

## Материалы по вопросу механизма квитовки

1. Новые алгоритмы для поиска встречных сообщений, определения уникальности и защиты от дублей при регистрации. ([Приложение 1](#)).
2. Перечень информации (блоков информации), однозначно определяющий уникальность анкеты. ([Приложение 2](#)).

Приложение 1

### Новые алгоритмы для поиска встречных сообщений, определения уникальности и защиты от дублей при регистрации.

#### Генеральные соглашения:

#### Замена ранее присланных сообщений в статусе ожидания более “свежими” анкетами.

Необходимо убедиться, что пришедшее сообщение по генеральному соглашению не содержит более “свежих” данных, чем присланное ранее и не подменяет ранее отправленное.

Для этого

1. Этап. Формируется список ранее присланных сообщений – кандидатов на замену.
  - 1.1. Выбираются все анкеты RF002, находящиеся в стадии ожидания, присланные от того же отправителя, с теми же сторонами соглашения, с теми же базовыми информирующими лицами, что и пришедшее сообщение. Формируется первичный список сообщений-кандидатов на замену.
  - 1.2. К списку применяется фильтр в зависимости от назначения пришедшего сообщения
    - 1.2.1. В случае назначения пришедшего сообщения на первичную регистрацию (REGI) - в списке сообщений сообщений-кандидатов на замену остаются только сообщения с тем же назначением (REGI).
    - 1.2.2. В случае назначения пришедшего сообщения на изменение параметров (RERE) - в списке сообщений сообщений-кандидатов на замену остаются сообщения с назначениями на изменение параметров и отмену (RERE, DERI, TRCS).
    - 1.2.3. В случае назначения пришедшего сообщения на отмену (DERI или TRCS) - в списке сообщений сообщений-кандидатов на замену остаются сообщения с назначениями на изменение параметров и отмену (RERE, DERI, TRCS).
2. Этап. Проверка по клиентскому номеру. По отправителю определяется сторона, отправившая сообщение. Если заполнен клиентский номер генерального соглашения со стороны, соответствующей отправителю (номер не пуст и не NONREF) , в списке сообщений-кандидатов на замену проводится поиск сообщения с тем же номером со стороны отправителя.
  - 2.1. Если в списке сообщение найдено – оно заменяется на полученное. Готовится отказ по найденному в списке сообщению (формируется RS004:“В сообщении [№ полученного сообщения] получена анкета с новыми данными”). Продолжаем обработку полученного сообщения.
  - 2.2. Если в списке сообщение не найдено – считаем, что заменять нечего, и продолжаем обработку полученного сообщения.

3. Этап. Если клиентский номер со стороны отправителя не заполнен (пуст или NONREF), из списка сообщений–кандидатов отбираются те, у которых не заполнен клиентский номер отправителя. Для каждого сообщения из полученного списка проводится сверка по всем полям, перечисленным в [Перечне информации](#) (блоков информации), однозначно определяющем уникальность анкеты, на соответствие между обрабатываемым сообщением и сообщением из списка кандидатов на замену.
  - 3.1. Если в списке сообщение найдено - предыдущее сообщение заменяется на полученное. По найденному в списке сообщению формируется отказ (RS004 с формулировкой “В сообщении [№ полученного сообщения] получена анкета с новыми данными”). Продолжаем обработку полученного сообщения.
  - 3.2. Если в списке сообщение не найдено – продолжается обработка полученного сообщения.

### **Проверка защиты от дублей при регистрации – только для сообщений на первичную регистрацию (REGI).**

В случае назначения пришедшего сообщения на первичную регистрацию (REGI) необходимо проверить, что сведения, содержащиеся в сообщении не были ранее зарегистрированы.

Для этого

1. Этап. Формируется список ранее зарегистрированных сообщений – кандидатов на дубль.
  - 1.1. Выбираются все ранее зарегистрированные за последние 3 операционных дня анкеты RF002, присланные от того же отправителя, с назначением на регистрацию (REGI), с теми же сторонами соглашения, с теми же базовыми информирующими лицами, что и пришедшее сообщение. Получается первичный список сообщений-кандидатов на дубль.
2. Этап. Проверка по клиентскому номеру. По отправителю определяется сторона, отправившая сообщение (БИЛ стороны совпадает с отправителем). Если заполнен клиентский номер со стороны отправителя (номер не пуст и не NONREF) , в списке сообщений сообщений-кандидатов на дубль ведется поиск с тем же номером со стороны отправителя.
  - 2.1. Если в списке сообщение найдено, полученное сообщение необходимо отменить. Формируется отказ на полученное сообщение (RS004 с формулировкой “Генеральное соглашение с №[XXX]уже зарегистрировано сообщением №[Номер найденного дубля]”. Если в списке сообщение не найдено – считается, что заменять нечего, и продолжается обработка полученного сообщения.

### **Договоры**

#### **Проверка замены ранее присланных сообщений для всех типов договоров, кроме RF014 (суммарных сведений за квартал по сделкам менее 4-х дней)**

Необходимо убедиться, что пришедшее сообщение по договору не содержит более свежих данных, чем присланное ранее и не подменяет ранее отправленное.

Для этого

1. Этап. Формируется список ранее присланных сообщений – кандидатов на замену.

- 1.1. Выбираются все анкеты, находящиеся в стадии ожидания, присланные от того же отправителя, по тому же репозитарному номеру генерального соглашения, с тем же типом (RF003, RF008, RF004, RF009) , что и пришедшее сообщение. Получается первичный список сообщений-кандидатов на замену.
- 1.2. Фильтруется список в зависимости от назначения пришедшего сообщения
  - 1.2.1. В случае назначения пришедшего сообщения на первичную регистрацию (REGI) - в списке сообщений сообщений-кандидатов на замену остаются только сообщения с тем же назначением (REGI).
  - 1.2.2. В случае назначения пришедшего сообщения на изменение параметров (RERE) - в списке сообщений сообщений-кандидатов на замену остаются сообщения с назначениями на изменение параметров и отмену (RERE, DERI).
  - 1.2.3. В случае назначения пришедшего сообщения на отмену (DERI) - в списке сообщений сообщений-кандидатов на замену остаются сообщения с назначениями на изменение параметров и отмену (RERE, DERI).
2. Этап. Проводится проверка по клиентскому номеру. По отправителю определяется сторона, отправившая сообщение: через соответствующее генеральное соглашение находится ИЛ, совпадающий с отправителем. ИЛ соответствует стороне, отправившей сообщение. Если заполнен номер анкеты со стороны отправителя (номер не пуст и не NONREF) , в списке сообщений сообщений-кандидатов на замену ведется поиск с тем же номером со стороны отправителя.
  - 2.1. Если в списке сообщение найдено – оно заменяется на полученное. По сообщению, найденному в списке, формируется отказ (RS004 с формулировкой “В сообщении [№ полученного сообщения] получена анкета с новыми данными” ). Продолжаем обработку полученного сообщения.
  - 2.2. Если в списке сообщение не найдено – считается, что заменять нечего, и продолжается обработка полученного сообщения.
3. Этап. Если клиентский номер со стороны отправителя не заполнен (пуст или NONREF), из списка сообщений–кандидатов отбираются те, у которых не заполнен клиентский номер отправителя. Для каждого сообщения из полученного списка проводится сверка по всем полям, перечисленным в [Перечне информации](#) (блоков информации), однозначно определяющем уникальность анкеты, для соответствующего типа договора, на соответствие между обрабатываемым сообщением и сообщением из списка кандидатов на замену.
  - 3.1. Если в списке сообщение найдено – оно заменяется на полученное. По найденному в списке сообщению формируется отказ (RS004 с формулировкой “В сообщении [№ полученного сообщения] получена анкета с новыми данными”). Продолжаем обработку полученного сообщения.
  - 3.2. Если в списке сообщение не найдено – считается, что заменять нечего, и продолжается обработка полученного сообщения.

### **Проверка замены ранее присланных сообщений для RF014 (суммарных сведений за квартал по сделкам менее 4-х дней)**

1. Этап. Формируется список ранее присланных сообщений – кандидатов на замену.
  - 1.1. Выбираются все анкеты RF014, находящиеся в стадии ожидания, присланные от того же отправителя, по тому же репозитарному номеру генерального соглашения, что и пришедшее сообщение. Получается первичный список сообщений-кандидатов на замену.
2. Этап. Проверяется период, указанный в сообщении. Из кандидатов на замену остаются только сообщения, в которых с полученным сообщением совпадают начало и конец периода.
3. Этап. Сверяется полученное сообщение со списком кандидатов на замену.

- 3.1. Если в списке кандидатов сообщение найдено – оно заменяется на полученное. по найденному сообщению формируется отказ (RS004 с формулировкой “В сообщении [№ полученного сообщения] получена анкета с новыми данными”). Продолжаем обработку полученного сообщения.
- 3.2. Если в списке сообщение не найдено – считается, что заменять нечего, и продолжается обработка полученного сообщения.

**Проверка защиты от дублей при регистрации – только для сообщений на первичную регистрацию (REGI) и кроме RF014 (суммарных сведений за квартал по сделкам менее 4-х дней).**

В случае назначения пришедшего сообщения на первичную регистрацию (REGI) необходимо проверить, что сведения, содержащиеся в сообщении, не были ранее зарегистрированы.

Для этого

1. Этап. Формируется список ранее зарегистрированных сообщений – кандидатов на дубль.
  - 1.1. Выбираются все ранее зарегистрированные за последние 3 операционных дня анкеты, присланные от того же отправителя, по тому же репозитарному номеру генерального соглашения, с тем же типом договора (RF003, RF004, RF014), что и пришедшее сообщение. Получается первичный список сообщений-кандидатов на дубль.
2. Этап. Проводится проверка по клиентскому номеру. По отправителю определяется сторона, отправившая сообщение (БИЛ стороны совпадает с отправителем). Если заполнен номер сообщения со стороны отправителя (номер не пуст и не NONREF), в списке сообщений сообщений-кандидатов на дубль проводится поиск на наличие сообщения с тем же клиентским номером договора со стороны отправителя.
  - 2.1. Если в списке сообщение найдено, полученное необходимо отменить. Формируется отказ по полученному сообщению (RS004 с формулировкой “Генеральное соглашение с №[XXX]уже зарегистрировано сообщением №[Номер найденного дубля]”).
  - 2.2. Если в списке сообщение не найдено – считается, что заменять нечего, и продолжается обработка полученного сообщения.

Проверка защиты от дублей при регистрации для RF014 не производится.

**Поиск встречного сообщения с анкетой договора для сверки с обрабатываемым сообщением.**

Для поиска встречного сообщения необходимо:

1. Этап. По регистрационному номеру генерального соглашения, указанного в обрабатываемом сообщении, находится соответствующее генеральное соглашение и узнается код информирующего лица, от которого ожидается встречное сообщение для сверки (Это информирующее лицо не равно отправителю текущего обрабатываемого сообщения, активно, и имеет права на отчитывание однотипных по отношению к обрабатываемому договоров).
2. Этап. Проводится поиск всех сообщений, полученных от “встречного” информирующего лица, имеющие тот же номер генерального соглашения, что и

обрабатываемое сообщение, тот же тип сообщения, то же назначение и находящиеся в статусе “Ожидание реакции контрагента”.

3. Этап. Формируется список найденных кандидатов на встречное сообщение.

Алгоритм поиска встречной анкеты отличается в зависимости от назначения анкеты договора.

3.1. В случае, если назначение анкет – на регистрацию (REGI).

3.1.1. Если в текущем заполнен хотя бы один из клиентских номеров договора (стороны 1 или стороны 2 или обеих сторон)

3.1.1.1. По списку сообщений-кандидатов на встречное ищется сообщение, для которого совпадает хотя бы одна из пар номеров (клиентских номеров со стороны 1 или клиентских номеров со стороны 2). Если такое сообщение найдено – оно является встречным. Иначе встречное ищется без учётов клиентских номеров (см 3.1.2)

3.1.2. Если в текущем не заполнены клиентские номеров договора, либо поиск по номерам не дал результата, проводится сверка по всем полям, перечисленным в [Перечне информации](#) (блоков информации), однозначно определяющем уникальность анкеты, на соответствие между обрабатываемым сообщением и сообщением из списка кандидатов на встречное.

3.1.2.1. Если в результате не нашлось ни одного сообщения из списка кандидатов – считается, что встречных сообщений не найдено.

3.1.2.2. Если в результате нашлось одно встречное сообщение из списка кандидатов – считается, что оно и является встречным.

3.1.2.3. Если в результате нашлось несколько встречных сообщений из списка кандидатов – считается, что последнее полученное из найденных и является встречным.

3.2. В случае, если назначение анкет – на изменение параметров (RERE).

Среди всех кандидатов на встречное ищется сообщение, содержащее тот же репозитарный номер договора, что и обрабатываемое и ту же дату актуальности (maRealDate). При этом:

3.2.1. Если дата актуальности в обрабатываемой анкете не заполнена, то встречной к такой анкете может быть анкета с любой датой актуальности (как с заполненной, так и не заполненной). Выбирается последняя полученная из списка подходящих.

3.2.2. Если дата актуальности в обрабатываемой анкете заполнена, то встречной к такой анкете может быть анкета с той же заполненной датой актуальности, а если такой даты не найдётся, то с незаполненной датой актуальности. Выбирается последняя полученная из списка подходящих.

3.3. В случае, если назначение анкет – на отмену (DERI).

Среди всех кандидатов на встречное ищется сообщение, содержащее тот же репозитарный номер договора, что и обрабатываемое. Выбирается последняя полученная из списка подходящих.

**F010 Сведения о внеклиринговых расчетах, связанных с обеспечением исполнения обязательств.**

**Проверка замены ранее присланных сообщений**

После проведения проверок необходимо убедиться, что пришедшее сообщение по сведениям не содержит более свежих данных, чем присланное ранее и не подменяет ранее отправленное.

Для этого

1. Этап. Формируется список ранее присланных сообщений – кандидатов на замену.
  - 1.1. Выбираются все анкеты RF010, находящиеся в стадии ожидания, присланные от того же отправителя, с теми же сторонами соглашения (поля “клиент” и “контрагент сообщения”), с теми же базовыми информирующими лицами (поля “отправитель” и “информирующее лицо контрагента”), что и пришедшее сообщение. Получается первичный список сообщений-кандидатов на замену.
2. Этап. Проверяется на список договоров, учтённых в сведениях.
  - 2.1. Если заполнен блок “расчёт по всем договорам” – из кандидатов на замену остаются только сообщения, в которых также заполнен блок “расчёт по всем договорам”.
  - 2.2. Если заполнен блок “сумма указанной вариационной маржи рассчитывается по конкретным договорам” – из кандидатов на замену остаются только сообщения, в которых также заполнен блок “расчёт по всем договорам”, и содержание блока совпадает с содержанием блока в полученном сообщении.
3. Этап. Сравнивается полученное сообщение со списком кандидатов.
  - 3.1. Если в списке сообщение найдено – оно заменяется на полученное. Формируется отказ по найденному в списке сообщению (RS004 с формулировкой “В сообщении [№ полученного сообщения] получена анкета с новыми данными”).
  - 3.2. Если в списке сообщение не найдено – считается, что заменять нечего, и продолжается обработка полученного сообщения.

Для RF010 проверки защиты от дублей при регистрации не производится.

### Перечень информации (блоков информации), однозначно определяющий уникальность анкеты.

#### **А. Для Анкеты Генерального соглашения**

А.1. Дата заключения.

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

*Поле содержит тип генерального соглашения и через «слеш» год его публикации, например, "НАУФОР/2011"*

*Состав используемых типов генеральных соглашений утверждается Комитетом по репозитарной деятельности. «Типы генерального соглашения», которые могут указываться в текущей реализации:*

- НФА
- НАУФОР
- ISDA
- RISDA
- ICMA
- GMRA
- OTHR (иное, частное ГС)

А.3. Стороны генерального соглашения (коды сторон).

А.5. Информированное лицо (код информирующего лица)/ перечень информирующих лиц (перечень кодов 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 (идентификационные коды сторон договора).
- Б.3. Ценные бумаги, являющиеся предметом договора репо (Код базового (базисного) актива ПФИ и Номинальная сумма (количество) базового (базисного) актива).
- Б.4. Сумма и валюта второй части договора. Сумма указывается в валюте договора.  
*Для репо по облигациям сумма указывается с учетом НКД.*
- 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 (идентификационные коды сторон 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.