

**Порядок  
определения уникальности регистрируемых сообщений и  
поиска встречных Анкет при квитовке сообщений**

## Оглавление

1. Обеспечение уникальности регистрируемых Генеральных соглашений	3
2. Обеспечение уникальности регистрируемых договоров	4
3. Защита от дублирования при первичной регистрации полученного сообщения.	5
4. Квитовка сообщений	6
5. Перечень информации (блоков информации), однозначно определяющий уникальность анкеты	7
СМ010. Для Анкеты Генерального соглашения	7
СМ021. Для Анкеты договора валютного свопа	7
СМ022. Для Анкеты договора конверсионной сделки	8
СМ023. Для Анкеты договора валютного опциона	8
СМ024. Для Анкеты договора валютного бинарного опциона	8
СМ031. Для Анкеты соглашения о будущей процентной ставке	9
СМ032. Для Анкеты договора процентного свопа	9
СМ033. Для Анкеты договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки	10
СМ034. Для Анкеты договора свопциона	10
СМ041. Для Анкеты договора репо	11
СМ042. Для Анкеты договора купли-продажи облигации	11
СМ043. Для Анкеты форварда на облигации	12
СМ044. Для Анкеты опциона на облигации	12
СМ045. Для Анкеты опциона на корзину облигаций	13
СМ046. Для Анкеты договора купли-продажи акции	13
СМ047. Для Анкеты форварда на акции	13
СМ048. Для Анкеты опциона на акции	14
СМ051. Для Анкеты товарного форварда	14
СМ052. Для Анкеты товарного опциона	15
СМ053. Для Анкеты товарного свопа	15
СМ054. Для Анкеты товарного свопциона	16
СМ061. Для Анкеты свопа дохода на облигации	16
СМ062. Для Анкеты свопа дохода на акции	17
СМ071. Для Анкеты кредитного дефолтного свопа	17
СМ072. Для Анкеты кредитного свопциона	18
СМ081. Для Анкеты иной сделки	18
СМ092. Для Отчета об уплате маржевых сумм	18
СМ094. Для Отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости	19
СМ093. Для Анкеты о состоянии обязательств по договорам	19

## 1. Обеспечение уникальности регистрируемых Генеральных соглашений

При поступлении сообщения, содержащего Анкету генерального соглашения возможна ситуация, когда информация о данном Генеральном соглашении была предоставлена в Репозиторий ранее либо самим отправителем Анкеты, либо его контрагентом. Что бы обеспечить защиту от «дублирования» сведений внесенных в реестр договоров, Репозиторий проверяет:

- Что отправитель Анкеты генерального соглашения в присланных ранее сообщениях не предоставлял ранее Анкету генерального соглашения того же Генерального соглашения;
- Что в системе нет зарегистрированной ранее Анкеты генерального соглашения, содержащей информацию о том же Генеральном соглашении, которое предоставлено на регистрацию в полученном сообщении.

Проверка уникальности присланной Анкеты генерального соглашения производится только в том случае, если отправитель не направлял в Репозиторий официально оформленного письма, содержащего уведомление об отказе от проверки уникальности сообщений, направляемых в Репозиторий для первичной регистрации.

Для проверки, что отправитель Анкеты генерального соглашения в присланных ранее сообщениях не предоставлял Анкету генерального соглашения, того же Генерального соглашения, производится проверка Анкет генеральных соглашений по отправителю, указанному в поле «Отправитель».

На первом этапе формируется список ранее присланных сообщений отправителя. Выбираются все Анкеты генеральных соглашений, находящиеся в статусе «Ожидание», у которых совпадают с данными присланного сообщения следующие параметры:

- Отправитель (репозитарный код отправителя);
- Стороны Генерального соглашения (репозитарные коды сторон).

Далее выбранные Анкеты генеральных соглашений фильтруются в зависимости от назначения, указанного в присланном сообщении. В списке сообщений-кандидатов на замену остаются только сообщения, направленные на первичную регистрацию.

Далее производится проверка уникальности сообщения по регистрационному номеру Генерального соглашения, присвоенного клиентом:

- Если в полученном сообщении в поле «Регистрационный номер соглашения, присвоенный стороной...» указано значимое значение (поле не пусто и не указано значение NONREF) присвоенного Клиентом стороны-отправителем номера Генерального соглашения, в списке сообщений-кандидатов на замену проводится поиск сообщения с тем же номером со стороны отправителя. Если такое сообщение в списке найдено – оно заменяется на полученное, а в отношении заменяемого сообщения готовится отказ (форма RM002, с указанием в причине отказа «В сообщении [№ полученного сообщения] получена Анкета с новыми данными»). В отношении нового сообщения, заменившего ранее полученное, продолжается его обработка с целью регистрации в системе учета Репозитария. Если в списке сообщение не найдено – считается, что получено абсолютно новое сообщение и продолжается обработка этого сообщения с целью его регистрации в системе учета Репозитария.

- В случае, если в полученном сообщении поле «Регистрационный номер соглашения, присвоенный стороной...» не указано значимое значение (поле пусто или указано значение NONREF), из списка сообщений-кандидатов на замену отбираются сообщения, у которых так же не указано значимое значение присвоенного стороной-отправителем номера Генерального соглашения. Для каждого сообщения из полученного списка проводится сверка по всем полям, перечисленным в «Перечне информации, (блоков информации), однозначно определяют уникальность Анкеты», на их соответствие аналогичным полям обрабатываемого сообщения. Если такое сообщение в списке найдено - предыдущее сообщение заменяется на полученное, а в отношении заменяемого сообщения готовится отказ (форма RM002, с указанием в причине отказа «В сообщении [№ полученного сообщения] получена Анкета с новыми данными»). В

отношении нового сообщения, заменившего ранее полученное, продолжается его обработка с целью регистрации в системе учета Репозитария. Если в списке сообщение не найдено – считается, что получено абсолютно новое сообщение и продолжается обработка этого сообщения с целью его регистрации в системе учета Репозитария.

## **2. Обеспечение уникальности регистрируемых договоров**

При поступлении Анкеты договора возможна ситуация, когда информация о данном договоре была предоставлена в Репозитарий ранее либо самим отправителем Анкеты договора, либо его контрагентом. Чтобы обеспечить защиту от «дублирования» регистрации Репозитарий проверяет:

- Что отправитель Анкеты договора в присланных ранее сообщениях не предоставлял Анкету договора того же договора;
- Что в системе нет зарегистрированных ранее Анкет договоров, содержащих информацию о том же договоре, который предоставлен на регистрацию в полученном сообщении.

Проверка уникальности присланной Анкеты договора производится только в том случае, если Отправитель не направлял в Репозитарий официально оформленного письма, содержащего уведомление об отказе от проверки уникальности сообщений, направляемых в Репозитарий для первичной регистрации.

Для проверки, что отправитель Анкеты договора в присланных ранее сообщениях не предоставлял Анкету договора того же договора, производится проверка Анкет договоров по отправителю, указанному в поле «Отправитель».

На первом этапе формируется список ранее присланных сообщений. Выбираются все Анкеты договоров, находящиеся в статусе «Ожидание», у которых совпадают с данными присланного сообщения следующие параметры:

- Отправитель (код отправителя);
- Регистрационный номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием;
- Тип сообщения (СМ041, СМ093, СМ021).

Из отобранных сообщений формируется первичный список сообщений-кандидатов на замену.

Далее Анкеты договоров фильтруются в зависимости от назначения, указанного в присланном сообщении. В списке сообщений-кандидатов на замену остаются только сообщения на первичную регистрацию

Исходя из информации, содержащейся в Генеральном соглашении, номер которого указан в присланной Анкете договора определяется легитимное Информирующее лицо. Информирующее лицо должно соответствовать стороне, отправившей сообщение.

Далее производится проверка уникальности сообщения по регистрационному номеру Анкеты договора, присвоенному стороной-отправителем:

- Если в полученном сообщении в поле «Регистрационный номер договора, присвоенный стороной...» указано значимое значение (поле не пусто и не указано значение NONREF) присвоенного стороной-отправителем, номера договора, в списке сообщений-кандидатов на замену проводится поиск сообщения с тем же номером со стороны отправителя. Если такое сообщение в списке найдено – оно заменяется на полученное, а в отношении заменяемого сообщения готовится отказ (форма RM002, с указанием в причине отказа «В сообщении [№ полученного сообщения] получена Анкета договора с новыми данными»). В отношении нового сообщения, заменившего ранее полученное, продолжается его обработка с целью регистрации в системе учета Репозитария. Если в списке сообщение не найдено – считается, что получено абсолютно новое сообщение и его обработка продолжается с целью регистрации в системе учета Репозитария.

- В случае, если в полученном сообщении в поле «Регистрационный номер договора, присвоенный стороной...» не указано значимое значение (поле пусто или указано значение NONREF), из списка сообщений–кандидатов отбираются сообщения, у которых не заполнен клиентский номер договора со стороны отправителя. Для каждого сообщения из полученного списка проводится сверка по всем полям, перечисленным в «Перечне информации (блоков информации), однозначно определяющий уникальность Анкеты», для соответствующего типа договора на соответствие между обрабатываемым сообщением и сообщением из списка кандидатов на замену. Если такое сообщение в списке найдено - предыдущее сообщение заменяется на полученное, а в отношении заменяемого сообщения готовится отказ (форма RM002, с указанием в причине отказа «В сообщении [№ полученного сообщения] получена Анкета договора с новыми данными»). В отношении нового сообщения, заменившего ранее полученное, находившееся в стадии ожидания, продолжается его обработка с целью регистрации в системе учета Репозитария. Если в списке сообщение не найдено – считается, что получено абсолютно новое сообщение и его обработка продолжается с целью регистрации в системе учета Репозитария.

### **3. Защита от дублирования при первичной регистрации полученного сообщения.**

Данная проверка выполняется только для сообщений на первичную регистрацию Анкет (и используется для исключения возможности «двойного» внесения в реестр сведений об одном и том же Генеральном соглашении или договоре, предоставленного разными сторонами. Проверка проводится непосредственно перед внесением информации в реестр и состоит из нескольких этапов.

На первом этапе формируется список ранее зарегистрированных сообщений. В список отбираются все ранее зарегистрированные в системе Репозитария за последние 4 операционных дня Анкеты, у которых совпадают с данными сообщения-кандидата на регистрацию следующие параметры:

Для Генеральных соглашений:

- Стороны Генерального соглашения (репозитарные коды сторон).

Для договоров:

- Регистрационный номер Генерального соглашения в системе Репозитария;
- Тип договора (CM041, CM021).

Если в проверяемом сообщении указан регистрационный номер Генерального соглашения или договора, присвоенный одной из сторон, то далее проводится проверка уникальности сообщения по данному номеру.

В случае, если в проверяемом сообщении и в каком-либо сообщении из списка совпадают заполненные значимым значением (поле не пусто и не указано значение NONREF) клиентские номера для одной из сторон, то поступившее на регистрацию проверяемое сообщение необходимо отменить. Формируется отказ по полученному сообщению (форма RM002 с формулировкой «Генеральное соглашение с №[XXX]уже зарегистрировано сообщением №[Номер найденного дубля]» – для Генеральных соглашений, и «Договор с №[XXX]уже зарегистрирован сообщением №[Номер найденного дубля]» - для договоров).

В случае, если в проверяемом сообщении и в сообщениях из списка клиентские номера не совпадают, то из списка удаляются все сообщения, у которых заполнен клиентский номер стороны «Отправителя», после чего проводится проверка по всем полям, перечисленным в «Перечне информации (блоков информации), однозначно определяющий уникальность Анкеты» (для соответствующего типа договора) на соответствие между обрабатываемым сообщением и сообщением из списка кандидатов на дубль.

#### 4. Квитовка сообщений

После поступления в систему сообщения, содержащего Анкету договора, и прохождения процедуры проверки уникальности и защиты от повторной регистрации сообщения клиента в системе Репозитария осуществляется поиск встречного сообщения для сверки с обрабатываемым сообщением.

По указанному в полученной Анкете договора репозитарному коду Генерального соглашения в реестре договоров находится соответствующее Генеральное соглашение и определяется код Информирующего лица контрагента Клиента по данному Генеральному соглашению, от которого ожидается встречное сообщение для сверки. Данное Информирующее лицо не должно совпадать с отправителем текущего обрабатываемого сообщения, и должно быть наделено правом на передачу сведений в Репозитарий по однотипным по отношению к обрабатываемому сообщению договорам.

Формируется список ранее присланных сообщений. Выбираются все Анкеты, полученные от Информирующего лица контрагента Клиента по Генеральному соглашению, находящиеся в статусе «Ожидание», у которых совпадают с данными анализируемого сообщения следующие параметры:

- Репозитарный номер Генерального соглашения,
- Тип сообщения;
- Назначение.

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

Для Анкет договоров, направленных на первичную регистрацию.

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

Если в текущем сообщении не заполнены клиентские номера договора, либо поиск по номерам не дал результата, проводится поиск сообщения со сверкой по всем полям, перечисленным в Перечне информации (блоков информации), однозначно определяющий уникальность Анкеты договора и однозначно определяющим соответствие между обрабатываемым сообщением и сообщением из списка кандидатов на встречное сообщение.

Если в результате в списке не нашлось ни одного сообщения – считается, что встречных сообщений не найдено.

Если в результате в списке нашлось одно встречное сообщение – считается, что оно и является встречным.

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

Для анкет договоров, направленных для изменения параметров.

Среди всех сообщений-кандидатов на встречное ищется сообщение, содержащее тот же репозитарный номер договора, что и обрабатываемое и ту же дату актуальности (поле «Дата актуальности сведений, предоставленных в Анкете»).

Если дата актуальности в обрабатываемой Анкете договора заполнена, то встречной к такой Анкете договора может быть только Анкета договора с той же датой актуальности, что и у обрабатываемой анкеты договора.

Если дата актуальности в обрабатываемой Анкете договора не заполнена, то встречной к такой Анкете договора может быть Анкета договора с любой датой актуальности (как с заполненной,

так и не заполненной). Из списка подходящих Анкет договоров выбирается последняя полученная.

Для Анкет договоров, направленных для внесения сведений в реестр договоров о прекращении договора.

В списке осуществляется поиск сообщения, содержащего тот же репозитарный номер договора, что и обрабатываемое сообщение.

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

## **5. Перечень информации (блоков информации), однозначно определяющий уникальность Анкеты**

### **СМ010. Для Анкеты Генерального соглашения**

1. Дата заключения Генерального соглашения.
2. Дата совершения отчитываемого события.
3. Тип Генерального соглашения.

Состав используемых типов Генеральных соглашений утверждается Комитетом по репозитарной деятельности.

4. Версия Генерального соглашения.

Состав используемых версий Генеральных соглашений утверждается Комитетом по репозитарной деятельности.

5. Стороны Генерального соглашения (коды сторон).

### **СМ021. Для Анкеты договора валютного свопа**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора).
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Дата первоначального платежа (дата оплаты по первой части договора).
7. Сумма и валюта первоначального платежа для первой валюты (сторона плательщик и сторона получатель данной валюты и суммы).
8. Сумма и валюта первоначального платежа для второй валюты (сторона плательщик и сторона получатель данной валюты и суммы).
9. Сумма и валюта окончательного платежа для первой валюты (сторона плательщик и сторона получатель данной валюты и суммы).
10. Сумма и валюта окончательного платежа для второй валюты (сторона плательщик и сторона получатель данной валюты и суммы).
11. Дата окончательного платежа (дата оплаты по второй части договора).
12. Торгуемая валюта (базовый актив).
13. Назначение предоставления Анкеты договора валютного свопа.

#### **СМ022. Для Анкеты договора конверсионной сделки**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора).
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Дата платежа (дата оплаты по договору).
7. Сумма и валюта для первой валюты (сторона плательщик и сторона получатель данной валюты и суммы).
8. Сумма и валюта для второй валюты (сторона плательщик и сторона получатель данной валюты и суммы).
9. Торгуемая валюта (базовый актив).
10. Назначение предоставления Анкеты договора конверсионной сделки.

#### **СМ023. Для Анкеты договора валютного опциона**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Дата начала и окончания срока осуществления права на исполнение либо Дата исполнения опциона.
7. Сумма и валюта на продажу.
8. Сумма и валюта на покупку.
9. Оговоренный тип опциона.
10. Цена исполнения (Обменный курс и Базис котировки цены исполнения).
11. Сумма и валюта премии по опциону.
12. Назначение предоставления Анкеты договора валютного опциона.

#### **СМ024. Для Анкеты договора валютного бинарного опциона**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.



2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Дата начала и окончания срока осуществления права на исполнение либо Дата исполнения опциона.
7. Условие касания либо Триггерное условие (Базис котировки и Триггерный курс).
8. Сумма и валюта выплаты по бинарному опциону.
9. Сумма и валюта премии по опциону.
10. Назначение предоставления Анкеты договора валютного бинарного опциона.

### **СМ031. Для Анкеты соглашения о будущей процентной ставке**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Дата начала и истечения срока.
7. Дата платежа (дата оплаты по договору).
8. Сумма и валюта Номинальной суммы по договору.
9. Фиксированная ставка.
10. Индекс плавающей ставки.
11. Назначение предоставления Анкеты соглашения о будущей процентной ставке.

### **СМ032. Для Анкеты договора процентного свопа**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора).
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Дата начала и истечения срока.

7. Начальное значение номинальной суммы по первой части договора.
8. Индекс плавающей ставки либо начальное значение фиксированной процентной ставки первой части договора.
9. Начальное значение номинальной суммы по второй части договора.
10. Индекс плавающей ставки либо начальное значение фиксированной процентной ставки второй части договора.
11. Назначение предоставления Анкеты договора процентного свопа.

**СМ033. Для Анкеты договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора).
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Дата начала и истечения срока.
7. Начальное значение номинальной суммы.
8. Индекс плавающей ставки.
9. Сумма и валюта премии по договору.
10. Назначение предоставления Анкеты договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки.

**СМ034. Для Анкеты договора свопциона**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Сумма и валюта премии по опциону.
7. Дата начала и окончания срока осуществления права на исполнение либо Дата (Даты) исполнения опциона.
8. Дата начала и истечения срока свопа.
9. Начальное значение номинальной суммы по первой части свопа.
10. Индекс плавающей ставки либо начальное значение фиксированной процентной ставки первой части свопа.

11. Начальное значение номинальной суммы по второй части свопа.
12. Индекс плавающей ставки либо начальное значение фиксированной процентной ставки второй части свопа.
13. Назначение предоставления Анкеты договора свопциона.

#### **СМ041. Для Анкеты договора репо**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - первоначальный продавец;
  - первоначальный покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Сумма и валюта расчетов по первой части договора.
7. Сумма и валюта либо просто валюта расчетов по второй части договора.
8. Дата поставки/оплаты (срок поставки/оплаты) по первой части.
9. Дата поставки/оплаты (срок поставки/оплаты) по второй части ИЛИ дата открытого репо.
10. Тип срока репо.
11. Ставка договора репо (индекс плавающей ставки либо начальное значение фиксированной процентной ставки).
12. Ценные бумаги, являющиеся предметом договора репо (Код базового (базисного) актива договора репо и Номинальная сумма (количество) базового (базисного) актива).
13. Назначение предоставления Анкеты договора репо.

#### **СМ042. Для Анкеты договора купли-продажи облигации**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Сумма и валюта номинальной суммы по договору.
7. Чистая цена облигации.

8. Идентификатор базового актива (облигации).
9. Дата расчетов/поставки по договору.
10. Назначение предоставления Анкеты договора купли-продажи облигации.

#### **СМ043. Для Анкеты форварда на облигации**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Облигации/индексы, являющиеся предметом договора (Код и количество базового актива).
7. Сумма и валюта номинальной суммы по договору.
8. Дата расчетов/поставки по договору.
9. Форвардная цена в процентах.
10. Назначение предоставления Анкеты форварда на облигации.

#### **СМ044. Для Анкеты опциона на облигации**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Тип опциона.
7. Сумма и валюта премии по договору.
8. Дата начала и окончания срока осуществления права на исполнение либо Дата (Даты) исполнения опциона.
9. Сумма и валюта номинальной суммы по договору.
10. Цена исполнения (в валюте либо в процентах).
11. Идентификатор базового актива (облигации).
12. Назначение предоставления Анкеты опциона на облигации.

#### **СМ045. Для Анкеты опциона на корзину облигаций**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Тип опциона.
7. Сумма и валюта премии по договору.
8. Дата начала и окончания срока осуществления права на исполнение либо Дата (Даты) исполнения опциона.
9. Сумма и валюта номинальной суммы по договору.
10. Цена исполнения (в валюте либо в процентах).
11. Облигации/индексы, являющиеся предметом договора (Код и количество базового актива).
12. Назначение предоставления Анкеты опциона на корзину облигаций.

#### **СМ046. Для Анкеты договора купли-продажи акции**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Количество единиц базового актива по договору.
7. Сумма и валюта цены за единицу базового актива по договору.
8. Идентификатор базового актива (акции).
9. Дата расчетов/поставки по договору.
10. Назначение предоставления Анкеты договора купли-продажи акции.

#### **СМ047. Для Анкеты форварда на акции**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.

2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Акции/индексы, являющиеся предметом договора (Код и количество базового актива).
7. Дата окончания срока действия договора.
8. Сумма и валюта форвардной цены по договору.
9. Назначение предоставления Анкеты форварда на акции.

#### **СМ048. Для Анкеты опциона на акции**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Тип опциона.
7. Акции/индексы, являющиеся предметом договора (Код и количество базового актива).
8. Дата начала и окончания срока осуществления права на исполнение либо Дата (Даты) исполнения опциона.
9. Сумма и валюта цены исполнения.
10. Количество единиц базового актива по договору.
11. Сумма и валюта премии по договору.
12. Назначение предоставления Анкеты опциона на акции.

#### **СМ051. Для Анкеты товарного форварда**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора).
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.

6. Сумма и валюта форвардной цены по договору (цена за единицу товара и общая сумма).
7. Даты платежей/поставки по договору.
8. Идентификатор базового актива (товара).
9. Единица измерения и количество поставляемого товара.
10. Назначение предоставления Анкеты товарного форварда.

#### **СМ052. Для Анкеты товарного опциона**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Идентификатор базового актива (товара).
7. Единица измерения и количество поставляемого товара.
8. Дата начала и окончания срока осуществления права на исполнение либо Дата (Даты) исполнения опциона.
9. Даты платежей/поставки по договору.
10. Сумма и валюта цены страйка на единицу товара.
11. Расчетный период погодного контракта (первый и последний день).
12. Номинальная сумма погодного контракта (сумма и валюта).
13. Уровень страйка погодного индекса (Количество пунктов и пункт индекса).
14. Сумма и валюта премии по договору.
15. Назначение предоставления Анкеты товарного опциона.

#### **СМ053. Для Анкеты товарного свопа**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора).
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Дата начала и истечения срока свопа.
7. Расчетные даты и даты платежей/поставки.

8. Сумма и валюта всех фиксированных платежей.
9. Идентификатор базового актива (товара).
10. Единица измерения и количество поставляемого товара.
11. Первоначальная цена единицы товарного актива.
12. Уровень погодного индекса (Количество пунктов и пункт индекса).
13. Номинальная сумма погодного контракта (сумма и валюта).
14. Назначение предоставления Анкеты товарного свопа.

#### **СМ054. Для Анкеты товарного свопциона**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Дата начала и истечения срока свопа.
7. Расчетные даты и даты платежей/поставки.
8. Сумма и валюта всех фиксированных платежей.
9. Идентификатор базового актива (товара).
10. Единица измерения и количество поставляемого товара.
11. Первоначальная цена единицы товарного актива.
12. Уровень погодного индекса (Количество пунктов и пункт индекса).
13. Номинальная сумма погодного контракта (сумма и валюта).
14. Дата начала и окончания срока осуществления права на исполнение либо Дата (Даты) исполнения опциона.
15. Сумма и валюта премии по договору.
16. Назначение предоставления Анкеты товарного свопциона.

#### **СМ061. Для Анкеты свопа дохода на облигации**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).



4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Сумма и валюта номинальной суммы (по первой и второй части договора).
7. Индекс плавающей ставки либо Фиксированная ставка.
8. Облигации/индексы, являющиеся предметом договора (Код и количество базового актива).
9. Дата платежа по договору.
10. Назначение предоставления Анкеты свопа дохода на облигации.

#### **СМ062. Для Анкеты свопа дохода на акции**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Сумма и валюта номинальной суммы (по первой и второй части договора).
7. Индекс плавающей ставки либо Фиксированная ставка.
8. Акции/индексы, являющиеся предметом договора (Код и количество базового актива).
9. Дата платежа по договору.
10. Назначение предоставления Анкеты свопа дохода на акции.

#### **СМ071. Для Анкеты кредитного дефолтного свопа**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Дата начала и истечения срока свопа.
7. Идентификатор референсного лица.
8. Облигации/индексы, являющиеся предметом договора (Код и количество базового актива).

9. Сумма и валюта номинальной суммы покрытия защиты.
10. Назначение предоставления Анкеты кредитного дефолтного свопа.

#### **СМ072. Для Анкеты кредитного свопциона**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Тип опциона.
7. Сумма и валюта премии по договору.
8. Дата начала и окончания срока осуществления права на исполнение либо Дата (Даты) исполнения опциона.
9. Номинальная сумма и валюта базисного актива опциона.
10. Дата начала и истечения срока свопа.
11. Идентификатор референсного лица.
12. Облигации/индексы, являющиеся предметом договора (Код и количество базового актива).
13. Сумма и валюта номинальной суммы покрытия защиты.
14. Назначение предоставления Анкеты кредитного свопциона.

#### **СМ081. Для Анкеты иной сделки**

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора).
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Общая денежная сумма и валюта, подлежащая уплате Стороне 1 и Стороне 2.
7. Назначение предоставления Анкеты иной сделки.

#### **СМ092. Для Отчета об уплате маржевых сумм**

1. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора).
2. Дата совершения отчитываемого события.

3. Перечень сделок для отчета (Идентификаторы сделок либо Идентификационный номер Генерального соглашения).
4. Дата расчета маржевой суммы.
5. Назначение предоставления отчета об уплате маржевых сумм.

**СМ094. Для Отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости**

1. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора).
2. Дата совершения отчитываемого события.
3. Перечень сделок для отчета (Идентификаторы сделок либо Идентификационный номер Генерального соглашения).
4. Дата оценки.
5. Тип оценки стоимости.
6. Назначение предоставления отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости.

**СМ093. Для Анкеты о состоянии обязательств по договорам**

1. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора).
2. Дата совершения отчитываемого события.
3. Идентификаторы сделок.
4. Назначение предоставления Анкеты о состоянии обязательств по договорам.

**Примечание.**

Для сравнения поля, содержащие суммы и количество, сверяются до 6-знаков после запятой. В случае, если количество знаков больше, то перед сравнением производится округление до 6-знаков после запятой по правилам округления для валюты. В случае если количество знаков меньше, то перед сравнением добавляются нули в необходимом количестве (например, 0,345000).