, поэтому крайне важно согласовать, кто формирует УТИ с контрагентом по договору.

- 1.14** Есть ли какой-либо срок, ограничивающий внесение изменений в задние даты по отчитанным в Репозиторий сделкам. Есть ли ограничение по срокам для видов/типов сделок РЕПО/ СВОП/ ПФИ? Если да, просьба указать сроки для каждого вида.

Ответ: ограничения отсутствуют.

- 1.15** По разовым сделкам с клиентами, в отсутствии данных паспорта гражданина РФ, могут быть указаны данные заграничного паспорта, паспорта военнослужащего, моряка и т.п.?

Ответ: в соответствии с приложением 8 к Указанию Банка России № 3253-У для физических лиц может указываться номер паспорта или страховой номер индивидуального лицевого счета (СНИЛС).

- 1.16** По сделкам РЕПО с фиксированной ставкой отчитывать их необходимо в 3-х дневный срок (3 рабочих дня) с даты заключения (не включая дату заключения). При этом за дату заключения необходимо принимать дату исполнения по второй части РЕПО. При несовпадении плановых и фактических сроков исполнения, отсчитывать в 3-х дневный срок нужно по плановой дате исполнения 2-й части РЕПО или по фактической? А если дата исполнения 2-й части РЕПО по ЦБ и ДС различны, от какой даты верно отсчитывать 3-х дневный срок: от плановой даты исполнения по ДС или по ЦБ?

Ответ: ответ не предоставлен.

- 1.17** Просим подтвердить, что на данный момент нет обязанности заключать ген соглашение с каждым нашим клиентом, если с ним заключено более 1-й сделки с одним видом сделок (РЕПО/

СВОП/ ПФИ)? Если есть другие ограничения, обязывающие проф. участников заключать ген соглашения, укажите их пожалуйста?

Ответ: обязанность заключать генеральное соглашение нормативно не установлена.

1.18 Если 2-я сторона сделки НЕ является клиентом Репозитария, или является, но не назначила нас ИЛ-ом (не подала заявление), мы все равно должны отчитать сделки в Репозитарий? То, что у таких сделок статус будет только отправленных, но не зарегистрированных в Репозитарии - не является нарушением?

Ответ: в соответствии с пунктом 10 Указания Банка России № 3253-У информация о договорах, заключенных на условиях генерального соглашения, предоставляется лицом (лицами) (далее - информирующее лицо), определенным (определенными) сторонами генерального соглашения, которым (которыми) может быть сторона (стороны) генерального соглашения или третье лицо. Сведения об информирующем лице указываются в договоре об оказании репозитарных услуг или предоставляются репозитарию в порядке, установленном указанным договором.

1.19 Все сделки (без исключений) отчитанные в Репозитарий не должны попадать в отчет по форме 0420417? Или есть сделки, которые все же должны попадать в отчет 0420417? Если да, то при каких условиях они должны попадать?

Ответ: в соответствии с Указанием Банка России № 3533-У отчетность по форме 0420417, в частности, составляется по всем внебиржевым сделкам, заключенным профессиональными участниками за отчетный период, за исключением сделок, информация о которых направляется в репозитарий.

1.20 Каковы штрафы в случае нарушения сроков Репозитарной отчетности?

Ответ: в соответствии с частью 4 статьи 15.19 КоАП РФ нарушение стороной договора, заключенного не на организованных торгах на условиях генерального соглашения (единого договора), установленных нормативными актами Банка России порядка и (или) сроков предоставления информации об указанном договоре, в том числе предоставление неполной и (или) недостоверной информации, -

влечет наложение административного штрафа на граждан в размере от одной тысячи до двух тысяч пятисот рублей; на должностных лиц - от двадцати тысяч до тридцати тысяч рублей; на юридических лиц - от трехсот тысяч до пятисот тысяч рублей.

1.21 При непреднамеренном нарушении сроков предоставления отчетности в случае технических сбоев на нашей стороне или на стороне НРД, какие данные мы должны получить для предоставления в ЦБ РФ в качестве доказательства, что задержка произошла не по нашей вине?

Ответ: в соответствии с пунктом 18 Указания Банка России № 3253-У в случае технического сбоя у репозитария или у информирующего лица, который не был устранен до дня окончания установленного Указанием Банка России № 3253-У срока предоставления сообщения, сообщение о генеральных соглашениях или договорах может предоставляться в репозитарий на бумажном носителе в порядке, предусмотренном договором об оказании репозитарных услуг.

При этом согласно пункту 19 Указания Банка России № 3253-У репозитарий регистрирует все сообщения, поступающие к нему в связи с осуществлением деятельности, предусмотренной Указанием Банка России № 3253-У, в день их поступления в журнале учета сообщений, который ведется в электронной форме при условии обеспечения возможности предоставления учитываемой информации и содержащихся в журнале сведений на бумажных носителях.

1.22 По сделкам РЕПО, в случае если сделка заключена по поручениям нескольких клиентов, необходимо раскрывать всех клиентов (в интересах которых заключена сделка между БКС и контрагентом)? (в Данный момент формат электронных документов Репозитария не позволяет этого сделать)

Ответ: если договор заключен по поручениям нескольких клиентов, необходимо предоставлять информацию обо всех таких клиентах.

1.23 Есть сделки репо, по которым мы не знаем клиента стороны (не нашей а контрагента).

Например, наш контрагент (брокер), по нашему счету, как его клиента, делает техническую сделку репо (по переносу маржинальных поз), в отчете брокера мы видим только сделку с условиями заключения (цена, сумма, эмитент и т.д.), но клиента в чьих интересах наш брокер заключил сделку мы не видим. И наш вышестоящий брокер не обязан нам раскрывать их. Как нам отчитывать такую сделку?

Ответ: в вышеуказанном случае при предоставлении информации в репозиторий контрагент брокера не обязан предоставлять сведения о клиенте брокера, в интересах которого заключен договор.

1.24 Договора внебиржевые купли-продажи (акций облигаций и т.п.) – не входят в обязательную отчетность с 28/06/2016?

Ответ: в соответствии с пунктом 1 статьи 15.8 Федерального закона от 30.12.2015 № 430-ФЗ указанные в нормативном акте Банка России лица, являющиеся стороной договора репо, договора, являющегося производным финансовым инструментом, договора иного вида, предусмотренного нормативными актами Банка России, предоставляют в репозиторий информацию о таком договоре в порядке, составе, форме и сроки, которые установлены нормативными актами Банка России. В настоящее время планируется в качестве договоров, информация о которых подлежит предоставлению в репозиторий, определить РЕПО и ПФИ, в том числе заключенные не на условиях генерального соглашения.

1.25 При переходе на обязательную отчетность в Репозиторий у нас получится удвоение отчета по сделкам репо, т.к. в 0420417-й отчет в ЦБ попадут сделки заключенные по репо ч.1, и они же попадут в отчетность Репозитария по исполнению ч.2., а они должны быть исключены по правилам указания 3253-у из отчета 040417?

Ответ: в соответствии с Указанием Банка России № 3533-У отчетность по форме 0420417, в частности, составляется по всем внебиржевым сделкам (в том числе репо), заключенным профессиональными участниками за отчетный период, за исключением сделок, информация о которых направляется в репозиторий.

ПРИЛОЖЕНИЕ 2

Вопросы вне повестки к НРД от участников Рабочей группы по технологическим вопросам при Комитете по репозитарной деятельности НРД

Вопросы по генерации UTI

2.1 Сервис по генерации UTI, доступный всем пользователям Web-кабинета, будет платным или НРД предоставит его безвозмездно?

Ответ: сервис по генерации UTI, доступный всем пользователям Web-кабинета, будет бесплатным.

2.2 При использовании сервиса на базе Web-кабинета формирующим лицом будет являться отправитель сообщения. Кто будет являться формирующим лицом, если отправителей два? (когда каждая из сторон сама для себя информирующее лицо).

Ответ: формирующим лицом (в соответствии с Указанием) - является сторона договора, либо третье лицо. Таким образом, формирующим лицом (выбранным сторонами) может являться Информационное лицо одной из сторон договора. Только это лицо (являющееся формирующим и информирующим лицом – отправителем одновременно) может воспользоваться сервисом, предоставленным пользователям Web-кабинета.

Стороны должны договориться, кто из них формирует UTI.

2.3 Как будет реализована генерация UTI кода в сообщении, доступная всем пользователям Web-кабинета:

2.3.1.1 Это будет массовая операция или единичная?

Ответ: сервис будет доступен для анкет, заполняемых в экранных формах Web-кабинета участником вручную («единичная»), так и для анкет, загружаемых в Web-кабинет (в «Черновики») в режиме импорта («массовая»).

2.3.1.2 Можно ли будет увидеть сгенерированный код в сообщении?

Ответ: да.

2.3.1.3 При генерации UTI кода через Web-кабинет, будет ли заменено значение кода для сообщений, содержащих UTI код при импорте черновика?

Ответ: использование сервиса формирования кода – это опция, предоставляемая участникам. Если сообщение, загружаемое в Web-кабинет, уже содержит UTI код, то повторное формирование кода не требуется. При наличии UTI в анкете формирование UTI Web-кабинетом осуществляться не будет. Для того чтобы сформировать UTI, Клиенту необходимо инициировать этот процесс (проставить соответствующую отметку). По умолчанию UTI не формируется.

2.4 При импорте сообщения происходит валидация сообщения. Если UTI код не будет заполнен, возможно ли будет импортировать сообщение?

Ответ: импортировать сообщение в черновики Web-кабинета возможно без UTI кода в анкете. Проверка на наличие UTI в сообщении будет осуществляться на стороне репозитария НРД. В случае отсутствия UTI или его совпадения с кодом ранее отчитанной сделки, Репозитарий откажет во внесении данной сделки в реестр.

2.5 В какие сроки будет утверждена новая редакция Условий оказания репозитарных услуг, в которой будет закреплено, что при использовании сервиса UTI на базе Web-кабинета формирующим лицом будет являться отправитель сообщения? Отразится ли данное нововведение на способе подтверждения «Комбинированный»?

Ответ: согласно действующей процедуре, редакция Условий оказания репозитарных услуг, вступающая в силу 27/06/2016, будет утверждена за месяц до вступления в силу (то есть 27/05/2016).

Способы и процедуры подтверждения анкет не изменяются.

- 2.6** В форматах НРД предусмотрено одно поле для кода UTI. В большинстве международных форматов - это два поля: префикс контрагента на основе LEI (10 символов) и номер сделки - рекомендации ISDA, EMIR, форматы SWIFT, FPML и другие. Возможно, имеет смысл включить в форматы сообщений два поля, как предусмотрено в FPML и SWIFT? В общем случае форматы НРД разработаны на основе FPML. Зачем делать исключение для UTI? Если оставить одно поле, возникнут сложности у большинства участников с разделением одного кода, получаемого из НРД, для отправки подтверждений контрагентам, в формате SWIFT например. В Европе префикс контрагента обычно 10 символов, а в проекте Указания Банка России зафиксировано, что префикс должен быть 20 символов из LEI. Как определить префикс контрагента при получении UTI в анкете НРД?

Ответ: согласно рекомендациям ISDA – UTI – один код и в форматах иных репозитариев (например, CME) UTI определяется в одном поле. Репозитарий НРД не планирует разбивку кода на 2 поля, код UTI обязателен к заполнению в одном поле анкеты.

- 2.7** В связи с отказом НРД участвовать в формировании UTI кода для участников хотелось бы получить подробные сведения о том, какая логика и контроли будут заложены на стороне репозитария при анализе его заполнения в сообщениях участников? Как будет имплементирован механизм метчинга сообщений, при отправке отчетов двумя сторонами по сделке самостоятельно?

Ответ: все входящие сообщения в репозитарий будут проверяться на наличие единого для сделки кода UTI (при отсутствии кода, в соответствии с Указанием, будет осуществляться отказ в регистрации). UTI – будет являться основным параметром поиска встречного сообщения при двустороннем способе согласования сообщений, таким образом, по нему будет производиться обязательная сверка.

- 2.8** Будет ли НРД контролировать корректность формирования UTI кода участниками, относительно рекомендаций Банка России, если UTI будет сформирован участником, приоритет которого не соответствует абзацу 3 п. 10 изменений в Указание Банка России?

Ответ: корректность формирования UTI - ответственность формирующего лица (в соответствии с Указанием). Репозитарий НРД будет осуществлять проверку на наличие UTI и уникальность данного кода среди ранее зарегистрированных кодов в репозитарии. Дополнительные проверки осуществляться не будут.

- 2.9** Может ли ИЛ клиента НРД сам формировать UTI код (со своим LEI) и включать его в сообщения по сделкам при отправке в репозитарий, если он не является стороной по сделке и стороны не смогли договориться о 3-ей стороне, формирующей UTI? (вопрос к НРД и к регулятору).

Ответ: в соответствии с проектом Указания Банка России: «10. Формирование и присвоение уникального кода идентификации договора по соглашению сторон договора, указанного в пункте 7 приложения 8 к настоящему Указанию, осуществляет сторона такого договора, либо третье лицо». Таким образом, Информирующее лицо (не являющееся стороной по сделке) может являться формирующим UTI лицом по соглашению сторон. При этом ИЛ (отправитель сообщения) может самостоятельно присвоить сделке UTI либо воспользоваться сервисом формирования на базе Web-кабинета репозитария НРД.

- 2.10** Кто может формировать UTI для договора, обе стороны которого не обязаны отчитывать их в репозитарий, при условии, что только одна из сторон является Клиентом репозитария (нерезидент) и заинтересована в направлении сведений в НРД? Отчеты по его сделкам

направляются с репозитарного кода его ИЛа (российским банком) (вопрос к НРД и к регулятору).

Ответ: в соответствии с проектом Указания Банка России: «10. Формирование и присвоение уникального кода идентификации договора по соглашению сторон договора, указанного в пункте 7 приложения 8 к настоящему Указанию, осуществляет сторона такого договора, либо третье лицо».

2.11 Согласно проекту Указания по УТИ "Стороны вправе сформировать и присвоить УТИ договору, заключенному до 01.07.2016, запись о котором внесена в реестр договоров." Как будет реализовано это требование на стороне репозитария? Например, если запись о договоре /Генеральном соглашении внесена в реестр договоров до 01.07.2016, то последующие сообщения по этим договорам/ГС, должны содержать УТИ или не должны/ или есть исключения?

Ответ: обязательность наличия УТИ, при внесении изменений в анкеты договоров, зарегистрированных до 01/07/2016, не требуется.

2.12 Потребуется ли создание формы для уведомления НРД о формирующем лице номера УТИ?

Ответ: нет, формирование отдельного уведомления о формирующем УТИ лице не требуется. В соответствии с форматом версии 4.1 (инструкция [доступна по ссылке](#)) формирующее УТИ лицо (UTIGeneratingParty) будет определено участниками в стандартной группе party в анкетах договоров, направляемых в репозитарий.

2.13 Каким образом планируется реализация для обмена УТИ, присвоенного НРД между сторонами ГС и планируется ли предоставление сервиса по обмену УТИ, присвоенными самими участниками?

Ответ: подробная информация и обсуждение сервиса планируется на ближайшем заседании Технологической рабочей группы.

2.14 Сервис по формированию УТИ будет работать и для присвоения номеров сделкам в Bulk формате и для разовых по формам стандартных анкет?

При внесении изменений или отчитывании исполнения код УТИ должен быть как у изначально зарегистрированной сделки?

Ответ: разработанный сервис по формированию УТИ на базе web-кабинета репозитария будет работать для всех анкет типа СМ010,СМ021 – СМ081. Для bulk отчетности (СМ083-СМ085) формирование УТИ на базе web-кабинет не будет реализовано.

Присвоенный УТИ сделки должен совпадать в анкетах на регистрацию и внесение изменений.

Подробная информация и обсуждение сервиса планируется на ближайшем заседании технологической рабочей группы.

Вопросы по Отказу от БИЛов

2.15 Необходимо ли клиенту Репозитария, направившему в НРД уведомление об отказе от предоставления сведений (СМ012), предоставлять Заявление о назначении информирующих лиц?

Ответ: нет. При наличии Уведомления об отказе от предоставления сведений в Репозитарий (СМ012), предоставления Заявления о назначении Информированных лиц (СМ016) не требуется.

2.16 Если мы не подаем анкету СМ016, мы автоматически считаемся ИЛом по своему репозитарному коду?

Ответ: да.

2.17 Просим рассмотреть возможность сделать опциональным направление Заявления о назначении информирующих лиц для тех клиентов Репозитария, которые назначены БИЛом и ИЛом для контрагента в рамках зарегистрированных в НРД Анкет Генеральных соглашений. Ведь в таком случае, направление Заявления носит технический характер.

Ответ: как уже ранее обсуждалось на рабочих группах, 27/06/2016 репозитарий в полном объеме переходит на новый механизм определения полномочий Информированных лиц. Все Илы/БИЛы, определенные ранее в Анкетах ГС (СМ010), перестают действовать. Клиентам необходимо назначить ИЛов с помощью анкеты СМ016.

2.18 Вопрос по Заявлению о назначении информирующего лица.

Возможно ли проинформировать НРД о назначении ИЛа до 27/06/2016 действующим БИЛом Клиента репозитария (на основании действующей доверенности), учитывая, что заявление будет отправлено с репозитарного кода БИЛа? Устроит ли НРД такой вариант информирования?

Ответ: согласно [информационному письму](#) и [Инструкции](#) отправителем Заявления о назначении Информированных лиц (СМ016) может являться только клиент репозитария (от своего имени). При этом в период до 27/06/2016, Заявление по форме СМ016 на бумажном носителе, подписанное клиентом, может быть предоставлено действующим БИЛом данного клиента.

Прочие вопросы к НРД

2.19 Просим уточнить механизм повторного направления информации о ранее направленной сделке в случае обнаружения ошибки в одной из сделок в ранее направленном отчете (в формате СМ083):

- правильно ли мы понимаем, что на данный момент внести изменения в сделку, отчитанную как исполненную, не представляется возможным. Можно ли будет вносить в отчитанные сделки исправления или удаление ранее направленной сделки?
- планирует ли репозитарий разделить <изменение условий> на исправление ошибки в ранее направленной сделке? Как это будет реализовано технически, будет введен новый тип или формат сообщения?

Ответ: автоматизированный механизм внесения изменений в анкеты bulk-отчетов типа СМ083-СМ084, предусматривающих отчетность по уже исполненным и закрытым сделкам, не предполагается. Удаление записей из реестра так же не осуществляется.

Исправление ошибочных записей в Реестре договоров будет осуществляться в порядке, предусмотренном п. 5.4.4. действующих условий оказания репозитарных услуг.

Считаем необходимым адаптировать СМ083 под возможность включения указанных в примере сделок в один отчет.

Ответ: формат разработан для отчетности технических сделок (авто РЕПО), технических сделок для валютного свопа и конверсионных сделок.

Предусматривает:

- a) массовую отчетность сделок в одном сообщении с разными контрагентами на одну дату;
- b) отчет формируется по одинаковым датам расчетов по первой/второй ногам сделок.
- c) отчетность будет приниматься только по закрытым сделкам, т.е. со статусом - Т, чтобы избежать дополнительной процедуры по их закрытию;
- d) дата закрытия, по умолчанию, будет являться датой расчетов по второй ноге.

Таким образом, сделки, которые вы можете отчитывать с помощью одного bulk-отчета, должны соответствовать следующим параметрам:

- сделки «овернайт» (заключены в дату - T, расчет по первой части так же произведен в дату T, расчет по второй части равен дате - T или - T+1 – эта дата равна дате закрытия сделки).
- сделки исполненные (и все обязательства выполнены) на момент отчетности (статус «Т»).

В соответствии с указанием, п.12, сделка и все события по ней должны быть отчитана в - T+3, таким образом, эти ограничения позволяют отчитать все события (заключение, закрытие) в одном сообщении bulk-отчета, не нарушая сроков отчетности по Указанию.

Согласно разработанному формату, все сделки, включенные в отчет CM083,84 и 85, должны быть объединены по следующим параметрам:

- 1) Дата сделки
- 2) Статус исполнения обязательств
- 3) Дата расчетов по первой части
- 4) Дата расчетов по второй части

При этом в один отчет могут быть включены сделки

- с разными контрагентами
- с разными идентификаторами и кодами сделки (по приложению 3 Указания)
- с разными БА
- с разными ставками
- и с другими разными параметрами (суммы, валюты...).

Предложенный вами механизм существенно увеличивает нагрузку на обработку сообщений данного типа. Разработанный формат предполагает разделение отчетов, имеющих разные даты расчетов, для минимизации процедур проверок.

2.20 Когда будут доступны на тестовом контуре для направления информации по таким сделкам (CM83-CM085) в репозиторий или подготовлен формат для тестирования сделок между клиентами Компании?

Ответ: согласно [план-графику](#) начало тестирования регистрации сообщений в форме bulk-отчетов будет доступно с конца мая 2016.

2.21 Формат отчета Репозитория о зарегистрированных сделках – будет для сделок BULK формата аналогичным – для удобства сверки поданных и зарегистрированных сделок?

Ответ: разработанные анкеты для bulk отчетности по сделкам РЕПО(CM083), Валютный своп (CM084) и конверсионные сделки(CM085) предполагают только одностороннюю отчетность, таким образом сверка по ним производиться не будет.

2.22 Представьте пожалуйста подробное описание новой схемы тарифов Репозитория (в том числе и по сделкам BULK)

Ответ: описание новой схемы тарифов Репозитория будет опубликовано на сайте НРД.

2.23 Правильно ли мы понимаем, что соглашение об обеспечении исполнения сделок должно указываться в отчете об уплате маржевых сумм? То есть, референс анкеты CM015 нужно будет указывать в поле tradeId для анкеты CM092 и в блоке csaId (Идентификационный код договора об обеспечении исполнения обязательств) в блоке collateral для всех анкет по сделкам?

Ответ: референс анкеты CM015 может быть указан в поле tradeId в анкетах договоров и в анкете отчета CM092. Подробные инструкции по заполнению опубликованы на сайте:

- [предоставление сведений об обеспечении](#)
- [Инструкция по заполнению идентификаторов](#)

2.24 По клиентам ФЛ, в качестве идентификатора нужно будет указывать не только СНИЛС, но и паспорт гражданина РФ вместе с номером и серией, т.е. 10 знаков без пробелов?

Ответ: в соответствии с Приложением 8 Указания 3253У в качестве кода идентификации «3. Для физических лиц может указываться номер паспорта или страховой номер индивидуального лицевого счета (СНИЛС)».

В соответствии с [форматами репозитория НРД](#) код идентификации указывается по маске: («Тип кода», «_»(нижнее подчеркивание), «Код»),

2.25 Просим пояснить по формам отчетов: СМ015 СМ092 СМ094

Условием для отчетности (не обязательной) по таким формам является только наличие заключенного договора, предметом которого является обеспечение обязательств или уплата маржевых сумм или расчет справедливой (оценочной) стоимости?
Есть какие-то другие условия?

Отчетность по этим договорам не станет обязательной с 28/06/2016?

Ответ:

- Анкета договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств (СМ015) – опциональная анкета в соответствии с п. 16.1. Приложения 8 к Указанию 3253У.
- Отчет об уплате маржевых сумм (СМ092) – условно-обязательная анкета в соответствии с п. 17. Приложения 8 к Указанию 3253У.
- Отчет о расчете справедливой (оценочной) стоимости (СМ094) – условно-обязательная анкета в соответствии с п. 17. Приложения 8 к Указанию 3253У.

Подробная инструкция по заполнению [опубликована на сайте](#) НРД/

2.26 Верно ли мы понимаем, что (вопрос только по сделкам где стороной являемся мы обязательно)

- по сделкам стороной которых является НЕ клиент репозитория, мы их отчитываем, и они будут зарегистрированы в НРД (не зависимо от того обязан ли клиент по роду своей деятельности отчитываться в Репозиторий или нет).
- Или если не клиент репозитория, но обязан отчитываться – сделки будут со статусом поданных в НРД только?
- если сторона Клиент репозитория, обязан отчитываться, но не назначил нас ИЛ-ом – сделки будут иметь статус поданных в НРД, но НЕ зарегистрированных?
- если сторона Клиент репозитория, не обязан и не назначил нас ИЛ-ом – сделки со статусом поданных в НРД?

Ответ: если контрагентом является не клиент репозитория

– односторонняя регистрация и внесения записи в реестр, без процедуры сверки.

Если контрагентом является клиент репозитория

– односторонняя регистрация и внесения записи в реестр, без процедуры сверки (Если ИЛ1=ИЛ2);

– двусторонняя регистрация с процедурой сверки (Если ИЛ1≠ИЛ2).

Подробная информация о способах согласования и статусах анкет доступна [по ссылке](#).