
Материалы по теме "Изменение правил квитовки анкет договоров, направляемых в репозиторий для регистрации"

Перечень информации для определения уникальности анкет договоров применяется в 2-х задачах:

1. Поиск встречной анкеты договора;
2. Защита от регистрации "дублей" анкеты в реестре.

Применяемый в настоящее время набор полей для проверки уникальности анкеты договора:

- код назначения;
- тип договора;
- клиент/ контрагент;
- репозитарный номер генерального соглашения/договора (при наличии);
- **клиентский номер договора¹.**

Существующая проблема.

Определение уникальности анкеты договора, направленной в репозиторий для регистрации (внесения изменений, прекращение регистрации и т.п.) при отсутствии номера договора, присвоенного клиентом, и даты, на которую актуальны сведения.

Предлагаемое решение проблемы

Определить следующий перечень информации² (блоков информации), однозначно определяющий уникальность анкеты генерального соглашения/анкеты договора при отсутствии номера генерального соглашения/договора, присвоенного репозитарием:

А. Для Анкеты Генерального соглашения

А.1. Дата заключения.

А.2. Примерные условия (форма) генерального соглашения.

Указывается тип генерального соглашения и через «слеш» год его публикации, например, НАУФОР/2011

Доступные «Типы генерального соглашения»:

- НФА
- НАУФОР
- ISDA
- ISMA
- OTHR (иное, частное ГС)

А.3. Стороны генерального соглашения.

А.4. Тип сделок, заключаемый в рамках генерального соглашения (при наличии).

А.5. Информирующее лицо (код информирующего лица)/ перечень информирующих лиц.

А.6. Назначение предоставления анкеты генерального соглашения.

Б. Для Анкеты договора репо

Б.1. Номер генерального соглашения, присвоенный репозитарием.

Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с генеральным соглашением.

Б.2. Стороны договора (первоначальный продавец и первоначальный покупатель).

Б.3. Ценные бумаги, являющиеся предметом договора репо (код/наименование и количество).

Б.4. Сумма/цена и валюта первой части договора.

Для репо по облигациям сумма/цена указывается с учетом НКД.

¹ Если клиентский номер не заполнен, или указано NONREF, система это также воспринимает как однозначный вариант заполнения клиентского номера; под совпадением клиентских номеров понимается ситуация, когда совпадают номера хотя бы одной из сторон, при условии отсутствия номеров у второй.

² В основу перечня информации положены существенные условия договоров репо и валютный своп, определенные:

1. Письмо Банка России от 14.02.2012 N 21-Т "О Генеральном соглашении "Об общих условиях заключения договоров РЕПО на рынке ценных бумаг", утвержденном Саморегулируемой организацией "Национальная фондовая ассоциация" (вместе с "Генеральным соглашением НФА об общих условиях заключения договоров РЕПО на рынке ценных бумаг (ГСР НФА)", утв. Советом СРО НФА (протокол от 30.12.2011)).

2. Стандартная документация для срочных сделок на финансовых рынках, НАУФОР (разработана по инициативе АРБ, НАУФОР и НВА). Стандартные условия конверсионных сделок, сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп. Версии 2009 и 2011 года.

- Б.5. Валюта выплаты.
- Б.6. Дата поставки/оплаты (срок поставки/оплаты) по первой части.
- Б.7. Дата поставки/оплаты (срок поставки/оплаты) по второй части ИЛИ дата открытого репо.
- Б.8. Ставка договора репо.
- Б.9. Назначение предоставления анкеты договора репо.
- Б.10. Дата сделки (дата заключения договора).

В. Для Анкеты договора валютный своп

- В.1. Номер генерального соглашения, присвоенный репозитарием.
Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с генеральным соглашением.
- В.2. Стороны договора.
- В.3. Дата сделки (дата заключения договора).
- В.4. Дата первоначального платежа (дата оплаты по первой части договора).
- В.5. Сумма первоначального платежа и валюта для первой стороны (стороны, первоначально уплачивающей сумму в котируемой валюте).
- В.6. Сумма первоначального платежа и валюта для второй стороны (стороны, первоначально уплачивающей сумму в базовой валюте).
- В.7. Сумма окончательного платежа для первой стороны (стороны, в дату окончательного платежа уплачивающей сумму в базовой валюте).
- В.8. Сумма окончательного платежа для второй стороны (стороны, в дату окончательного платежа уплачивающей сумму в котируемой валюте).
- В.9. Дата окончательного платежа (дата оплаты по второй части договора).
- В.9. Назначение предоставления анкеты договора валютный своп.

Результаты обсуждения будут рассмотрены в январе 2013г. на заседании Комитета по репозитарной деятельности при Правлении НКО ЗАО НРД и учтены при изменении технологии подбора встречных анкет.

Ваши пожелания и предложения просьба направлять по электронной почте на адрес repository@nsd.ru или Александру Ермакову ermakov@nsd.ru

Прием предложений проводится в срок до 28.12.2012 г.