

Приложение № 1
к приказу НКО АО НРД
от 05.12.2025 № НРД-П-2025-507

Инструкция по заполнению форм Торгового репозитария

Содержание

I.	Общие параметры сообщения.....	4
II.	Особые параметры сделки.....	11
III.	Обеспечение по сделке.....	18
IV.	Экономические параметры сделки.....	19
1.	Анкета валютного свопа (CM021).....	19
2.	Анкета конверсионной сделки (валютного форварда) (CM022).....	22
3.	Анкета валютного опциона (CM023).....	24
4.	Анкета бинарного валютного опциона (CM024).....	28
5.	Анкета соглашения о будущей процентной ставке (CM031).....	31
6.	Анкета процентного свопа (CM032).....	33
7.	Анкета договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки (CM033).....	39
8.	Анкета свопциона (CM034).....	43
9.	Анкета договора РЕПО (CM041).....	45
10.	Анкета договора купли-продажи облигации (CM042).....	52
11.	Анкета форварда на облигацию или индекс (CM043).....	54
12.	Анкета опциона на облигацию (CM044).....	58
13.	Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (CM045).....	63
14.	Анкета договора купли-продажи акции (CM046).....	66
15.	Анкета форварда на акцию (CM047).....	68
16.	Анкета опциона на акцию (CM048).....	71
17.	Анкета свопа дохода на облигацию (CM061).....	77
18.	Анкета свопа дохода на акцию (CM062).....	83
19.	Анкета товарного форварда (CM051).....	90
20.	Анкета товарного опциона (CM052).....	93
21.	Анкета товарного свопа (CM053).....	99
22.	Анкета товарного свопциона (CM054).....	104
23.	Анкета кредитного дефолтного свопа (CM071).....	106
24.	Анкета кредитного дефолтного свопциона (CM072).....	112
25.	Анкета иной сделки (CM081).....	117
V.	Отчет об уплате маржевых сумм (CM092).....	121
VI.	Отчет о расчете справедливой (оценочной) стоимости (CM094).....	125
VII.	Анкета договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств (CM015).....	128
VIII.	Анкета о состоянии обязательств по договорам (CM093).....	130
IX.	Анкета генерального соглашения (CM010).....	132
X.	Анкета прекращения генерального соглашения (CM011).....	133
XI.	Заявление о назначении Информировующих лиц (CM016).....	134
XII.	Заявление об отказе от функций Информировующего лица (CM017).....	140
XIII.	Заявление на подключение/отключение сервиса форматно-логического контроля (CM018).....	141
XIV.	Правила формирования сообщений в bulk-формате (CM083, CM084, CM085).....	143
XV.	Проверки, вызывающие отказы в обработке сообщений.....	153

XVI. Основные поля Разделов 1, 2 и 3 Реестра договоров	190
ПРИЛОЖЕНИЕ 1	206
ПРИЛОЖЕНИЕ 2	229

Инструкция по заполнению форм Торгового репозитория создана в соответствии с нормативными актами Банка России и Правилами осуществления репозитарной деятельности НКО АО НРД.

Термины и определения используются в значениях, установленных законодательством Российской Федерации, иными нормативными правовыми актами, нормативными актами Банка России, Договором ЭДО НРД, Правилами осуществления репозитарной деятельности НКО АО НРД и документами НРД, определяющими порядок оказания услуг по управлению обеспечением.

I. Общие параметры сообщения

Общие параметры Анкеты договора (СМ021 – СМ081), Анкеты генерального соглашения (СМ010), Отчета об уплате маржевых сумм (СМ092), Отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости (СМ094), Анкеты о состоянии обязательств по договорам (СМ093), Анкеты договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств (СМ015). Данные элементы определяют участников сообщения и присваиваемые ими идентификаторы.¹

1. Договор заключен вне рамок Генерального соглашения

Заполняется в Анкете договора

Элемент	Описание	Сверка ²	Формат заполнения
Договор заключен вне рамок Генерального соглашения <nonStandardTerms>	Фиксированное значение: “true”. Заполняется, если договор заключен вне рамок Генерального соглашения. Не допускается изменение значения данного параметра в сообщении о внесении изменений в зарегистрированную Анкету договора. <i>Не заполняется</i> , если договор заключен в рамках Генерального соглашения (в таком случае используется элемент «Номер Генерального соглашения»).	Mfr	Значение “true”

2. Номер Генерального соглашения

Заполняется в Анкете договора

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Регистрационный номер Генерального соглашения <partyReference href="TradeRepository"/> <linkId>	Регистрационный номер, присвоенный Репозитарием в соответствии с Извещением о регистрации (RM001) Анкеты генерального соглашения (СМ010), в рамках которого заключен договор. Не допускается изменение значения данного параметра в сообщении о внесении изменений в зарегистрированную Анкету договора. <i>Не заполняется</i> , если договор заключен вне рамок Генерального соглашения (в таком случае используется элемент «Договор заключен вне рамок Генерального соглашения»).	mfr	Первые два символа – “MA”, далее 10 цифр. Например, MA0000000123

3. Номер CSA репозитория

Заполняется в Анкете договора

¹ Подробные правила присвоения идентификаторов см. в Инструкции по заполнению идентификаторов анкеты и Инструкции по заполнению блока <party> и идентификаторов участников.

² Типы сверки определены в поле «Условия согласования параметров сделки (договора)» (<reconciliationType>).

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Регистрационный номер договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств <partyReference href="TradeRepository"/> <originatingTradeId> <tradeId>	Идентификационный код, присвоенный Репозитарием в соответствии с Извещением о регистрации (RM001) Анкеты договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств (CM015). <i>Не заполняется</i> , если Анкета договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств (CM015) не зарегистрирована.	sfr	Например, CSA1234567890

4. Сторона 1

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификационный код³ <party id="Party1"> <partyId>	Репозитарный код Стороны 1 в соответствии со Справочником участников Репозитария (столбец «Идентификационный код / Identification Code»). Если Сторона 1 не является клиентом Репозитария НРД, указывается «NONREF». Сторона 1 и Сторона 2 определяются так же, как они указаны в Анкете генерального соглашения (CM010), в рамках которого заключен договор. Если договор заключен вне рамок Генерального соглашения, контрагентам необходимо заранее согласовать порядок указания сторон между собой. Не допускается изменение значения данного параметра в сообщении о внесении изменений в зарегистрированную Анкету договора. ⁴	mfr	Значение из справочника https://www.nsd.ru/common/files/repository_files/directory_repository.xls
Наименование участника <party id="Party1"> <partyName>	Наименование Стороны 1. Для клиентов Репозитария НРД указывается Полное наименование в соответствии со Справочником участников Репозитария. Квитовка русского и английского наименований обеспечивается, если они указаны из Справочника участников Репозитария. Значение «NONREF» не допускается. Для физических лиц указывается фамилия, имя и отчество (при наличии) на русском или английском языке.	mfr	

5. LEI/SWIFT/INN стороны 1

³ В xsd-схеме формата элемент <partyId> является повторяемым и для каждой стороны, задаваемой атрибутом <id>, включается в сообщение дважды для указания двух идентификаторов: репозитарного кода и кода LEI. В формах Web-кабинета Репозитария предусмотрены отдельные поля: «Сторона 1» («Сторона 2») и «LEI/SWIFT/INN стороны 1» («LEI/SWIFT/INN стороны 2»).

⁴ В случае уступки требования третьему лицу (замены стороны по сделке) необходимо зарегистрировать новую Анкету договора с новым кодом UTI. При этом в качестве значения элемента «Дата заключения сделки» (<tradeDate>) в новой Анкете договора рекомендуется указывать первоначальную дату заключения договора, а качестве значения элемента «Дата совершения отчитываемого события» (<asOfDate>) указывается дата уступки требования.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификационный код <party id="Party1"> <partyId>	<p>Для юридических лиц, обязанных предоставлять информацию в репозиторий, указывается международный код идентификации юридического лица (Legal Entity Identifier, LEI). Для физических лиц указывается номер паспорта (PASS) или страховой номер индивидуального лицевого счета, СНИЛС (SNILS). Например, SNILS_XXX-XXX-XXX XX (X – цифры от 0 до 9).</p> <p>Для юридических лиц, не обязанных предоставлять информацию в репозиторий и не имеющих кода LEI, применимы следующие типы кодов: для юридических лиц – ИНН (INN), дополнительно для иностранных юридических лиц – код SWIFT (SWIFT), коды информационных систем Bloomberg (BLOOM) и Thomson Reuters (THRTR) либо иной код (OWN).</p>	mfr	Маска: «LEI» «нижнее подчеркивание» «код», не более 35 символов. Например, LEI_253400M18U5TB02TW421

6. Классификация стороны 1

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Вид экономической деятельности <party id="Party1"> <classification>	<p>Вид экономической деятельности Стороны 1, соответствующий лицензии, на основании которой заключен договор. В случае совмещения нескольких видов деятельности (в том числе при регистрации Генерального соглашения) указывается любой из видов деятельности Стороны 1.</p> <p>Значение “Other” применимо только в отношении лиц, не обязанных предоставлять информацию в репозиторий.</p> <p>Значение “NONREF” применимо только в отношении стороны-контрагента при двусторонней регистрации Анкеты и должно быть скорректировано контрагентом при последовательном подтверждении.</p>	sfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/north-american-industry-classification-system(nsdus)

7. Страна стороны 1

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Страна <party id="Party1"> <country>	<p>Код страны регистрации юридического лица или гражданства физического лица.</p> <p>Для российских юридических и физических лиц указывается “RU”.</p>	sfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso3166(fpmlrus)

8. Тип организации стороны 1

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Тип лица <party id="Party1"> <organizationType>	<p>Тип Стороны 1. Допустимые значения: “Р” – физическое лицо, “L” – юридическое лицо</p>	sfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/organization-

			<u>type(nsdru)</u>
--	--	--	--------------------

9. Номер договора в системе учёта первой стороны

Заполняется в Анкете договора и Анкете генерального соглашения

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Регистрационный номер <partyReference href="Party1"/> <tradeId>	Уникальный идентификатор договора/ Генерального соглашения, присвоенный Стороной 1. При первичной регистрации допускается использовать "NONREF" в качестве значения идентификатора, присвоенного контрагентом. При направлении сообщения о внесении изменений в зарегистрированную Анкету указывается Регистрационный номер договора Стороны 1 в соответствии с Извещением о регистрации (RM001) данной Анкеты.	mfr	Цифры и буквы латинского алфавита, не более 35 символов

10. Номер CSA стороны 1

Заполняется в Анкете договора

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Регистрационный номер договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств <partyReference href="Party1"/> <originatingTradeId> <tradeId>	Указывается идентификатор договора о порядке уплаты маржевых сумм, присвоенный Стороной 1. Если для одной из сторон данный идентификатор включен в сообщение, для второй стороны он указывается обязательно, при этом допускается значение "NONREF". Для собственного номера, присвоенного Стороной 1, значение "NONREF" не допускается. Если зарегистрирована Анкета договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств (CM015), указывается идентификатор, присвоенный Стороной 1 в соответствии с данной Анкетой. <i>Не заполняется</i> , если договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм не заключен.	sfr	Цифры и буквы латинского алфавита, не более 35 символов

Элементы 11-17 заполняются аналогично пп. 4-10 в отношении Стороны 2 (Party 2) по договору.

11. Сторона 2

12. LEI/SWIFT/INN стороны 2

13. Классификация стороны 2

14. Страна стороны 2

15. Тип организации стороны 2

16. Номер договора в системе учёта второй стороны

17. Номер CSA стороны 2

18. Отправитель. LEI отправителя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификационный код <party id="Sender"> <partyId>	Репозитарный код Информирющего лица (отправителя сообщения) в соответствии со Справочником участников Репозитария (столбец «Идентификационный код/ Identification Code»). Информирующие лица и их полномочия определяются в Заявлении о назначении Информирующих лиц (СМ016).	mfr	Значение из справочника на сайте https://www.nsd.ru/services/repozitariy/
Идентификационный код <party id="Sender"> <partyId>	Код LEI Информирющего лица	mfr	Например, LEI_253400M18U5TB02TW421
Наименование участника <party id="Sender"> <partyName>	Полное наименование Информирющего лица в соответствии со Справочником участников Репозитария	mfr	Значение из справочника на сайте https://www.nsd.ru/services/repozitariy/

19. Формирующее UTI лицо

Заполняется обязательно в Анкете договора и Анкете генерального соглашения⁵

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификационный код <party id="UTIGeneratingParty"> <partyId>	Репозитарный код Формирующего UTI лица, т.е. стороны договора или третьего лица, формирующего и присваивающего уникальный код идентификации договора (Unique Trade Identifier, UTI) по соглашению сторон договора	mfr	Значение из справочника на сайте https://www.nsd.ru/services/repozitariy/
Идентификационный код <party id="UTIGeneratingParty"> <partyId>	Код LEI Формирующего UTI лица	mfr	Например, LEI_253400M18U5TB02TW421
Регистрационный номер <partyReference href="UTIGeneratingParty">	Уникальный код идентификации договора (UTI), формируемый в соответствии с Приложением 8 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У ⁶	mfr	См. Приложение 8 к Указанию Банка России от 16.08.2016 №

⁵ Может заполняться в Анкете договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств (СМ015), если код UTI присвоен такому договору.

⁶ Формирующее UTI лицо может самостоятельно присвоить сделке код UTI или воспользоваться сервисом формирования кода Информирующим лицом («Отправителем») в Web-кабинете репозитария. Алгоритм формирования в Web-кабинете соответствует Приложению 8 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У. В качестве префикса используется код LEI Информирющего лица (20 символов), остальные символы (формируются по алгоритму GUID) – код сделки, состоящий из 32 символов. При двустороннем внесении сведений стороны должны договориться, какое из Информирующих лиц будет Формирующим UTI лицом. В соответствии с этим черновик сообщения со сформированным в Web-кабинете кодом UTI будет направлен Информирующему лицу контрагента, который попадет в специальную папку. Далее Информирующее лицо контрагента принимает решение об использовании черновика для формирования своего сообщения в репозитарий либо об использовании информации о коде UTI из черновика для формирования собственного сообщения.

<tradeId>	Не допускается изменение значения данного параметра в сообщении о внесении изменений в зарегистрированную Анкету договора.		4104-У
-----------	--	--	--------

20. Место заключения сделки

Заполняется в Анкете договора

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Место заключения сделки <executionVenueType>	Площадка, на которой заключен договор. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент</i>	afr	Значение из справочника <u>http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/execution-venue-type(nsdru)</u>

21. Дата совершения отчитываемого события

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата совершения отчитываемого события <asOfDate>	<p>Дата совершения отчитываемого события, предназначенная для оценки соблюдения стороной сроков предоставления отчетности в репозиторий.</p> <ul style="list-style-type: none"> При первичной регистрации Анкеты договора и Анкеты генерального соглашения: дата заключения договора (<tradeDate>). При направлении сообщения об изменении условий зарегистрированной Анкеты: дата согласования (подписания) изменений (дополнительных соглашений) (<agreementDate>). При направлении сообщения о внесении корректирующих записей в отношении зарегистрированной Анкеты: дата обнаружения ошибки или дата направления сообщения в Репозиторий. В случае уступки права требования третьей стороне: дата уступки. При предоставлении Отчетов СМ092 и СМ094 в течение пяти рабочих дней после окончания отчетного месяца (в этом случае отчет может содержать несколько значений <valuationDate>) рекомендуется указывать последний рабочий день отчетного месяца.⁷ При предоставлении Отчета СМ092 по мере возникновения требований/обязательств по выплате маржевых сумм (в этом случае предполагается, что отчет содержит одно значение <valuationDate>) указывается дата расчета маржевой суммы (<valuationDate>). При предоставлении Отчета СМ094 по мере переоценки стоимости указывается дата 	mfr	ГГГГ-ММ-ДД Например, 2015-12-31

⁷ Если в Отчетах СМ092 и СМ094 содержится одно значение <valuationDate>, допускается использовать его в качестве значения элемента <asOfDate>. Отчеты СМ092 и СМ094 могут содержать сведения о договорах, обязательства по которым были прекращены в отчетном месяце.

	оценки (<valuationDate>).		
	<ul style="list-style-type: none"> В Анкете о состоянии обязательств по договорам СМ093 указывается дата события (например, дата прекращения обязательств по договору; если исполнение обязательств по договору просрочено, указывается дата просрочки, т. е. плановая дата прекращения обязательств по договору). 		

22. Дата заключения сделки

Заполняется в Анкете договора и Анкете генерального соглашения

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата заключения сделки <tradeDate>	Дата заключения договора/Генерального соглашения. При регистрации изменений к Анкете – первоначальная дата заключения договора/Генерального соглашения	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

23. Номер сообщения

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Номер сообщения <messageId>	Произвольный уникальный идентификатор, присвоенный сообщению. В Web-кабинете генерируется автоматически	nfr	Цифры и буквы латинского алфавита

24. Уникальный код цепочки сообщений

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Уникальный код цепочки сообщений <correlationId>	Идентификатор, используемый для связи нескольких сообщений между собой для обозначения принадлежности сообщений одному бизнес процессу. В сообщении на первичную регистрацию Анкеты этот идентификатор указывается в первый раз, а затем в любом последующем сообщении, связанном с исходным сообщением, в т. ч. являющемся ответом на него (СМ001, СМ002, СМ003, RM001 и т.д.), задается тем же значением. В Web-кабинете генерируется автоматически при отправке сообщения	nfr	[Репозитарный код отправителя]-[Год]-[Номер сообщения]

25. Исх. № Анкеты связанного документа

Заполняется в Анкете договора

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Исх. № Анкеты связанного документа <parentCorrelationId>	Если Анкета договора направляется на регистрацию одновременно с Анкетой Генерального соглашения, в рамках которого заключен договор (Анкета генерального соглашения не зарегистрирована и не имеет номера, присвоенного Репозитарием), указывается значение <correlationId> Анкеты генерального соглашения. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент</i>	nfr	Цифры и буквы латинского алфавита

II. Особые параметры сделки

Заполняется в Анкете договора

1. Код брокера

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Код брокера <reportingBrokerID>	Если сделка заключена при посредничестве брокера и брокер не является стороной сделки, указывается международный код идентификации юридического лица (LEI) – брокера. Если не применимо, не заполняется	mfr	Например, LEI_253400M18U5TB02TW421

2. Обязанность централизованного клиринга

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Обязанность централизованного клиринга <Cleared>	Обязанность централизованного клиринга. “Y” – договор подлежит обязательному централизованному клирингу “N” – договор не подлежит обязательному централизованному клирингу	mfr	Y; N

3. Выбор типа клиринга

3.1 Вариант выбора «CS – расчёты по результатам простого клиринга»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Код клиринговой организации <clearingOrganizationCode>	Код LEI клиринговой организации. Заполняется, если тип расчетов определен как “CS” (расчет по результатам клиринга без участия центрального контрагента – например, расчеты DVP в НРД)	mfr	Например, LEI_253400M18U5TB02TW421
Дата включения обязательств из договора в клиринговый пул <clearedDate>	Дата включения обязательств из договора в клиринговый пул	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Дата и время клиринга <clearingDateTime>	Дата и время клиринга обязательств из договора. Если не применимо, не заполняется	mfr	ГГГГ-ММ-ДДТЧЧ:ММ:СС

3.2 Вариант выбора «ССР – расчёты по результатам централизованного клиринга»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Код центрального контрагента <clearingCentralCounterpartyCode>	Код LEI центрального контрагента. Заполняется, если тип расчётов определен как “ССР” (расчет по результатам клиринга с участием центрального контрагента – например, НКЦ)	mfr	Например, LEI_2534007UK6G30KDX1A47
Код участника клиринга <clearingMemberID>	Код LEI участника клиринга. Указывается одна из сторон договора по согласованию сторон	mfr	Например, LEI_253400M18U5TB02TW421

Дата включения обязательств из договора в клиринговый пул <clearedDate>	Дата включения обязательств из договора в клиринговый пул (как правило, равна дате заключения сделки)	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Дата и время клиринга <clearingDateTime>	Дата и время клиринга обязательств из договора. Если не применимо, не заполняется	mfr	ГГГГ-ММ-ДДТЧЧ:ММ:СС

4. Условия согласования параметров сделки (договора)

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Условия согласования параметров сделки (договора) <reconciliationType>	Условия проведения сверки полей по договору. “FULL” – сверка проводится по всем полям, содержащимся в сообщении, т.е. всем заполненным (как обязательным, так и опциональным) полям обязательной сверки, полям специальной сверки и полям дополнительной сверки. “GENF” – сверка проводится по основным полям, т.е. заполненным (как обязательным, так и опциональным) полям обязательной сверки и полям специальной сверки. Поля с признаком дополнительной сверки не сверяются.	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleReconciliationType

Признак **обязательной сверки** (mfr – mandatory field reconciliation) определяет элементы, обязательные и необязательные для заполнения, значения которых во встречных сообщениях при двусторонней регистрации должны совпадать. Заполненные поля в сообщении одной стороны и незаполненные поля во встречном сообщении второй стороны признаются несовпадающими. Незаполненные (необязательные для заполнения) элементы во встречных сообщениях признаются совпадающими.

Признак **специальной сверки** (sfr – special field reconciliation) определяет элементы, обязательные для заполнения, расхождение в заполнении которых во встречных сообщениях приводит к отказу в регистрации. В случае если эти элементы заполнены только одной стороной (в сообщении другой стороны может быть указано значение “NONREF”), поля считаются сверенными, а их значения, заполненные одной стороной, вносятся в реестр как согласованные и достоверные.

Признак **дополнительной сверки** (afr – additional field reconciliation) определяет элементы, необязательные для заполнения и сверки. В случае заполнения и полного совпадения этих полей во встречных сообщениях, значения вносятся в реестр договоров. Если значения не совпадают во встречных сообщениях, они не вносятся в Реестр договоров (сообщение будет зарегистрировано без данных полей).

Несверяемые поля (nfr – no field reconciliation) – элементы, не участвующие в процессе сверки.

5. Тип расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Тип расчетов <clearSettlementType>	Код типа расчетов: “ОТС” – внеклиринговый расчет; “ССР” – расчет по результатам клиринга с участием центрального контрагента; “С” – расчет по результатам клиринга без участия центрального контрагента	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/clear-settlement-type(nsdrus)

6. Метод расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат
---------	----------	--------	--------

			заполнения
Метод расчетов <clearSettlementMethod>	Код метода расчетов: “Р” – поставочный; “С” – расчетный; “Е” – расчетно-поставочный, предполагающий выбор какой-либо стороной договора метода расчетов: поставочный или расчетный	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/clear-settlement-method(nsdрус)

7. Способ подтверждения сделки

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Способ подтверждения сделки <confirmationMethod>	Способ подтверждения Анкеты: “МХМЕ” - последовательное либо комбинированное подтверждение, “МАТН” - встречное подтверждение	sfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleMasterAgreementConfirmationEnum

8. Цель заключения договора

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Цель заключения договора <hedgeInfo>	<p>Значение определяет отношение договора к инструментам хеджирования у стороны договора.</p> <p>Отсутствие элемента для стороны договора в сообщении означает, что договор не относится к инструментам хеджирования и (или) не заключается в рамках операций хеджирования для стороны договора.</p> <p><i>Указывается с 01.04.2021 Информирующим лицом в отношении каждой стороны договора, за которую оно выполняет функции по отчетности в Репозиторий, или самостоятельно стороной договора (в рамках операции корректировки информации за свою сторону в реестре договоров).</i></p> <p>Допустимые значения:</p> <p>“Н1” – для Party1 договор относится к инструментам хеджирования и (или) заключается в рамках операций хеджирования;</p> <p>“Н2” – для Party2 договор относится к инструментам хеджирования и (или) заключается в рамках операций хеджирования;</p> <p>“Н3” – для каждой стороны (Party1 и Party2) договор относится к инструментам хеджирования и (или) заключается в рамках операций хеджирования (<i>Значения “Н3 применяется только для сообщений в Bulk-формате CM083-CM085).</i></p> <p><i>Значения “Н1”, “Н2”, “Н3” указываются для договора, являющегося производным</i></p>	sfr	Значение из справочника

	<p><i>финансовым инструментом (ПФИ).</i></p> <p><i>Сторона договора вправе самостоятельно направлять в Репозиторий сообщения по корректировке (добавлению) значения <hedgeInfo> (в отношении самой себя) по зарегистрированному в реестре договору, информация о котором ранее была предоставлена Информирующим лицом Стороны.</i></p>		
--	--	--	--

9. Автоматическое закрытие сделки в дату окончания срока действия договора

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<p>Автоматическое закрытие сделки в дату окончания срока действия договора</p> <p><automaticExecution></p>	<p>Значение “Y” определяет, что Анкета договора регистрируется Репозитарием автоматически после истечения трех рабочих дней от «Даты окончания срока действия договора» (<endAgreementDate>) со статусом “Т”. В таком случае Анкета о состоянии обязательств по договорам (СМ093) не предоставляется. Допускается только при <i>односторонней</i> регистрации Анкеты договора.</p> <p>Значение “N” указывается в случае внесения изменений в Анкету договора для деактивации данного функционала.</p> <p>Если поле не заполнено, сведения о состоянии (прекращении) обязательств по договору должны быть предоставлены в Анкете о состоянии обязательств по договорам (СМ093).</p> <p><i>Необязательный для заполнения элемент.</i></p>	mfr	Y; N

10. Признак связанности стороны 1 и стороны 2

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<p>Признак связанности стороны 1 и стороны 2</p> <p><partiesAreAffiliated></p>	<p>Определяет, являются ли Сторона 1 и Сторона 2 аффилированными в соответствии с Указанием Банка России от 16.08.2016 № 4104-У. Заполняется обязательно для договоров, заключенных вне рамок Генерального соглашения.</p> <p>Если профессиональный участник рынка ценных бумаг, действующий по договору комиссии, является одновременно покупателем и продавцом по сделке, указывается значение “N” (стороны не являются аффилированными). Если договор заключен на условиях Генерального соглашения, поле не заполняется.</p>	mfr	Y; N

11. Регуляторный тип сделки

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<p>Регуляторный тип сделки</p>	<p>Тип договора в соответствии со справочником. “Term” означает сделку с</p>	afr	Значение из справочника

<regulatoryStatus>	отсрочкой исполнения, которая в соответствии с регулированием и/или условиями договора не классифицируется как производный финансовый инструмент		http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/regulatory-status(nsdru)
--------------------	--	--	---

12. Дата начала срока действия договора

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата начала срока действия договора <startAgreementDate>	Дата, определенная сторонами как дата вступления в силу договора, если указанная дата не совпадает с датой заключения договора. Если не применимо, не заполняется	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

13. Дата окончания срока действия договора

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата окончания срока действия договора <endAgreementDate>	Дата исполнения (прекращения) обязательств по договору. В случае если договором предусмотрено продление срока его действия в результате наступления соответствующего обстоятельства или события, этот срок не учитывается при указании даты окончания срока действия договора	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

14. Коды классификации финансовых инструментов

Коды производных финансовых инструментов, определяемые в соответствии с Указанием Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

14.1 Общие коды классификации для продукта

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Тип кода <productGeneralCodes> <specificCode>	Фиксированное значение: “ProductRelation” (код взаимосвязи). Заполняется обязательно	sfr	Фиксированное значение: ProductRelation
Код <productGeneralCodes> <Code>	Значение кода взаимосвязи в соответствии с Приложением 6 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У. Заполняется обязательно. Если производный финансовый инструмент не является частью иного производного финансового инструмента и не является базисным активом производного финансового инструмента, то такому договору присваивается код “S”	sfr	Символьная строка

14.2 Коды классификации для части (потока) продукта

Дополнительные коды для своп-договоров (за исключением кредитного свопа), определяемые в соответствии с Указанием Банка России от 16.08.2016 № 4104-У. Для каждой части свопа может быть указано несколько кодов (повторяемый блок).

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор части продукта <productLegSpecificCodes> <legId>	Идентификатор части («ноги») свопа, в отношении которой определяется код	sfr	Символьная строка. Например, “leg1”, “leg2”

Тип кода <productLegSpecificCodes> <specificCode>	“FixedRateChange” – код амортизации или повышения фиксированной процентной ставки “NotionalChange” – код амортизации или повышения номинальной суммы “UnderlierValuation” – код периодичности переоценки “PaymentFrequency” – код периодичности платежей	sfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleNsdSpecificCodesEnum
Код <productLegSpecificCodes> <Code>	Значение кода в соответствии с Приложениями 4 и 5 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У	sfr	Символьная строка

15. Информация о клиенте стороны

Сведения о клиентах сторон по договору предоставляются в соответствии с требованиями Указания Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

При односторонней регистрации договора данный блок должен быть включен в сообщение дважды, т. е. в отношении Стороны 1 и Стороны 2 («за себя и контрагента»). При двусторонней регистрации договора допускается заполнение блока только в отношении Стороны, от имени которой направляется сообщение («за себя»), при этом информация «за контрагента» должна присутствовать во встречном сообщении, направляемом от имени контрагента, или должна быть дополнена в случае последовательного способа подтверждения анкет.⁸

15.1 Сторона, обслуживающая клиента

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона, обслуживающая клиента <servicingParty>	Сторона, о которой (клиенте которой) предоставляется информация	sfr	Party 1; Party 2

15.2 Выбор типа клиента стороны

Вариант выбора «Договор заключен не в интересах клиента»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Договор заключен не в интересах клиента <ownTrade>	Указывает, что договор заключен не в интересах клиента	sfr	Фиксированное значение: “true”

Вариант выбора «Договор заключен в интересах клиента»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Тип клиента <type>	Тип клиента, в интересах которого заключен договор “F” – клиент является профучастником рынка ценных бумаг, кредитной организацией,	sfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleNsdSpecificCodesEnum

⁸ В случае двустороннего внесения сведений с комбинированным способом подтверждения заполненная информация о клиенте стороны <clientDetails> не доступна контрагенту или его информирующему лицу. После получения сообщения с заполненным блоком <clientDetails> за первую сторону Репозиторий удаляет данный блок в Запросе на согласование (RM005), направляемом контрагенту (его Информирющему лицу). После получения Подтверждения параметров Анкеты (CM001) от контрагента в итоговую анкету в реестре заносятся два блока <clientDetails> (за Сторону 1 и Сторону 2). В Выписке из реестра договоров (RM004) и в интерфейсе Web-кабинета Репозитория информация о клиенте контрагента также не раскрывается.

	страховой организацией, управляющей компанией, негосударственным пенсионным фондом или иной организацией, основным видом деятельности которой являются операции с ценными бумагами и иностранной валютой и/или заключение договоров, являющихся производными финансовыми инструментами и/или предоставление займов “L” – клиент является иным юридическим лицом “P” – клиент является физическим лицом		t/reference/types/simpleClientType
Идентификатор клиента <id>	Идентификатор клиента в соответствии с форматом заполнения. Применимы следующие типы кодов: в отношении резидентов РФ – "LEI" или "INN" (ИНН) для юридических лиц, "SNILS" (СНИЛС) или "PASS" (серия и номер паспорта) для физических лиц; в отношении иностранных лиц – "LEI", "SWIFT", "BLOOM" (код Bloomberg), "THRTR" (код Thomson Reuters), "OWN" (иной код)	sfr	Формат заполнения: "тип кода" "нижнее подчёркивание" "код". Например, SNILS_XXX-XXX-XXX XX; INN_XXXXXXXX XX
Наименование клиента <name>	Полное наименование юридического лица либо фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на русском или английском языке	sfr	Символьная строка
Код страны клиента <country>	Код страны регистрации юридического лица или гражданства физического лица	sfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso3166(fpmlrus)

Вариант выбора «Нет сведений в чьих интересах заключен договор»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Нет сведений в чьих интересах заключен договор <noInformation>	Фиксированное значение: “true”. Допустимо только в случае односторонней регистрации Анкеты договора при заполнении сведений о контрагенте, указанном в поле <servicingParty>, при условии, что этот контрагент не является клиентом Репозитория либо предоставил отказ от предоставления сведений в Репозиторий	sfr	Фиксированное значение: “true”.

III. Обеспечение по сделке

Заполняется в Анкете договора. Указываются общие параметры договора о порядке уплаты плавающих сумм, в соответствии с которым заключена сделка. Под договором о порядке уплаты плавающих маржевых сумм подразумевается договор, заключенный в соответствии со Стандартными условиями договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм (2011 г.), разработанными и утвержденными Национальной ассоциацией участников фондового рынка, Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков. В случае если такой договор не заключен или заключен иной договор об обеспечении исполнения обязательств, в качестве значения элементов «Тип обеспечения по договору» и «Форма обеспечения» указывается “U” – договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм не заключен.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Тип обеспечения по договору <marginType>	<p>Тип обеспечения (маржинальных требований) согласно договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм.</p> <p>“FC” – полное обеспечение (используется одновременно первоначальная и плавающая маржевая сумма).</p> <p>“PC” – частичное обеспечение (используется только плавающая маржевая сумма).</p> <p>“OC” – одностороннее обеспечение (первоначальная и (или) плавающая маржевая сумма вносится только одной стороной).</p> <p>“U” – договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм не заключен.</p>	mfr	<p>Значение из справочника:</p> <p>http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleMarginType</p>
Форма обеспечения <collateralForm>	<p>Форма обеспечения согласно договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм.</p> <p>“Т” – обязательства по данному договору обеспечиваются индивидуально.</p> <p>“G” – обязательства по данному договору обеспечиваются совокупно с обязательствами по иным заключенным договорам в составе портфеля (кумулятивное обеспечение) – например, в рамках одного Генерального соглашения.</p> <p>“U” – договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм не заключен.</p>	mfr	<p>Значение из справочника:</p> <p>http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleCollateralForm</p>
Дата включения договора в портфель <dateTradeIncludedIntoPortfolio>	<p>Дата включения договора в портфель договоров. <i>Если не применимо, не заполняется.</i></p>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Дата исключения договора из портфеля <country>	<p>Дата исключения договора из портфеля договоров. <i>Если не применимо, не заполняется.</i></p>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

IV. Экономические параметры сделки.

Рекомендации по заполнению экономических параметров сделок, сведения о которых предоставляется в репозиторий.⁹

1. Анкета валютного свопа (CM021)

1.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником "ProductType": [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdru\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdru)). Допустимые значения:

Значение	Описание
ForeignExchange:FXSwap	Сделка валютный своп поставочный (ПФИ)
ForeignExchange:FXSwap:NonDerivative	Сделка валютный своп поставочный (не ПФИ)
ForeignExchange:FXSwap:Cash	Сделка валютный своп расчетный (ПФИ)

Договор, предусматривающий обязанность одной стороны передать валюту в собственность другой стороне и обязанность другой стороны принять и оплатить валюту, а также обязанность другой стороны передать валюту в собственность первой стороне и обязанность первой стороны принять и оплатить валюту, при этом такой договор не предусматривает иных обязанностей сторон по уплате или передаче валюты (денежных средств) и в нем нет указания на то, что такой договор является производным финансовым инструментом, классифицируется как «сделка валютный своп поставочный (не ПФИ)».

1.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У. Для поставочных валютных свопов, которые не признаются ПФИ, используется значение "UKWN".

1.3 Первоначальный платеж по валютному свопу

1.3.1 Валюта 1

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона 1, осуществляющая первоначальный платеж в Валюте 1	mfr	Party1
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона 2, получающая первоначальный платеж в Валюте 1	mfr	Party2
Валюта суммы <paymentAmount> <currency>	Валюта 1. Определяется как валюта, уплачиваемая по первой части договора Стороной 1	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <paymentAmount> <amount>	Сумма первоначального платежа в Валюте 1	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000

1.3.2 Валюта 2

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона 2, осуществляющая первоначальный платеж в Валюте 2	mfr	Party2

⁹ Для описания экономических параметров производных финансовых инструментов используется терминология Стандартной документации для срочных сделок на финансовых рынках 2011 г., разработанной и утвержденной НАУФОР, НБА и АРБ (ISDA), а также документации Международной ассоциации свопов и деривативов (2002 ISDA Master Agreement, 2006 ISDA Definitions, ISDA Credit Derivatives Definitions).

Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона 1, получающая первоначальный платеж в Валюте 2	mfr	Party1
Валюта суммы <paymentAmount> <currency>	Валюта 2. Определяется как валюта, уплачиваемая по первой части договора Стороной 2	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <paymentAmount> <amount>	Сумма первоначального платежа в Валюте 2	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000

1.3.3 Торгуемая валюта

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Торгуемая валюта <dealtCurrency>	Валюта – базовый актив, в которой платеж по первой и второй частям договора осуществляется в одинаковой сумме (поставляемый актив). Указывается Валюта 1 (ExchangedCurrency1) или Валюта 2 (ExchangedCurrency2), как они определены в пп. 1.3.1 и 1.3.2	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleDealtCurrencyEnum

1.3.4 Дата валютирования

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата валютирования <valueDate>	Дата первоначального платежа, в которую расчеты в Валюте 1 и Валюте 2 по первой части договора будут завершены	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

1.3.5 Обменный курс

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта 1 <currency1>	Валюта 1, как она определена в п. 1.3.1	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Валюта 2 <currency2>	Валюта 2, как она определена в п. 1.3.2	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleQuoteBasisEnum
Базис котировки <quoteBasis>	Базис котировки валютного курса, определенный как “Currency1PerCurrency2” или “Currency2PerCurrency1”	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleQuoteBasisEnum
Обменный курс <rate>	Валютный курс (цена) первой части сделки своп, соответствующий базису котировки. Указывается за единицу валюты – базового актива (п. 1.3.3), если иное не определено условиями договора	mfr	Положительное десятичное число. Например, 50.1234567

1.3.6 Беспоставочное исполнение

Необязательный для заполнения блок, определяющий расчетный (беспоставочный) метод исполнения.

1.3.6.1 Валюта расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
---------	----------	--------	-------------------

Валюта расчетов <settlementCurrency>	Валюта расчетов по беспоставочному договору. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
--	---	-----	--

1.3.6.2 Фиксинг

Не используется.

1.4 Окончательный платеж по валютному свопу

1.4.1 Валюта 1

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-платательщик <payerPartyReference>	Сторона 2, осуществляющая окончательный платеж в Валюте 1	mfr	Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона 1, получающая окончательный платеж в Валюте 1		Party1
Валюта суммы <paymentAmount> <currency>	Валюта 1. Определяется как валюта, уплачиваемая Стороной 1 по первой части договора	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <paymentAmount> <amount>	Сумма окончательного платежа в Валюте 1	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000

1.4.2 Валюта 2

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-платательщик <payerPartyReference>	Сторона 1, осуществляющая окончательный платеж в Валюте 2	mfr	Party1
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона 2, получающая окончательный платеж в Валюте 2	mfr	Party2
Валюта суммы <paymentAmount> <currency>	Валюта 2. Определяется как валюта, уплачиваемая по первой части договора Стороной 2	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <paymentAmount> <amount>	Сумма окончательного платежа в Валюте 2	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000

1.4.3 Торгуемая валюта

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Торгуемая валюта <dealtCurrency>	Валюта – базовый актив, в которой платеж по первой и второй частям договора осуществляется в одинаковой сумме (поставляемый актив). Указывается Валюта 1 (ExchangedCurrency1) или	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleDealt

	Валюта 2 (ExchangedCurrency2), как они определены в пп. 1.3.1 и 1.3.2		<u>CurrencyEnum</u>
--	---	--	---------------------

1.4.4 Дата валютирования

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата валютирования <valueDate>	Дата окончательного платежа, в которую расчеты в Валюте 1 и Валюте 2 по второй части договора будут завершены	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

1.4.5 Обменный курс

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта 1 <currency1>	Валюта 1, как она определена в п. 1.3.1	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Валюта 2 <currency2>	Валюта 2, как она определена в п. 1.3.2	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleQuoteBasisEnum
Базис котировки <quoteBasis>	Базис котировки валютного курса, определенный как “Currency1PerCurrency2” или “Currency2PerCurrency1”	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleQuoteBasisEnum
Обменный курс <rate>	Валютный курс второй части сделки своп, соответствующий базису котировки. Указывается за единицу валюты – базового актива (п. 1.3.3), если иное не определено условиями договора	mfr	Положительное десятичное число. Например, 50.1234567

1.4.6 Беспоставочное исполнение

Необязательный для заполнения блок, определяющий расчетный (беспоставочный) метод исполнения. Заполняется аналогично п. 1.3.6.

2. Анкета конверсионной сделки (валютного форварда) (CM022)

2.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником “ProductType”: [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdru\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdru)). Допустимые значения:

Значение	Описание
ForeignExchange:Forward	Форвард валютный поставочный (ПФИ)
ForeignExchange:NDF	Форвард валютный расчетный (ПФИ)
ForeignExchange:Term	Конверсионная сделка с отсрочкой исполнения (не ПФИ)
ForeignExchange:Spot	Конверсионная сделка спот (не ПФИ)

Конверсионные сделки спот (не ПФИ) не являются обязательными для отчетности в репозиторий (см. п.1 Указания Банка России от 16.08.2016 № 4104-У). Информация о таких сделках может предоставляться в репозиторий по желанию сторон.

2.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

2.3 Валюта 1

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
---------	----------	--------	-------------------

Сторона-платательщик <payerPartyReference>	Сторона 1, осуществляющая платеж в Валюте 1	mfr	Party1
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона 2, получающая платеж в Валюте 1	mfr	Party2
Валюта суммы <paymentAmount> <currency>	Валюта 1. Определяется как валюта, уплачиваемая Стороной 1	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <paymentAmount> <amount>	Номинальная сумма в Валюте 1	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000

2.4 Валюта 2

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-платательщик <payerPartyReference>	Сторона 2, осуществляющая платеж в Валюте 2	mfr	Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона 1, получающая платеж в Валюте 2	mfr	Party1
Валюта суммы <paymentAmount> <currency>	Валюта 2. Определяется как валюта, уплачиваемая Стороной 2	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <paymentAmount> <amount>	Номинальная сумма в Валюте 2	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000

2.5 Торгуемая валюта

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Торгуемая валюта <dealtCurrency>	Валюта - базовый актив, по отношению к единице (или иному числу, кратному десяти) которой устанавливается валютный курс. Указывается Валюта 1 (ExchangedCurrency1) или Валюта 2 (ExchangedCurrency2), как они определены в пп. 2.3 и 2.4.	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleDealtCurrencyEnum

2.6 Дата валютирования

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата валютирования <valueDate>	Дата платежа, в которую расчеты в Валюте 1 и Валюте 2 будут завершены	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

2.7 Обменный курс

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта 1 <currency1>	Валюта 1, как она определена в п. 2.3	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/

Валюта 2 <currency2>	Валюта 2, как она определена в п. 2.4	mfr	versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Базис котировки <quoteBasis>	Базис котировки валютного курса, определенный как “Currency1PerCurrency2” или “Currency2PerCurrency1”. Курс указывается за единицу валюты - базового актива (п. 2.5), если иное не определено условиями договора	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleQuoteBasisEnum
Обменный курс <rate>	Форвардный валютный курс, соответствующий базису котировки. Если форвардный курс не определен на дату предоставления информации о договоре в Репозиторий, указывается текущий рыночный курс. При этом не позднее трех рабочих дней с даты определения форвардного курса следует предоставить в Репозиторий информацию об изменении соответствующего договора	mfr	Положительное десятичное число. Например, 50.1234567

2.8 Беспоставочное исполнение

Необязательный для заполнения блок, определяющий расчетный (беспоставочный) метод исполнения.

2.8.1 Валюта расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта расчетов <settlementCurrency>	Валюта расчетов по беспоставочному договору. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

2.8.2 Фиксинг

Не используется.

3. Анкета валютного опциона (CM023)

3.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником “ProductType”: [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdus\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdus)). Допустимые значения:

Значение	Описание
ForeignExchange:VanillaOption:American	Опцион валютный поставочный американский
ForeignExchange:VanillaOption:Bermuda	Опцион валютный поставочный бермудский
ForeignExchange:VanillaOption:European	Опцион валютный поставочный европейский
ForeignExchange:CashOption:American	Опцион валютный расчетный американский
ForeignExchange:CashOption:Bermuda	Опцион валютный расчетный бермудский
ForeignExchange:NDO	Опцион валютный расчетный европейский
ForeignExchange:SimpleExotic:Asian	Опцион валютный азиатский
ForeignExchange:SimpleExotic:Barrier	Опцион валютный барьерный
ForeignExchange:SimpleExotic:BarrierAsian	Опцион валютный азиатский барьерный

3.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии

с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

3.3 Описание покупателя и продавца

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-покупатель инструмента <buyerPartyReference>	Сторона-покупатель опциона	mfr	Party1; Party2
Сторона-продавец инструмента <sellerPartyReference>	Сторона-продавец опциона	mfr	

3.4 Выбор стиля исполнения опциона

Вариант выбора «Американский/бермудский стиль исполнения опциона»

3.4.1 Начальная дата

Заполняется для американского и бермудского опционов.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Начальная дата <commencementDate> <unadjusted date>	Дата начала срока осуществления права на исполнение опциона. Если начальная дата явным образом не определена, указывается дата заключения сделки	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

3.4.2 Дата истечения.

Заполняется для американского и бермудского опционов.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата истечения <expiryDate>	Дата окончания срока осуществления права на исполнение опциона	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

3.4.3 Множественное исполнение

Не используется.

3.4.4 Даты исполнения бермудского опциона

Заполняется только для бермудского опциона.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Даты исполнения бермудского опциона <bermudaExerciseDate> <date>	Даты осуществления права на исполнение бермудского опциона (повторяемый элемент)	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

Вариант выбора «Европейский стиль исполнения опциона»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата истечения <expiryDate>	Дата исполнения европейского опциона	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

3.5 Сумма валюты на продажу

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <putCurrencyAmount> <currency>	Валюта на продажу. Определяется как валюта, которая должна быть продана покупателем	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

Сумма денежных средств <putCurrencyAmount> <amount>	Номинальная сумма в валюте на продажу	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000
--	---------------------------------------	-----	---

3.6 Сумма валюты на покупку

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <callCurrencyAmount> - <currency>	Валюта на покупку. Определяется как валюта, которая должна быть куплена покупателем	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <callCurrencyAmount> <amount>	Номинальная сумма в валюте на покупку	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000

3.7 Оговоренный тип опциона

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Оговоренный тип опциона <soldAs>	Тип опциона в соответствии с условиями договора: “Put” или “Call”	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePutCallEnum

3.8 Цена исполнения

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Обменный курс <rate>	Цена исполнения опциона, соответствующая базису котировки. Определяется как согласованный сторонами курс, по которому валютная пара будет обменена при осуществлении права на исполнение	mfr	Положительное десятичное число. Например, 50.1234567
Базис котировки <strikeQuoteBasis>	Базис котировки цены исполнения опциона: “PutCurrencyPerCallCurrency” (количество единиц валюты пут за единицу валюты колл) или “CallCurrencyPerPutCurrency” (количество единиц валюты колл за единицу валюты пут)	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleStrikeQuoteBasisEnum

3.9 Дополнительные параметры

Параметры азиатского и/или барьерного опциона. Заполняется обязательно, если соответствующие параметры определены в условиях сделки.

Вариант выбора «Условия азиатского и барьерного опциона»

3.9.1 Условия азиатского опциона

3.9.1.1 Первичный источник данных для валютного курса

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Источник данных <rateSource>	Информационный источник, публикующий спот-курс, среднее значение которого используется для определения цены исполнения азиатского опциона. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/information-provider(nsdruis)

3.9.1.2 График наблюдений

Для азиатского опциона указывается период, за который определяется средняя цена базисного актива опциона (если условиями азиатского опциона предусмотрены дискретные даты, за которые определяется средняя цена, указываются первая и последняя даты).

Элемент		Описание	Сверка	Формат заполнения
Начало периода наблюдения <observationSchedule> <startDate>		Дата начала периода, за который определяется среднее значение спот-курса	mfr	ГГТТ-ММ-ДД
Окончание периода наблюдения <observationSchedule> <endDate>		Дата окончания периода, за который определяется среднее значение спот-курса	mfr	
Периодичность расчетного периода <calculationPeriodFrequency>	Мультипликатор периода <periodMultiplier>	Мультипликатор периода времени	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
	Период времени <period>	Тип периода времени, за который определяется среднее значение спот-курса	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versions/current/reference/types/simplePeriodExtendedEnum

3.9.2 Условия барьерного опциона

Параметры азиатского опциона с барьерным условием. Для «двойных» условий (double knock-out, double knock-in) блок заполняется дважды.

Элемент		Описание	Сверка	Формат заполнения
Тип барьерного условия <barrierType>		Тип барьерного условия. В случае отлагательного условия (knock-in) опцион начинает действовать при достижении барьера, в случае отменительного условия (knock-out) – прекращает действовать при достижении барьера	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versions/current/reference/types/simpleFxBarrierTypeEnum
Валюта 1 <quotedCurrencyPair> <currency1>		Валюта на покупку как она определена в п. 3.6	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versions/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Валюта 2 <quotedCurrencyPair> <currency1>		Валюта на продажу как она определена в п. 3.5	mfr	
Базис котировки <quoteBasis>		Базис котировки валютного курса, определенный как “Currency1PerCurrency2” или “Currency2PerCurrency1”	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versions/current/reference/types/simpleQuoteBasisEnum
Триггерный курс <triggerRate>		Значение валютного курса, при достижении которого применяется барьерное условие	mfr	Положительное десятичное число. Например, 50.1234567
Источник данных <rateSource>		Информационный источник, публикующий значение спот-курса. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versions/current/taxonomy/information-provider(nsdruis)
Дата начала периода		Дата начала периода, в течение которого проводится наблюдение за	afr	ГГТТ-ММ-ДД

наблюдения <observationStartDate>	выполнением барьерного условия. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>		
Дата окончания периода наблюдения <observationEndDate>	Дата окончания периода, в течение которого проводится наблюдение за выполнением барьерного условия. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	

Вариант выбора «Условия барьерного опциона»

Параметры валютного опциона с барьерным условием. Заполняется аналогично п. 3.9.2.

3.10 Премия опциона

3.10.1 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона-покупатель опциона	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-продавец опциона	mfr	

3.10.2 Сумма платежа

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <paymentAmount> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма премии	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <paymentAmount> <amount>	Совокупная сумма премии по договору	mfr	Положительное десятичное число. Например, 100

3.11 Денежные расчеты

Необязательный для заполнения блок, определяющий расчетный (беспоставочный) метод исполнения.

3.11.1 Валюта расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта расчетов <settlementCurrency>	Валюта расчетов по беспоставочному договору <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

3.11.2 Фиксинг

Не используется.

4. Анкета бинарного валютного опциона (CM024)

4.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником “ProductType”: [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsd rus\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsd rus)). Допустимые значения:

Значение	Описание
ForeignExchange:SimpleExotic:Digital:American	Опцион валютный бинарный американский

ForeignExchange:SimpleExotic:Digital:Bermuda	Опцион валютный бинарный бермудский
ForeignExchange:SimpleExotic:Digital:European	Опцион валютный бинарный европейский

4.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

4.3 Описание покупателя и продавца

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-покупатель инструмента <buyerPartyReference>	Сторона-покупатель опциона	mfr	Party1; Party2
Сторона-продавец инструмента <sellerPartyReference>	Сторона-продавец опциона	mfr	

4.4 Выбор стиля исполнения опциона

Вариант выбора «Американский/бермудский стиль исполнения опциона»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Начальная дата <commencementDate> <unadjusted date>	Дата начала срока осуществления права на исполнение опциона. Если начальная дата явным образом не определена, указывается дата заключения сделки	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Дата истечения <expiryDate>	Дата окончания срока осуществления права на исполнение опциона	mfr	
Даты исполнения бермудского опциона <bermudaExerciseDates – date>	Даты осуществления права на исполнение бермудского опциона (повторяемый элемент)	mfr	
Условие касания <touchCondition>	Условие, при котором совершается выплата по бинарному опциону: если спот-курс достигает (Touch) или не достигает (Notouch) порогового уровня в течение срока действия договора. Для «двойных» условий (double one-touch, double no-touch) данный блок заполняется дважды	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleTouchConditionEnum
Валюта 1 <quotedCurrencyPair> <currency1>	Первая валюта, указываемая при оценке курса для валютной пары	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Валюта 2 <quotedCurrencyPair> <currency1>	Вторая валюта, указываемая при оценке курса для валютной пары	mfr	
Базис котировки <quoteBasis>	Базис котировки валютного курса, определенный как “Currency1PerCurrency2” или “Currency2PerCurrency1”	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleQuoteBasisEnum
Триггерный курс <triggerRate>	Значение (пороговый уровень) валютного курса, относительно которого определяется, будет ли осуществлена выплата по опциону	mfr	Положительное десятичное число. Например, 50.1234567

Курс спот <spotRate>	Текущее значение спот-курса. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Положительное десятичное число. Например, 50.1234567
Источник данных <rateSource>	Информационный источник, публикующий значение спот-курса. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/information-provider(nsdru)
Дата начала периода наблюдения <observationStartDate>	Дата начала периода, в течение которого проводится наблюдение за выполнением условия касания. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Дата окончания периода наблюдения <observationEndDate>	Дата окончания периода, в течение которого проводится наблюдение за выполнением условия касания. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	

Вариант выбора «Европейский стиль исполнения опциона»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата истечения <expiryDate>	Дата исполнения европейского опциона	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Триггерное условие <triggerCondition>	Условие, при котором совершается выплата по бинарному опциону: если спот-курс выше или равен (Above) либо ниже или равен (Below) пороговому уровню	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleTriggerConditionEnum
Валюта 1 <quotedCurrencyPair> <currency1>	Первая валюта, указываемая при оценке курса для валютной пары	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Валюта 2 <quotedCurrencyPair> <currency1>	Вторая валюта, указываемая при оценке курса для валютной пары	mfr	
Базис котировки <quoteBasis>	Базис котировки валютного курса, определенный как “Currency1PerCurrency2” или “Currency2PerCurrency1”	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleQuoteBasisEnum
Триггерный курс <triggerRate>	Значение (пороговый уровень) валютного курса, относительно которого определяется, будет ли осуществлена выплата по опциону	mfr	Положительное десятичное число. Например, 50.1234567
Курс спот <spotRate>	Текущее значение спот-курса. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Положительное десятичное число. Например, 50.1234567
Источник данных <rateSource>	Информационный источник, публикующий значение спот-курса. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/information-provider(nsdru)

	<i>элемент.</i>		nomy/information-provider(nsdrus)
--	-----------------	--	--

4.5 Выплата по опциону

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <payout> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма платежа по бинарному опциону	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <payout> <amount>	Сумма платежа по бинарному опциону	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000
Стиль выплаты по опциону <payoutStyle>	Условие выплаты по опциону: при наступлении триггерного события (Immediate) либо позже – например, в дату истечения опциона (Deferred). <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePaymentEnum

4.6 Премия опциона

4.6.1 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона-покупатель опциона	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-продавец опциона	mfr	

4.6.2 Сумма платежа

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <paymentAmount> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма премии	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <paymentAmount> <amount>	Совокупная сумма премии по договору	mfr	Положительное десятичное число. Например, 100

5. Анкета соглашения о будущей процентной ставке (CM031)

5.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником “ProductType”:
[http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdrus\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdrus)).

Значение	Описание
InterestRate:FRA	Соглашение о будущей процентной ставке

5.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии

с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

5.3 Описание покупателя и продавца

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-покупатель инструмента <buyerPartyReference>	Сторона-покупатель по договору. Если покупатель не определен в условиях сделки, указывается Сторона-плательщик фиксированной ставки.	mfr	Party1; Party2
Сторона-продавец инструмента <sellerPartyReference>	Сторона-продавец по договору. Если продавец не определен в условиях сделки, указывается Сторона-плательщик плавающей ставки.	mfr	

5.4 Дата начала срока

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата начала срока <adjustedEffectiveDate>	Дата начала срока договора (расчетного периода)	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

5.5 Дата истечения срока

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата истечения срока <adjustedTerminationDate>	Дата истечения срока договора (окончания расчетного периода)	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

5.6 Дата платежа по договору

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата платежа <paymentDate> <unadjustedDate>	Дата расчетов по договору	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

5.7 Коэффициент для расчета дней в процентном периоде

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Коэффициент для расчета дней в процентном периоде <dayCountFraction>	Коэффициент для расчета дней в процентном периоде. Для указания количества дней в процентном периоде, характеризующем отношение фактического количества дней в процентном периоде к фактическому количеству дней в году, используется значение "ACT/ACT.ISDA"	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/day-count-fraction(fpmlrus)

5.8 Номинальная сумма

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <currency>	Валюта номинальной суммы	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-

			2001-08-15(fpmlrus)
Номинальная сумма <notional>	Номинальная сумма по договору	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000

5.9 Фиксированная ставка

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Фиксированная ставка <fixedRate>	Значение фиксированной ставки	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05.

5.10 Плавающая ставка

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Индекс плавающей ставки <floatingRateIndex>	Индекс плавающей ставки. Если значение индекса отсутствует в справочнике, указывается «Прочее» (Other)	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/floating-rate-index(nsdrus)

5.11 Период плавающей ставки

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Мультипликатор периода <indexTenor> <periodMultiplier>	Мультипликатор, определяющий период плавающей ставки	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
Тип временного периода <indexTenor> <period>	Тип периода плавающей ставки	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodExtendedEnum

5.12 Дисконтирование

Не используется.

6. Анкета процентного свопа (CM032)

6.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником “ProductType”: [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdrus\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdrus)). Допустимые значения:

Значение	Описание
InterestRate:IRSwap:FixedFloat	Процентный своп с фиксированной и плавающей ставками
InterestRate:IRSwap:FixedFixed	Процентный своп с фиксированными ставками
InterestRate:IRSwap:Basis	Базисный процентный своп
InterestRate:IRSwap:OIS	Своп на индекс ставок овернайт
InterestRate:CrossCurrency:Basis	Базисный процентно-валютный своп
InterestRate:CrossCurrency:FixedFloat	Процентно-валютный своп с фиксированной и плавающей ставками
InterestRate:CrossCurrency:FixedFixed	Процентно-валютный своп с фиксированными ставками

6.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

6.3 Платежи по свопу

Параметры платежей по процентному свопу (повторяемый блок). Для целей отчетности в Репозиторий первыми указываются обязательства Стороны 1, вторыми – обязательства Стороны 2. Например, первыми определяются платежи Стороны 1, привязанные к плавающей ставке, вторыми – платежи Стороны 2, привязанные к фиксированной ставке.

6.3.1 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона, осуществляющая платеж по данной части свопа (в соответствии с выбранным порядком указания платежей)	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона, получающая платеж по данной части свопа (в соответствии с выбранным порядком указания платежей)	mfr	

6.3.2 Расчетные (процентные) периоды

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата начала срока <effectiveDate> <unadjustedDate>	Дата начала срока договора (первого процентного периода)	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Дата истечения срока <terminationDate> <unadjustedDate>	Дата окончания срока по договору	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Дата начала первого регулярного расчетного периода <firstRegularPeriodStartDate>	Дата начала первого полного процентного периода. Может указываться, если график содержит начальный неполный процентный период. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	ГГГГ-ММ-ДД
Дата окончания первого периода капитализации <firstCompoundingPeriodEndDate>	Дата окончания начального периода капитализации. Может указываться, если платеж осуществляется по итогам более чем однопроцентного периода. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	ГГГГ-ММ-ДД
Дата окончания последнего регулярного расчетного периода <lastRegularPeriodEndDate>	Дата окончания последнего полного расчетного периода. Может указываться, если график содержит окончательный неполный расчетный период. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	ГГГГ-ММ-ДД

6.3.3 Даты платежей/Периодичность платежей

Определение периодичности платежей по данной части процентного свопа. Если она совпадает с периодичностью процентных периодов, то платеж осуществляется по итогам каждого процентного периода. Если периодичность платежей менее частая, чем периодичность процентных периодов, то платеж совершается по итогам нескольких процентных периодов.

Например, значения мультипликатора «3» и периода времени «М» определяют, что платеж совершается каждые три месяца.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Мультипликатор периода <paymentDates> <periodMultiplier>	Мультипликатор периода времени	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
Период времени <paymentDates> <period>	Тип периода времени, соответствующий периодичности платежей по данной части свопа. “Т” означает, что платеж совершается один раз за весь срок действия договора	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodExtendedEnum
Дата первого платежа <firstPaymentDate>	Дата первого платежа. Может указываться при наличии неполного начального расчетного периода. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	ГГГГ-ММ-ДД
Дата последнего регулярного платежа <lastRegularPaymentDate>	Дата последнего регулярного платежа. Может указываться при наличии неполного последнего расчетного периода. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	

6.3.4 Даты изменения плавающей ставки / Периодичность изменения плавающей ставки

Не используется.

6.3.5 Сумма расчетного периода / Выбор суммы расчетного периода

Для определения номинальной суммы и процентной ставки по данной части свопа (в т. ч. процентно-валютного свопа) используется вариант выбора «Параметры расчета суммы».

В случае свопа с нулевым купоном (zero coupon swap) для описания фиксированной суммы используется вариант выбора «График известных сумм».

6.3.5.1 Вариант выбора «Параметры расчета суммы»

Параметры номинальной суммы и процентных ставок, к которым привязаны значения процентных платежей (фиксированных/плавающих сумм).

6.3.5.1.1 Выбор номинальной суммы

Для определения номинальной суммы в соответствующей валюте по данной части свопа заполняется вариант выбора «График номинальной суммы». Вариант выбора «График номинальной суммы, привязанной к валютному курсу» не используется.

Вариант выбора «График номинальной суммы» - График значений номинальной суммы.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Начальное значение <notionalSchedule> <initialValue>	Номинальная сумма, на основе которой определяются платежи по данной части свопа. Если условиями договора предусмотрен график изменения номинальной суммы, указывается ее начальное значение, а в блоке «Шаг изменений» определяется график ее изменений.	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное	mfr	Положительное десятичное число.

	значение <stepValue>	амортизации и/или иного изменения.		Например, 1000
Валюта <currency>		Валюта, в которой выражена номинальная сумма по данной части свопа	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

6.3.5.1.2 Выбор процентной ставки

Параметры процентной ставки, к которой привязаны платежи по данной части процентного свопа. В зависимости от условий сделки заполняется вариант выбора «График фиксированной ставки» или «Определение плавающей ставки».

Вариант выбора «График фиксированной ставки»

Элемент		Описание	Сверка	Формат заполнения
Начальное значение <fixedRateSchedule> <initialValue>		Значение фиксированной ставки. Если условиями предусмотрено несколько значений фиксированной ставки, указывается ее начальное значение, а в блоке «Шаг изменений» определяется график ее изменений.	mfr	Десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05.
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения фиксированной ставки.	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение фиксированной ставки, действующее с указанной даты.	mfr	Десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05.

Вариант выбора «Определение плавающей ставки» / Расчеты по плавающей ставке

Элемент		Описание	Сверка	Формат заполнения
Индекс плавающей ставки <floatingRateIndex>		Индекс плавающей ставки. Если значение индекса отсутствует в справочнике, указывается «Прочее» (Other)	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/floating-rate-index(nsdru)
Период плавающей ставки <indexTenor>	Мультипликатор периода <periodMultiplier>	Мультипликатор, определяющий период плавающей ставки	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
	Тип временного периода <period>	Тип периода плавающей ставки. Например, мультипликатор «3» и период «М» означают, что используется трехмесячная ставка	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodEnum
График множителя плавающей ставки – Начальное значение <floatingRateMultiplierSchedule> <initialValue>		Значение множителя, применимого к плавающей ставке. Если условиями предусмотрено несколько значений множителя, указывается его начальное значение, а в блоке «Шаг изменений» определяется график его изменений.	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1.5.

		график значений. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки (значение не равно «1»).</i>		
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения множителя плавающей ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение множителя, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Десятичное число. Например, 1.5.
График спреда плавающей ставки – Начальное значение <spreadSchedule> <initialValue>		Значение спреда, применимого к плавающей ставке. Может принимать положительные и отрицательные значения. Если условиями предусмотрено несколько значений ставки спреда, указывается ее начальное значение, а в блоке «Шаг изменений» определяется график значений. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки (значение не равно «0»).</i>	mfr	Десятичное число. Например, 10 базисных пунктов или 0,1% представляется как 0.001
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения ставки спреда. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение ставки спреда, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Десятичное число. Например, 0.001
График максимума ставки – Начальное значение <capRateSchedule> <initialValue>		Значение максимума плавающей ставки. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05.
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения максимума ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение максимума ставки, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05.
График минимума ставки – Начальное значение <floorRateSchedule> <initialValue>		Значение минимума плавающей ставки. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки.</i>	mfr	Десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05.
Шаг изменений	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения минимума ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

<step>	Очередное значение <stepValue>	Значение минимума ставки, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05.
Начальное значение ставки <initialRate>		Значение плавающей ставки для первого процентного периода.	mfr	Десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05.

6.3.5.1.3 Коэффициент для расчета дней в процентном периоде

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Коэффициент для расчета дней в процентном периоде <dayCountFraction>	Коэффициент для расчета дней в процентном периоде. Для указания количества дней в процентном периоде, характеризующем отношение фактического количества дней в процентном периоде к фактическому количеству дней в году, в случае договора своп используется значение “ACT/ACT.ISDA”.	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/day-count-fraction(fpmlrus)

6.3.5.1.4 Дисконтирование

Не используется.

6.3.5.1.5 Метод капитализации

Не используется.

6.3.5.2 Вариант выбора «График известных сумм»

Заполняется в случае свопа с нулевым купоном (zero coupon swap) для описания фиксированной суммы.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Начальное значение <knownAmountSchedule> <initialValue>	Номинальная сумма, на основе которой определяются платежи по данной части свопа. График фиксированных платежей определяется в блоке «Шаг изменений».	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000.
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000.
Валюта <currency>	Валюта, в которой выражена номинальная сумма, на основе которой определяются платежи по данной части свопа	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

6.4 Обмен основными суммами

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Первоначальный платеж <initialExchange>	Определяет, будет ли осуществляться первоначальный платеж номинальной суммы на дату начала срока.	mfr	Флаг да/нет (“true”; “false”)

	<i>Необязательный для заполнения элемент.</i>		
Окончательный платеж <finalExchange>	Определяет, будет ли осуществляться окончательный платеж номинальной суммы на дату истечения срока. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	
Промежуточный платеж <intermediateExchange>	Определяет, будут ли осуществляться промежуточные платежи номинальной суммы в течение срока договора. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	

6.5 Дополнительные условия расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Расчетная валюта <settlementCurrency>	Валюта, в которой проводятся расчеты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

7. Анкета договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки (CM033)

7.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником "ProductType": [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdru\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdru)). Допустимые значения:

Значение	Описание
InterestRate:CapFloor:Cap	Сделка фиксации максимальной процентной ставки (сделка кэп)
InterestRate:CapFloor:Floor	Сделка фиксации минимальной процентной ставки (сделка флор)
InterestRate:CapFloor:Collar	Сделка фиксации максимальной и минимальной процентной ставки (сделка коллар)
InterestRate:CapFloor:Straddle	Сделка стрэддл максимальной и минимальной процентных ставок

7.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У

7.3 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона, осуществляющая платеж по плавающей процентной ставке (продавец договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки)	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона, получающая платеж по плавающей процентной ставке (покупатель договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки)	mfr	

7.4 Расчетные (процентные) периоды

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата начала срока <effectiveDate>	Дата начала срока по договору	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

<unadjustedDate>			
Дата истечения срока <terminationDate> <unadjustedDate>	Дата окончания срока по договору	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Дата начала первого регулярного расчетного периода <firstRegularPeriodStartDate>	Дата начала первого полного процентного периода. Может указываться, если график содержит начальный неполный процентный период. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	ГГГГ-ММ-ДД
Дата окончания первого периода капитализации <firstCompoundingPeriodEndDate>	Дата окончания начального периода капитализации. Может указываться, если платеж осуществляется по итогам более чем однопроцентного периода. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	ГГГГ-ММ-ДД
Дата окончания последнего регулярного расчетного периода <lastRegularPeriodEndDate>	Дата окончания последнего полного расчетного периода. Может указываться, если график содержит окончательный неполный расчетный период. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	ГГГГ-ММ-ДД

7.5 Даты платежей / Периодичность платежей

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Мультипликатор периода <paymentDates> <periodMultiplier>	Мультипликатор периода времени	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
Период времени <paymentDates> <period>	Тип периода времени, соответствующий периодичности платежей по договору. "Т" означает, что платеж совершается один раз за весь срок действия договора	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodExtendedEnum
Дата первого платежа <firstPaymentDate>	Дата первого платежа. Может указываться при наличии неполного начального расчетного периода. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	ГГГГ-ММ-ДД
Дата последнего регулярного платежа <lastRegularPaymentDate>	Дата последнего регулярного платежа. Может указываться при наличии неполного последнего расчетного периода. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	

7.6 Даты изменения плавающей ставки / Периодичность изменения плавающей ставки

Не используется.

7.7 Сумма расчетного периода / Выбор суммы расчетного периода

Для определения номинальной суммы и процентной ставки используется вариант выбора «Параметры расчета суммы». Вариант выбора «График известных сумм» *не применим.*

Вариант выбора «Параметры расчета суммы»

7.7.1 Выбор номинальной суммы

Для определения номинальной суммы заполняется вариант выбора «График номинальной суммы». Вариант выбора «График номинальной суммы, привязанной к валютному курсу» не используется.

Вариант выбора «График номинальной суммы» - График значений номинальной суммы.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Начальное значение <notionalSchedule> <initialValue>	Номинальная сумма по договору. «Шаг изменений» не используется.	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000.
Валюта <currency>	Валюта номинальной суммы	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

7.7.2 Выбор процентной ставки

Вариант выбора «График фиксированной ставки»

Не используется для Анкеты договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки.

Вариант выбора «Определение плавающей ставки» / Расчеты по плавающей ставке

Обязательные для Анкеты договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки элементы, определяющие плавающую ставку, в том числе ее максимальное/минимальное значение.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Индекс плавающей ставки <floatingRateIndex>	Индекс плавающей ставки. Если значение индекса отсутствует в справочнике, указывается «Прочее» (Other)	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/floating-rate-index(nsdru)
Период плавающей ставки <indexTenor>	Мультипликатор периода <periodMultiplier>	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
	Тип временного периода <period>	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodEnum
График множителя плавающей ставки – Начальное значение <floatingRateMultiplierSchedule> <initialValue>	Значение множителя, применимого к плавающей ставке. Если условиями предусмотрено несколько значений множителя, указывается его начальное значение, а в блоке «Шаг изменений» определяется график значений. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки (значение не равно «1»).</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1.5
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное	mfr	Положительное

	значение <stepValue>	указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>		десятичное число. Например, 1.5
График спреда плавающей ставки – Начальное значение <spreadSchedule> <initialValue>		Значение спреда, применимого к плавающей ставке. Может принимать положительные и отрицательные значения. Если условиями предусмотрено несколько значений ставки спреда, указывается ее начальное значение, а в блоке «Шаг изменений» определяется график значений. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки (значение не равно «0»).</i>	mfr	Десятичное число. Например, 10 базисных пунктов или 0,1% представляется как 0.001
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения ставки спреда. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение ставки спреда, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Десятичное число. Например, 0.001
График максимума ставки – Начальное значение <capRateSchedule> <initialValue>		Значение максимума плавающей ставки. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения максимума ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение максимума ставки, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
График минимума ставки – Начальное значение <floorRateSchedule> <initialValue>		Значение минимума плавающей ставки. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения минимума ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение минимума ставки, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
Начальное значение ставки <initialRate>		Значение плавающей ставки для первого процентного периода	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05

7.7.3 Коэффициент для расчета дней в процентном периоде

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
---------	----------	--------	-------------------

Коэффициент для расчета дней в процентном периоде <dayCountFraction>	Коэффициент для расчета дней в процентном периоде. Для указания количества дней в процентном периоде, характеризующем отношение фактического количества дней в процентном периоде к фактическому количеству дней в году, в случае договора своп используется значение “ACT/ACT.ISDA”.	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/day-count-fraction(fpmlrus)
--	---	-----	--

7.7.4 Дисконтирование

Не используется.

7.7.5 Метод капитализации

Не используется.

7.8 Обмен основными суммами

Не используется для Анкеты договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки.

7.9 Дополнительные условия расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Расчетная валюта <settlementCurrency>	Валюта, в которой проводятся расчеты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is-o4217-2001-08-15(fpmlrus)

7.10 Премия

7.10.1 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона-покупатель опциона	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-продавец опциона	mfr	

7.10.2 Сумма платежа

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <paymentAmount> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма премии	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is-o4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <paymentAmount> <amount>	Совокупная сумма премии по договору	mfr	Положительное десятичное число. Например, 100

8. Анкета свопциона (СМ034)

8.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником “ProductType”: [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsd rus\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsd rus)). Допустимые значения:

Значение	Описание
InterestRate:Option:Swaption:American	Американский свопцион
InterestRate:Option:Swaption:European	Европейский свопцион

InterestRate:Option:Swaption:Bermuda	Бермудский свопцион
--------------------------------------	---------------------

8.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

8.3 Описание покупателя и продавца

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-покупатель инструмента <buyerPartyReference>	Сторона-покупатель по договору	mfr	Party1; Party2
Сторона-продавец инструмента <sellerPartyReference>	Сторона-продавец по договору	mfr	

8.4 Премия

8.4.1 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона-плательщик премии (покупатель опциона)	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-получатель премии (продавец опциона)	mfr	

8.4.2 Сумма платежа

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <paymentAmount> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма премии	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/verified/current/taxonomy/is04217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <paymentAmount> <amount>	Совокупная сумма премии по договору	mfr	Положительное десятичное число. Например, 100

8.5 Выбор стиля исполнения

8.5.1 Вариант выбора «Американский стиль исполнения опциона»

8.5.1.1 Начальная дата

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Начальная дата <commencementDate> <unadjusted date>	Дата начала срока осуществления права на исполнение опциона. Если начальная дата явным образом не определена, указывается дата заключения сделки	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

8.5.1.2 Дата истечения

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата истечения <expiryDate>	Дата окончания срока осуществления права на исполнение опциона	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

8.5.1.3 Множественное исполнение

Не используется.

8.5.2 Вариант выбора «Бермудский стиль исполнения опциона»

8.5.2.1 Даты исполнения бермудского опциона

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Даты исполнения бермудского опциона <bermudaExerciseDates> <date>	Даты осуществления права на исполнение бермудского опциона (повторяемый элемент)	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

8.5.2.2 Множественное исполнение

Не используется.

8.5.3 Вариант выбора «Европейский стиль исполнения опциона»

8.5.3.1 Дата истечения

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата истечения <expiryDate>	Дата исполнения европейского опциона	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

8.5.3.2 Частичное исполнение

Не используется.

8.6 Выбор метода исполнения

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Свопционный стрэддл <swaptionStraddle>	Определяет, является ли договор свопционом или стратегией свопционный стрэддл	mfr	Флаг да/нет (“true”; “false”)

8.7 Условия свопа

Заполняется аналогично пп. 6.1-6.5 Анкеты процентного свопа (СМ032). Исключение: в качестве значения параметров «Тип продукта» (swap/productType) и «Код классификации ПФИ и договоров РЕПО» (swap/productId) указываются те же значения, что и для свопциона.

9. Анкета договора РЕПО (СМ041)

9.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником “ProductType”: [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdрус\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdрус)). Допустимые значения:

Значение	Описание
Equity:Repo:EquityRepo	Репо с акциями
InterestRate:Repo:BondRepo	Репо с облигациями
CrossAsset:Repo:BasketRepo	Репо с корзиной ценных бумаг

9.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации договоров РЕПО, формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

9.3 Выбор процентной ставки

9.3.1 Вариант выбора «Фиксированная процентная ставка»

Заполняется обязательно для договора РЕПО с фиксированной ставкой.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
---------	----------	--------	-------------------

Начальное значение <fixedRateSchedule> <initialValue>		Значение фиксированной ставки. Если условиями договора предусмотрено несколько значений фиксированной ставки, указывается ее начальное значение, а в блоке «Шаг изменений» определяется график ее изменений	mfr	Десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения фиксированной ставки.	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение фиксированной ставки, действующее с указанной даты.	mfr	Десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05

9.3.2 Вариант выбора «Плавающая процентная ставка»

Заполняется обязательно для договора РЕПО с плавающей ставкой.

Элемент		Описание	Сверка	Формат заполнения
Индекс плавающей ставки <floatingRateIndex>		Индекс плавающей ставки. Если значение индекса отсутствует в справочнике, указывается «Прочее» (Other)	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/floating-rate-index(nsdru)
Период плавающей ставки <indexTenor>	Мультипликатор периода <periodMultiplier>	Мультипликатор, определяющий период плавающей ставки	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
	Тип временного периода <period>	Тип периода плавающей ставки. Например, мультипликатор «3» и период «М» означают, что используется трехмесячная ставка	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodEnum
График множителя плавающей ставки – Начальное значение <floatingRateMultiplierSchedule> <initialValue>		Значение множителя, применимого к плавающей ставке. Если предусмотрено несколько значений множителя, указывается его начальное значение, а в блоке «Шаг изменений» определяется график значений. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки (значение не равно «1»).</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1.5
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения множителя плавающей ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение множителя, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1.5
График спреда плавающей ставки – Начальное значение <spreadSchedule> <initialValue>		Значение спреда, применимого к плавающей ставке. Может принимать положительные и отрицательные значения. Если	mfr	Десятичное число. Например, 10 базисных пунктов или 0,1%

		предусмотрено несколько значений ставки спреда, указывается ее начальное значение, а в блоке «Шаг изменений» определяется график значений. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки (значение не равно «0»).</i>		представляется как 0.001
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения ставки спреда. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение ставки спреда, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Десятичное число. Например, 0.001
График максимума ставки – Начальное значение <capRateSchedule> <initialValue>		Значение максимума плавающей ставки. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки.</i>	mfr	Десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения максимума ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение максимума ставки, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
График минимума ставки – Начальное значение <floorRateSchedule> <initialValue>		Значение минимума плавающей ставки. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки.</i>	mfr	Десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения минимума ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение минимума ставки, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
Начальное значение ставки <initialRate>		Начальное значение плавающей ставки на дату заключения договора	mfr	Десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05

9.4 Коэффициент для расчета дней в процентном периоде

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Коэффициент для расчета дней в процентном периоде <dayCountFraction>	Коэффициент для расчета дней в процентном периоде. Для указания коэффициента, характеризующего отношение фактического количества дней в процентном периоде к фактическому количеству дней в году, в случае договора РЕПО используется значение “ACT/ACT.ICMA”	mfr	Значение из справочника <u>http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/day-count-fraction(fpmlrus)</u>

9.5 Тип срока РЕПО

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Тип срока РЕПО <duration>	Тип договора РЕПО в зависимости от срока (“Overnight”, “Term”, “Open”)	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleRepoDurationEnum

9.6 Первая часть сделки РЕПО

9.6.1 Описание покупателя и продавца

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-покупатель инструмента <buyerPartyReference>	Сторона-покупатель по договору	mfr	Party1; Party2
Сторона-продавец инструмента <sellerPartyReference>	Сторона-продавец по договору	mfr	

9.6.2 Дата расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата расчетов <settlementDate> <unadjustedDate>	Дата расчетов по первой части договора РЕПО	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

9.6.3 Выбор суммы и валюты расчетов. Вариант выбора «Сумма расчетов»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <settlementAmount> <currency>	Валюта, в которой выражена цена сделки по первой части договора РЕПО	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма <settlementAmount> <amount>	Сумма, выраженная в цене сделки, подлежащая уплате покупателем по договору РЕПО продавцу по договору РЕПО при исполнении обязательств по первой части договора РЕПО	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000

Вариант выбора «Валюта расчетов» *Не используется* для первой части договора РЕПО.

9.6.4 Обеспечение

Параметры обеспечения по договору. Если обеспечение представлено в виде долговых инструментов, используется вариант выбора «По номиналу актива». Если обеспечение представлено в виде долевых инструментов, используется вариант выбора «По цене лота активов».¹⁰

Для описания договора РЕПО с корзиной обеспечения блок повторяется для каждого уникального элемента корзины.

¹⁰ Для договоров РЕПО, рассчитанных в Системе управления обеспечением (СУО), в случае обеспечения в виде долевых и долговых инструментов используется вариант выбора «По цене лота активов».

9.6.4.1 Вариант выбора «По номиналу актива»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Номинальная сумма обеспечения - Валюта суммы <nominalAmount> <currency>	Валюта номинальной суммы	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Номинальная сумма обеспечения - Сумма <nominalAmount> <amount>	Номинальная стоимость облигаций в обеспечении. Рассчитывается как количество облигаций, умноженное на начальную номинальную стоимость одной облигации (без дисконта) ¹¹	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000
Чистая цена облигации <cleanPrice>	Чистая цена облигации в обеспечении на дату заключения договора (без учета НКД и дисконта). В условиях договора определяется, как правило, как текущая рыночная цена. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 101.1234567.
Накопленный купонный доход <accruals>	Накопленный купонный доход (НКД) по облигации на дату заключения договора. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	
Грязная цена облигации <dirtyPrice>	Грязная цена облигации, равная сумме чистой цены и НКД. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	

9.6.4.2 Вариант выбора «По цене лота актива»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Количество единиц актива <numberOfUnits>	Количество акций в обеспечении	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
Цена единицы актива – Валюта суммы <unitPrice> <currency>	Валюта, в которой выражена цена акции	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Цена единицы актива – Сумма <unitPrice> <amount>	Цена одной акции. Указывается в соответствии с условиями договора на момент его заключения (без дисконта) ¹¹	mfr	Положительное десятичное число

9.6.4.3 Ссылка на актив

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Ссылка на актив <assetReference>	Ссылка на значение элемента «Идентификатор базового актива» (<instrumentId>), определенного в блоке описания базового актива. Заполняется	mfr	Например, assetReference href="RU000A0JR4A1"

¹¹ Для договоров РЕПО, рассчитанных в Системе управления обеспечением (СУО), значение указывается с учетом дисконта.

	автоматически		
--	---------------	--	--

9.6.4.4 Дисконт по ценной бумаге

Необязательный для заполнения блок, определяющий дисконт, применимый к обеспечению.

9.6.4.4.1 Значение дисконта

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Значение дисконта <haircutValue>	Начальное значение дисконта, применяемого к активу в обеспечении. Дисконт равен разности 100% и коэффициента обеспечения. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	afr	Десятичное число. Например, 20% представляется как 0.2

9.6.4.4.2 Выбор ограничения изменения значения дисконта.

Вариант выбора «Максимальное отклонение дисконта». Не используется.

Вариант выбора «Верхнее и нижнее предельное значение дисконта».

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Верхнее предельное значение дисконта <haircutHigh>	Верхнее предельное значение дисконта. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Десятичное число. Например, 20% представляется как 0.2
Нижнее предельное значение дисконта <haircutLow>	Нижнее предельное значение дисконта. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	

9.6.5 Порядок расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Порядок расчетов <deliveryMethod>	Порядок расчетов по первой части договора РЕПО: “DeliveryVersusPayment” (поставка против платежа), “FreeOfPayment” (свободная поставка). <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleDeliveryMethodEnum

9.6.6 Дата поставки

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата поставки deliveryDate - unadjustedDate	Дата поставки ценных бумаг по первой части договора РЕПО.	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

9.7 Вторая часть сделки РЕПО

9.7.1 Описание покупателя и продавца

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-покупатель инструмента <buyerPartyReference>	Сторона-покупатель по договору	mfr	Party1; Party2
Сторона-продавец инструмента <sellerPartyReference>	Сторона-продавец по договору	mfr	

9.7.2 Дата расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата расчетов <settlementDate> <unadjustedDate>	Дата расчетов по второй части договора РЕПО В случае договора РЕПО с открытой датой указывается дата требования об исполнении договора (согласованная сторонами при заключении договора дата, в которую должны быть исполнены обязательства по второй части открытого РЕПО в случае, если соответствующее требование не было ранее предъявлено)	mfr	ГГТТ-ММ-ДД

9.7.3 Выбор суммы и валюты расчетов

Для договора РЕПО с фиксированной ставкой и фиксированным сроком используется вариант выбора «Сумма расчетов». Для договора РЕПО с плавающей ставкой и договора РЕПО с открытой датой используется вариант выбора «Валюта расчетов».

Вариант выбора «Сумма расчетов»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <settlementAmount> <currency>	Валюта, в которой выражена цена сделки по второй части договора РЕПО с фиксированной ставкой и фиксированным сроком	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма <settlementAmount> <amount>	Сумма расчетов, выраженная в цене сделки, между продавцом по договору РЕПО покупателю при исполнении обязательств по второй части договора РЕПО с фиксированной ставкой и фиксированным сроком. Указывается сумма, определенная на дату заключения договора (в случае изменения данной суммы в течение срока сделки вносить изменения в Анкету договора РЕПО не требуется)	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000

Вариант выбора «Валюта расчетов»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <settlementCurrency>	Валюта расчетов по второй части договора РЕПО с плавающей ставкой и договора РЕПО с открытой датой	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

9.7.4 Обеспечение

Не заполняется для второй части договора РЕПО.

9.7.5 Порядок расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Порядок расчетов <deliveryMethod>	Порядок расчетов по второй части договора РЕПО: “DeliveryVersusPayment” (поставка против платежа), “FreeOfPayment” (свободная поставка). <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleDeliveryMethodEnum

9.7.6 Дата поставки

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата поставки <deliveryDate> <unadjustedDate>	Дата поставки ценных бумаг по второй части договора РЕПО.	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

9.8 Финансовый инструмент сделки РЕПО

Для описания договора РЕПО с корзиной обеспечения блок повторяется для каждого уникального элемента корзины.

9.8.1 Вариант выбора «Облигация»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Идентификатор долгового финансового инструмента (облигации). Для ценных бумаг указывается код ISIN. В случае отсутствия кода ISIN – иной депозитарный код, номер государственной регистрации или код в системе Bloomberg, при этом «Наименование актива» указывается обязательно	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JREQ7.
Наименование актива <description>	Полное наименование финансового инструмента. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка.

9.8.2 Вариант выбора «Фондовый актив»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Идентификатор долевого финансового инструмента (акции). Для ценных бумаг указывается код ISIN, а в случае его отсутствия – иной депозитарный код или код ценной бумаги в системе Bloomberg	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JR4A1.
Наименование актива <description>	Полное наименование финансового инструмента. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка.

10. Анкета договора купли-продажи облигации (СМ042)

10.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником “ProductType”: [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdru\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdru)). Допустимые значения:

Значение	Описание
InterestRate:Other:DebtSpot	Спот-сделка с облигацией
InterestRate:Other:DebtTerm	Срочная сделка с облигацией

10.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Для договора купли-продажи облигации, который не является ПФИ, указывается значение “UKWN”.

10.3 Описание покупателя и продавца

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-покупатель инструмента	Сторона-покупатель по договору	mfr	Party1; Party2

<buyerPartyReference>			
Сторона-продавец инструмента <sellerPartyReference>	Сторона-продавец по договору	mfr	

10.4 Номинальная сумма

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <nominalAmount> <currency>	Валюта, в которой выражена номинальная стоимость	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма <nominalAmount> <amount>	Совокупная номинальная стоимость договора. Определяется как количество облигаций, умноженное на начальную номинальную стоимость одной облигации	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000

10.5 Цена

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Чистая цена облигации <cleanPrice>	Чистая цена облигации на дату заключения договора (без учета НКД и дисконта). В условиях договора определяется, как правило, как текущая рыночная цена	mfr	Положительное десятичное число. Например, 101.1234567
Накопленный купонный доход <accruals>	Накопленный купонный доход (НКД) на дату заключения договора. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	
Грязная цена облигации <dirtyPrice>	Грязная цена облигации, равная сумме чистой цены и НКД. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	

10.6 Облигация

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Идентификатор облигации. Для ценных бумаг указывается код ISIN. В случае отсутствия кода ISIN – иной депозитарный код, номер государственной регистрации или код в системе Bloomberg, при этом «Наименование актива» указывается обязательно.	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JREQ7.
Наименование актива <description>	Полное наименование базового актива. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка.

10.7 Срок сделки

Необязательные для заполнения элементы, определяющие срок сделки.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Мультипликатор периода <term>	Мультипликатор периода времени. <i>Необязательный для заполнения</i>	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

<periodMultiplier>	<i>элемент.</i>		
Тип временного периода <term> <period>	Тип периода времени, соответствующий сроку сделки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodEnum

10.8 Порядок расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Порядок расчетов <deliveryMethod>	Порядок расчетов: “DeliveryVersusPayment” (поставка против платежа), “FreeOfPayment” (свободная поставка). <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleDeliveryMethodEnum

10.9 Дата расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата расчетов <settlementDate> <unadjustedDate>	Дата расчетов по договору	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

10.10 Дата поставки

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата поставки <deliveryDate> <unadjustedDate>	Дата поставки по договору	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

10.11 Количество единиц актива

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Количество единиц актива <numberOfUnits>	Количество облигаций по договору	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000

11. Анкета форварда на облигацию или индекс (СМ043)

11.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником “ProductType”: [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdru\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdru)). Допустимые значения:

Значение	Описание
InterestRate:Forward:DebtForward:SingleName	Форвард на облигацию
InterestRate:Forward:DebtForward:SingleIndex	Форвард на индекс
InterestRate:Forward:DebtForward:Basket	Форвард на корзину облигаций
InterestRate:Forward:DebtForward:BasketIndex	Форвард на корзину индексов

Типы «Форвард на индекс», «Форвард на корзину индексов» используется для всех видов индексов (индексов облигаций, индексов акций).

11.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

11.3 Описание покупателя и продавца

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-покупатель инструмента <buyerPartyReference>	Сторона-покупатель по договору	mfr	Party1; Party2
Сторона-продавец инструмента <sellerPartyReference>	Сторона-продавец по договору	mfr	

11.4 Базовый актив. Выбор типа базового актива

Параметры единичного базового актива (долгового инструмента или индекса) либо корзины активов (корзины облигаций или корзины индексов).

11.4.1 Вариант выбора «Единичный базовый актив»

Параметры единичного базового актива – долгового финансового инструмента или индекса (<singleUnderlyer>). Варианты выбора «Корзина базовых активов», «Товарный актив», «Акция» в этом случае *не применимы*.

11.4.1.1 Базовый актив

Вариант выбора «Облигация»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Для ценных бумаг указывается код ISIN. В случае отсутствия кода ISIN – иной депозитарный код, номер государственной регистрации или код в системе Bloomberg, при этом «Наименование актива» указывается обязательно	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JREQ7.
Наименование актива <description>	Полное наименование базового актива. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка

Вариант выбора «Индекс»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Идентификатор (код) индекса	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JREQ7
Наименование актива <description>	Полное наименование индекса. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка

11.4.1.2 Лот актива

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Лот актива <singleUnderlyer> <openUnits>	Количество базового актива (облигаций) по договору. В случае форварда на индекс указывается значение «1», если иное не определено условиями сделки	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

11.4.2 Вариант выбора «Корзина базовых активов»

Параметры базового актива в виде корзины долговых финансовых инструментов или корзины индексов (<basket>).

11.4.2.1 Число единиц активов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Число единиц	Количество корзин, указанное в условиях	mfr	Положительное целое

активов <basket > <openUnits>	сделки, а при отсутствии такого указания – одна корзина.		число (1, 2, 3 и т.д.)
---	--	--	------------------------

11.4.2.2 Компонент корзины

Параметры активов, входящих в корзину. Данный блок является повторяемым, заполняется для каждого уникального элемента корзины.

Варианты выбора «Корзина базовых активов», «Товарный актив», «Акция» *не применимы*.

11.4.2.2.1 Базовый актив

Вариант выбора «Облигация»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Для ценных бумаг указывается код ISIN. В случае отсутствия кода ISIN – иной депозитарный код, номер государственной регистрации или код в системе Bloomberg, при этом «Наименование актива» указывается обязательно.	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JREQ7
Наименование актива <description>	Полное наименование базового актива. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка

Вариант выбора «Индекс»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Идентификатор (код) индекса.	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JREQ7.
Наименование актива <description>	Полное наименование индекса. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка.

11.4.2.2.2 Вес элемента. Выбор типа весового коэффициента

Вес активов (облигаций, индексов), входящих в корзину. В зависимости от того, как выражается данный параметр, используется один из вариантов выбора: «Количество единиц базового актива» или «Вес компонента корзины в процентах». Вариант выбора «Вес компонента корзины в денежном выражении» не используется.

Вариант выбора «Количество единиц базового актива»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Количество единиц базового актива <constituentWeight> <openUnits>	Количество указанного актива (облигации) в корзине.	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

Вариант выбора «Вес компонента корзины в процентах»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Вес компонента корзины в процентах <basketPercentage>	Вес указанного актива (индекса) в корзине, выраженный в виде десятичной дроби.	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05

11.5 Номинальная сумма

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
---------	----------	--------	-------------------

Валюта суммы <nominalAmount> <currency>	Валюта номинальной суммы.	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма <nominalAmount> <amount>	<p>Совокупная номинальная сумма (объем договора).</p> <p>В случае форварда на облигации определяется как произведение количества облигаций и номинальной стоимости одной облигации.</p> <p>В случае форварда на корзину облигаций определяется как произведение количества корзин и стоимости одной корзины.</p> <p>В случае форварда на индекс определяется как произведение значения индекса на дату заключения договора в индексных пунктах и мультипликатора индекса (стоимости 1 пункта индекса в соответствии со спецификацией) либо как стоимость договора на дату его заключения в соответствии с данными бухгалтерского учета.</p>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000

11.6 Дата расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата расчетов <settlementDate> <unadjustedDate>	Дата расчетов по договору	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

11.7 Валюта расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта расчетов <settlementCurrency>	Валюта, в которой проводятся расчеты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

11.8 Источник расчетных цен

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Источник расчетных цен <settlementPriceSource>	Информационный источник, публикующий значение рыночной цены базового актива. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/settlement-price-source(fpmlrus)

11.9 Частичная поставка

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Частичная поставка <partialDelivery>	Определяет, допускается ли частичная поставка по договору. <i>Необязательный</i>	afr	Флаг да/нет ("true"; "false")

	для заполнения элемент.		
--	-------------------------	--	--

11.10 Форвардная цена

Вариант выбора «Форвардная цена»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <forwardPricePerBond> <currency>	Валюта, в которой выражена форвардная цена	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Форвардная цена <forwardPricePerBond> <amount>	Форвардная цена за единицу базового актива (облигацию или корзину облигаций), определенная как сумма в соответствующей валюте. Если форвардная цена не определена на дату предоставления информации о договоре в Репозиторий, указывается либо текущая рыночная цена, либо начальное значение базового актива, либо цена определенная иным образом (например, в соответствии с договором) и согласованная сторонами. При этом не позднее трех рабочих дней с даты определения форвардной цены следует предоставить в Репозиторий информацию об изменении соответствующего договора.	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000

Вариант выбора «Форвардная цена в процентах»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Форвардная цена в процентах <forwardPricePercentage>	Форвардная цена, определенная в процентном соотношении или как значение индекса. Если форвардная цена не определена на дату предоставления информации о договоре в Репозиторий, указывается текущая рыночная цена. При этом не позднее трех рабочих дней с даты определения форвардной цены следует предоставить в Репозиторий информацию об изменении соответствующего договора.	mfr	Положительное десятичное число. Например, 105.1234567

12. Анкета опциона на облигацию (CM044)

12.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником "ProductType": [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdus\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdus)). Допустимое значение:

Значение	Описание
InterestRate:Option:DebtOption:SingleName	Опцион на облигацию

12.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

12.3 Описание покупателя и продавца

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-покупатель инструмента <buyerPartyReference>	Сторона-покупатель по договору	mfr	Party1; Party2
Сторона-продавец инструмента <sellerPartyReference>	Сторона-продавец по договору	mfr	

12.4 Тип опциона

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Тип опциона <optionType>	Тип опциона в соответствии с условиями договора: “Put” или “Call”	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleOptionTypeEnum

12.5 Премия опциона

12.5.1 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона-покупатель опциона	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-продавец опциона	mfr	

12.5.2 Сумма платежа

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <paymentAmount> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма премии	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <paymentAmount> <amount>	Совокупная сумма премии по договору	mfr	Положительное десятичное число. Например, 100

12.6 Выбор стиля исполнения

12.6.1 Вариант выбора «Американский стиль исполнения опциона»

12.6.1.1 Начальная дата

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Начальная дата <commencementDate> <unadjusted date>	Дата начала срока осуществления права на исполнение опциона. Если начальная дата явным образом не определена, указывается дата заключения сделки	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

12.6.1.2 Дата истечения

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата истечения <expirationDate> <unadjusted date>	Дата окончания срока осуществления права на исполнение опциона	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

12.6.1.3 Множественное исполнение

Не используется.

12.6.2 Вариант выбора «Бермудский стиль исполнения опциона»

12.6.2.1 Даты исполнения бермудского опциона

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Даты исполнения бермудского опциона <bermudaExerciseDate> <date>	Даты осуществления права на исполнение бермудского опциона (повторяемый элемент)	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

12.6.2.2 Множественное исполнение

Не используется.

12.6.3 Вариант выбора «Европейский стиль исполнения опциона»

12.6.3.1 Дата истечения

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата истечения <expiryDate>	Дата исполнения европейского опциона	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

12.6.3.2 Частичное исполнение

Не используется.

12.7 Дополнительные параметры

Параметры азиатского и/или барьерного (в т. ч. бинарного) опциона. Заполняется обязательно, если перечисленные ниже параметры содержатся в условиях сделки.

12.7.1 Параметры азиатского опциона

12.7.1.1 Метод усреднения цены

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Метод усреднения цены <averagingInOut>	Метод усреднения цены, используемый для азиатского опциона. “In” означает, что цена страйк определяется как среднее значение цены базового актива на спот-рынке за указанный период (опцион с азиатским страйком). “Out” означает, что цена базового актива при экспирации опциона определяется как среднее значение цены базового актива на спот-рынке за указанный период (опцион с азиатской ценой). “Both” означает опцион с азиатским страйком и азиатской ценой.	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleAveragingInOutEnum

12.7.1.2 Период усреднения цены страйка. График наблюдений

Для азиатского опциона указывается период, за который определяется средняя цена базового актива. Если условиями азиатского опциона предусмотрены дискретные даты, за которые определяется средняя цена, указываются первая и последняя даты.

Заполняется, если указан метод усреднения цены “In” (при этом «Период усреднения цены базового актива» не заполняется) или “Both”.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
---------	----------	--------	-------------------

Начало периода наблюдения <schedule> <startDate>		Дата начала периода, за который определяется среднее значение цены	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Окончание периода наблюдения <schedule> <endDate>		Дата окончания периода, за который определяется среднее значение цены	mfr	
Периодичность расчетного периода <averagingPeriod Frequency>	Мультипликатор периода <periodMultiplier>	Мультипликатор периода времени	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
	Период времени <period>	Тип периода времени, соответствующий периоду, за который определяется среднее значение цены базового актива	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodExtendedEnum

12.7.1.3 Период усреднения цены базового актива. График наблюдений

См. п. 12.7.1.2. Заполняется, если указан метод усреднения цены “Out” (при этом «Период усреднения цены страйка» не заполняется) или “Both”.

12.7.2 Условия барьерного опциона

12.7.2.1 Параметры отлагательного условия

12.7.2.1.1 Параметры триггерного условия

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Пороговый уровень <level>	Барьерная цена, с достижением которой стороны связали возникновение у покупателя опциона права требовать от продавца исполнения договора (отлагательное условие, knock-in)	mfr	Положительное десятичное число. Например, 101.1234567
Тип порогового уровня <triggerType>	Условие достижения барьерной цены (значение рыночной цены по отношению к барьерной цене): “EqualOrLess”, “EqualOrGreater”, “Equal”, “Less”, “Greater”	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleTriggerTypeEnum

12.7.2.1.2 Выплата по бинарному опциону

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона-плательщик выплаты по бинарному опциону	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-получатель выплаты по бинарному опциону	mfr	
Сумма платежа <featurePayment> <amount>	Сумма платежа по бинарному опциону	mfr	Положительное десятичное число. Например, 100
Валюта суммы <featurePayment> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма платежа по бинарному опциону	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

12.7.2.2 Параметры отменительного условия

12.7.2.2.1 Параметры триггерного условия

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Пороговый уровень <level>	Барьерная цена, с достижением которой опцион прекращает действовать (отменительное условие, knock-out)	mfr	Положительное десятичное число. Например, 101.1234567
Тип порогового уровня <triggerType>	Условие достижения барьерной цены (значение рыночной цены по отношению к барьерной цене): “EqualOrLess”, “EqualOrGreater”, “Equal”, “Less”, “Greater”	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleTriggerTypeEnum

12.7.2.2.2 Выплата по бинарному опциону

Заполняется аналогично п. 12.7.2.1.2.

12.8 Номинальная сумма

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <nominalAmount> <currency>	Валюта номинальной суммы	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма <nominalAmount> <amount>	Совокупная номинальная сумма (объем договора). Определяется как произведение количества опционов, количества облигаций в одном опционе и номинальной стоимости одной облигации	mfr	Положительное десятичное число Например, 1000

12.9 Объем лота

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Объем лота <optionEntitlement>	Количество облигаций в одном опционе, указанное в условиях сделки, а при отсутствии такого указания – одна облигация	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

12.10 Количество опционов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Количество опционов <numberOfOptions>	Количество опционов, в отношении которого заключен договор	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

12.11 Тип расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Тип расчетов <settlementType>	Тип расчетов по договору: “Cash”, “Physical”, “Election” (возможность выбора между расчетным и поставочным исполнением)	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleSettlementTypeEnum

12.12 Цена исполнения

12.12.1 Вариант выбора «Цена страйк»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Цена исполнения <strikePrice>	Цена исполнения, определенная как сумма в соответствующей валюте. Если цена исполнения по условиям договора определяется на будущую дату,	mfr	Положительное десятичное число

	указывается либо рыночная цена, либо цена, определенная иным образом на дату заключения договора. При этом, не позднее трех рабочих дней с даты определения цены, следует предоставить в Репозиторий информацию об изменении соответствующего договора. <i>В случае барьерного условия может заполняться цена, относительно которой рассчитывается в моменте барьер на дату заключения сделки (текущая рыночная цена, если не оговорено иное).</i>		
--	---	--	--

12.12.2 Вариант выбора «Цена исполнения в процентах»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Цена исполнения в процентах <strikePercentage>	Цена исполнения, определенная в процентном соотношении	mfr	Положительное десятичное число. Например, 105.1234567

12.12.3 Валюта

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта <currency>	Валюта, в которой выражена цена исполнения. Если цена исполнения определена в процентном соотношении от номинальной стоимости, указывается валюта, в которой выражена номинальная стоимость.	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

12.12.4 Облигация

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Для ценных бумаг указывается код ISIN. В случае отсутствия кода ISIN указывается иной депозитарный код, номер государственной регистрации или код в системе Bloomberg, при этом «Наименование актива» заполняется обязательно. Для фьючерса на облигации указывается код фьючерса в соответствии со спецификацией	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JREQ7
Наименование актива <description>	Полное наименование базового актива. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка

13. Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (CM045)

13.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником “ProductType”: [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdru\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdru)). Допустимые значения:

Значение	Описание
InterestRate:Option:DebtOption:SingleIndex	Опцион на индекс
InterestRate:Option:DebtOption:Basket	Опцион на корзину облигаций
InterestRate:Option:DebtOption:BasketIndex	Опцион на корзину индексов

Типы «Опцион на индекс», «Опцион на корзину индексов» используются для всех видов индексов (индексов облигаций, индексов акций).

13.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

13.3 Описание покупателя и продавца

Заполняется аналогично п. 12.3 Анкеты опциона на облигацию (СМ044).

13.4 Тип опциона

Заполняется аналогично п. 12.4 Описание покупателя и 1 Анкеты опциона на облигацию (СМ044).

13.5 Премия опциона

Заполняется аналогично Описание покупателя и 1 п. 12.5 Анкеты опциона на облигацию (СМ044).

13.6 Выбор стиля исполнения

Заполняется аналогично п. 12.6 Анкеты опциона на облигацию (СМ044).

13.7 Дополнительные параметры

Заполняется аналогично Описание покупателя и 1 п. 12.7 Описание покупателя и 1 Анкеты опциона на облигацию (СМ044).

13.8 Номинальная сумма

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <nominalAmount> <currency>	Валюта номинальной суммы	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма <nominalAmount> <amount>	Совокупная номинальная сумма (объем договора). В случае опциона на корзину облигаций/индексов определяется как произведение количества опционов, количества корзин и номинальной стоимости одной корзины. В случае опциона на индекс определяется как произведение количества опционов, значения индекса на дату заключения договора в индексных пунктах и мультипликатора индекса (стоимости 1 пункта индекса в соответствии со спецификацией). Если данным способом определить номинальную сумму невозможно, указывается стоимость договора на дату его заключения в соответствии с данными бухгалтерского учета.	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000

13.9 Объем лота

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Объем лота <optionEntitlement>	Количество корзин/индексов в одном опционе, указанное в условиях сделки, а при отсутствии такого указания – «1»	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

13.10 Количество опционов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Количество опционов <numberOfOptions>	Количество опционов в соответствии с условиями сделки	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

13.11 Тип расчетов

Заполняется аналогично [Описание покупателя и 1](#) п. 12.11 Анкеты опциона на облигацию (СМ044).

13.12 Цена исполнения (страйк)

Заполняется аналогично [Описание покупателя и 1](#) п. 12.12 [Описание покупателя и 1](#) Анкеты опциона на облигацию (СМ044).

13.13 Выбор базового актива

13.13.1 Вариант выбора «Корзина»

Параметры базового актива в виде корзины долговых финансовых инструментов или корзины индексов (<basket>).

13.13.1.1 Число единиц активов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Число единиц активов <basket > <openUnits>	Количество корзин в одном опционе, указанное в условиях сделки, а при отсутствии такого указания – «1»	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

13.13.1.2 Компонент корзины

Параметры активов, входящих в корзину. Данный блок является повторяемым, заполняется для каждого уникального элемента корзины.

Варианты выбора «Корзина базовых активов», «Товарный актив», «Акция» *не применимы*.

13.13.1.2.1 Базовый актив

Вариант выбора «Облигация»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Для ценных бумаг указывается код ISIN. В случае отсутствия кода ISIN – иной депозитарный код, номер государственной регистрации или код в системе Bloomberg, при этом «Наименование актива» указывается обязательно	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JREQ7.
Наименование актива <description>	Полное наименование базового актива. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка

Вариант выбора «Индекс»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Идентификатор (код) индекса	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JREQ7
Наименование актива <description>	Полное наименование индекса. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка

	<i>элемент.</i>		
--	-----------------	--	--

13.13.1.2.2 Вес элемента. Выбор типа весового коэффициента

Вес элементов (облигаций, индексов), входящих в корзину. В зависимости от того, как выражается данный параметр, используется один из вариантов выбора: «Количество единиц базового актива» или «Вес компонента корзины в процентах». Вариант выбора «Вес компонента корзины в денежном выражении» не используется.

Вариант выбора «Количество единиц базового актива»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Количество единиц базового актива <constituentWeight> <openUnits>	Количество указанного актива (облигации) в корзине	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

Вариант выбора «Вес компонента корзины в процентах»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Вес компонента корзины в процентах <basketPercentage>	Вес указанного актива (индекса) в корзине, выраженный в виде десятичной дроби	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05

13.13.2 Вариант выбора «Индекс»

Параметры базового актива в виде индекса (<index>).

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Идентификатор (код) индекса	mfr	Символьная строка Например, RU000A0JREQ
Наименование актива <description>	Полное наименование индекса. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка

14. Анкета договора купли-продажи акции (СМ046)

14.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником “ProductType”: [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdru\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdru)). Допустимые значения:

Значение	Описание
Equity:Other:EquitySpot	Спот-сделка с акцией
Equity:Other:EquityTerm	Срочная сделка с акцией

14.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Для договора купли-продажи акции, который не является ПФИ, указывается значение “UKWN”.

14.3 Описание покупателя и продавца

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-покупатель инструмента	Сторона-покупатель по договору	mfr	Party1; Party2

<buyerPartyReference>			
Сторона-продавец инструмента <sellerPartyReference>	Сторона-продавец по договору	mfr	

14.4 Количество единиц

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Количество единиц <numberOfUnits>	Количество акций, являющихся базовым активом по договору	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

14.5 Цена за единицу

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <unitPrice> <currency>	Валюта, в которой выражена цена.	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма <unitPrice> <amount>	Цена одной акции.	mfr	Положительное десятичное число

14.6 Акция

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Для ценных бумаг указывается код ISIN. В случае отсутствия кода ISIN – иной депозитарный код, номер государственной регистрации или код в системе Bloomberg, при этом «Наименование актива» указывается обязательно.	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JR4A1
Наименование актива <description>	Полное наименование базового актива. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка

14.7 Срок сделки

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Мультипликатор периода <term> <periodMultiplier>	Мультипликатор периода времени. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
Тип временного периода <term> <period>	Тип периода времени, соответствующий сроку договора. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodExtendedEnum

14.8 Порядок расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Порядок расчетов	Порядок расчетов: “DeliveryVersusPayment” (поставка)	afr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodExtendedEnum

<deliveryMethod>	против платежа), “FreeOfPayment” (свободная поставка). <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>		ned/current/reference/types/simpleDeliveryMethodEnum
------------------	--	--	--

14.9 Дата расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата расчетов <settlementDate> <unadjustedDate>	Дата расчетов по договору	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

14.10 Дата поставки

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата поставки <deliveryDate> <unadjustedDate>	Дата поставки по договору	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

15. Анкета форварда на акцию (СМ047)

15.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником “ProductType”: [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdрус\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdрус)). Допустимые значения:

Значение	Описание
Equity:Forward:PriceReturnBasicPerformance:SingleName	Форвард на акцию
Equity:Forward:PriceReturnBasicPerformance:Basket	Форвард на корзину акций

Также, анкета может быть использована для других долевого инструментов, согласно описанию Приложения 3 в Указании Банка России 4104-У от 16.08.2016, при этом, в случае долевого инструментов, отличных от акций, выбираются текущие значения из Справочника.

В случае форварда на индекс акций и форварда на корзину индексов акций используется Анкета форварда на облигацию или индекс (СМ043), типы продукта «Форвард на индекс» и «Форвард на корзину индексов» соответственно.

15.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

15.3 Описание покупателя и продавца

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-покупатель инструмента <buyerPartyReference>	Сторона-покупатель по договору	mfr	Party1; Party2
Сторона-продавец инструмента <sellerPartyReference>	Сторона-продавец по договору	mfr	

15.4 Базовый актив

15.4.1 Вариант выбора «Единичный базовый актив»

Параметры единичного базового актива – долевого финансового инструмента. Варианты выбора «Корзина базовых активов», «Товарный актив», «Облигация», «Индекс» в этом случае *не применимы*.

15.4.1.1 Базовый актив

Вариант выбора «Акция»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Для ценных бумаг указывается код ISIN. В случае отсутствия кода ISIN – иной депозитарный код, номер государственной регистрации или код в системе Bloomberg, при этом «Наименование актива» указывается обязательно.	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JR4A1
Наименование актива <description>	Полное наименование базового актива. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка

15.4.1.2 Лот актива

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Лот актива <singleUnderlyer> <openUnits>	Количество акций в соответствии с условиями сделки	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

15.4.2 Вариант выбора «Корзина базовых активов»

Параметры базового актива в виде корзины акций.

15.4.2.1 Лот актива

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Число единиц активов <basket > <openUnits>	Количество корзин, указанное в условиях сделки, а при отсутствии такого указания – одна корзина	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

15.4.2.2 Компонент корзины

Параметры активов, входящих в корзину. Данный блок является повторяемым, заполняется для каждого уникального элемента корзины.

Варианты выбора «Корзина базовых активов», «Товарный актив», «Облигация», «Индекс» *не применимы.*

15.4.2.2.1 Базовый актив

Вариант выбора «Акция»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Для ценных бумаг указывается код ISIN. В случае отсутствия кода ISIN – иной депозитарный код, номер государственной регистрации или код в системе Bloomberg, при этом «Наименование актива» указывается обязательно	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JR4A1
Наименование актива <description>	Полное наименование базового актива. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка

15.4.2.2.2 Вес элемента. Выбор типа весового коэффициента

Вес активов, входящих в корзину. Используется вариант выбора «Количество единиц базового актива».

Вариант выбора «Количество единиц базового актива»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Количество единиц базового актива <constituentWeight>	Количество указанного актива (акции) в корзине	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

<openUnits>			
-------------	--	--	--

15.5 Номинальная сумма

Номинальная сумма указывается, если по условиям договора не представляется возможным определить форвардную цену на дату предоставления информации о договоре в Репозиторий.

Номинальная сумма договора

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Номинальная сумма <notional> <currency>	Валюта номинальной суммы	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
<notional> <amount>	Размер номинальной суммы	mrf	Положительное десятичное число

15.6 Исполнение контракта на фондовые активы

Параметры исполнения форварда. Заполняется блок «Европейский стиль исполнения» (иные варианты выбора не применимы).

15.6.1 Дата

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата <expirationDate> <unadjustedDate>	Дата расчетов по договору	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

15.6.2 Валюта расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта расчетов <settlementCurrency>	Валюта, в которой проводятся расчеты	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

15.6.3 Тип расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Тип расчетов <settlementType>	Тип расчетов по договору: “Cash”, “Physical”, “Election” (возможность выбора между расчетным и поставочным исполнением)	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleSettlementTypeEnum

Блок «Дополнительные характеристики» для Анкеты форварда на акции *не применим*.

15.7 Форвардная цена

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <forwardPrice> <currency>	Валюта, в которой выражена форвардная цена	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма	Форвардная цена за единицу базового актива. В случае форварда на корзину акций	mfr	Положительное

<forwardPrice> <amount>	– стоимость одной корзины. Если форвардная цена не определена на дату предоставления информации о договоре в Репозиторий, указывается либо текущая рыночная цена, либо начальное значение базового актива, либо цена, определенная иным образом (например, в соответствии с договором) и согласованная сторонами. При этом не позднее трех рабочих дней с даты определения форвардной цены следует предоставить в Репозиторий информацию об изменении соответствующего договора.		десятичное число
----------------------------	---	--	------------------

16. Анкета опциона на акцию (СМ048)

16.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником “ProductType”: [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdru\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdru)). Допустимые значения:

Значение	Описание
Equity:Option:PriceReturnBasicPerformance:SingleName	Опцион на акцию
Equity:Option:PriceReturnBasicPerformance:Basket	Опцион на корзину акций

В случае опциона на индекс акций и опциона на корзину индексов акций используется Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (СМ045), типы продукта «Опцион на индекс» и «Опцион на корзину индексов» соответственно.

16.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

16.3 Описание покупателя и продавца

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-покупатель инструмента <buyerPartyReference>	Сторона-покупатель по договору	mfr	Party1; Party2
Сторона-продавец инструмента <sellerPartyReference>	Сторона-продавец по договору	mfr	

16.4 Базовый актив

16.4.1 Вариант выбора «Единичный базовый актив»

Параметры единичного базового актива (акции). Варианты выбора «Корзина базовых активов», «Товарный актив», «Облигация», «Индекс» в этом случае *не применимы*.

16.4.1.1 Базовый актив

Вариант выбора «Акция»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Для ценных бумаг указывается код ISIN. В случае отсутствия кода ISIN указывается иной депозитарный код, номер государственной регистрации или код в системе Bloomberg, при этом «Наименование актива» заполняется обязательно. Для	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JR4A1

	фьючерса на акции указывается код фьючерса в соответствии со спецификацией.		
Наименование актива <description>	Полное наименование базового актива. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка

16.4.1.2 Лот актива

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Лот актива <singleUnderlyer> <openUnits>	Совокупное количество базового актива (акций) по договору. Если договор заключен в отношении нескольких опционов, определяется как произведение количества опционов и количества акций в одном опционе. Если договор заключен в отношении одного опциона, совпадает с объемом опциона	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

16.4.2 Вариант выбора «Корзина базовых активов»

Параметры базового актива в виде корзины акций.

16.4.2.1 Лот актива

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Число единиц активов <basket > <openUnits>	Совокупное количество корзин акций по договору. Если договор заключен в отношении нескольких опционов, определяется как произведение количества опционов и количества корзин в одном опционе. Если договор заключен в отношении одного опциона, совпадает с объемом опциона	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

16.4.2.2 Компонент корзины

Параметры активов, входящих в корзину. Данный блок является повторяемым, заполняется для каждого уникального элемента корзины.

Варианты выбора «Корзина базовых активов», «Товарный актив», «Облигация», «Индекс» *не применимы.*

16.4.2.2.1 Базовый актив

Вариант выбора «Акция»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Для ценных бумаг указывается код ISIN. В случае отсутствия кода ISIN – иной депозитарный код, номер государственной регистрации или код в системе Bloomberg, при этом «Наименование актива» указывается обязательно	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JR4A1
Наименование актива <description>	Полное наименование базового актива. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка

16.4.2.2.2 Вес элемента. Выбор типа весового коэффициента

Вес активов, входящих в корзину. Используется вариант выбора «Количество единиц базового актива».

Вариант выбора «Количество единиц базового актива»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Количество единиц базового актива <constituentWeight> <openUnits>	Количество указанного актива (акции) в корзине	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

16.5 Номинальная сумма

Номинальная сумма указывается в случае, если по условиям договора невозможно определить Лот актива или Цену исполнения в денежном выражении.

Номинальная сумма договора

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Номинальная сумма <notional> <currency>	Валюта номинальной суммы	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
<notional> <amount>	Размер номинальной суммы	mrf	Положительное десятичное число

16.6 Выбор стиля исполнения

16.6.1 Вариант выбора «Европейский стиль исполнения опциона»

16.6.1.1 Дата

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата <expirationDate>	Дата исполнения европейского опциона.	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

16.6.2 Вариант выбора «Американский стиль исполнения опциона»

16.6.2.1 Начальная дата

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Начальная дата <commencementDate> <unadjusted date>	Дата начала срока осуществления права на исполнение опциона. Если начальная дата явным образом не определена, указывается дата заключения сделки	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

16.6.2.2 Дата истечения

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата истечения <expirationDate> <unadjusted date>	Дата окончания срока осуществления права на исполнение опциона	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

16.6.2.3 Многократное исполнение фондовых опционов

Не используется.

16.6.3 Вариант выбора «Бермудский стиль исполнения опциона»

16.6.3.1 Начальная дата

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Начальная дата <commencementDate> <unadjusted date>	Дата начала срока осуществления права на исполнение опциона. Если начальная дата явным образом не определена, указывается дата заключения сделки	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

16.6.3.2 Дата истечения

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата истечения <expirationDate> <unadjusted date>	Дата окончания срока осуществления права на исполнение опциона	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

16.6.3.3 Даты исполнения бермудского опциона

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Даты исполнения бермудского опциона <bermudaExerciseDates> <date>	Даты, в которые может быть исполнен бермудский опцион (повторяемый элемент)	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

16.6.3.4 Многократное исполнение фондовых опционов

Не используется.

16.7 Валюта расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта расчетов <settlementCurrency>	Валюта, в которой проводятся расчеты	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

16.8 Тип расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Тип расчетов <settlementType>	Тип расчетов по договору: “Cash”, “Physical”, “Election” (возможность выбора между расчетным и поставочным исполнением).	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleSettlementTypeEnum

16.9 Дополнительные характеристики

Параметры азиатского и/или барьерного (в т. ч. бинарного) опциона. Заполняется обязательно, если перечисленные ниже параметры содержатся в условиях сделки.

16.9.1 Параметры азиатского опциона

16.9.1.1 Метод усреднения цены

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Метод усреднения цены <averagingInOut>	Метод усреднения цены, используемый для азиатского опциона. “In” означает, что цена страйк определяется как среднее значение цены базового актива на спот-рынке за указанный период (опцион с азиатским страйком). “Out” означает, что цена базового актива при экспирации опциона определяется как среднее	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleAveragingInOutEnum

	значение цены базового актива на спот-рынке за указанный период (опцион с азиатской ценой). “Both” означает опцион с азиатским страйком и азиатской ценой.		
--	---	--	--

16.9.1.2 Период усреднения цены страйка. График наблюдений

Для азиатского опциона указывается период, за который определяется средняя цена базисного актива опциона (если условиями азиатского опциона предусмотрены дискретные даты, за которые определяется средняя цена, указываются первая и последняя даты).

Заполняется, если указан метод усреднения цены “In” (при этом «Период усреднения цены базового актива» не заполняется) или “Both”.

Элемент		Описание	Сверка	Формат заполнения
Начало периода наблюдения <schedule> <startDate>		Дата начала периода, за который определяется среднее значение цены базового актива	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Окончание периода наблюдения <schedule> <endDate>		Дата окончания периода, за который определяется среднее значение цены базового актива	mfr	
Периодичность расчетного периода <averagingPeriod Frequency>	Мультипликатор периода <periodMultiplier>	Мультипликатор периода времени	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
	Период времени <period>	Тип периода времени, соответствующий периоду, за который определяется среднее значение цены базового актива	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodExtendedEnum

16.9.1.3 Период усреднения цены базового актива. График наблюдений

Заполняется аналогично п. 16.8.1.2, если указан метод усреднения цены “Out” (при этом «Период усреднения цены страйка» не заполняется) или “Both”.

16.9.2 Условия барьерного опциона

16.9.2.1 Параметры отлагательного условия

16.9.2.1.1 Параметры триггерного условия.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Пороговый уровень <level>	Барьерная цена, с достижением которой стороны связали возникновение у покупателя опциона права требовать от продавца исполнения договора (отлагательное условие, knock-in)	mfr	Положительное десятичное число
Тип порогового уровня <triggerType>	Условие достижения барьерной цены (значение рыночной цены по отношению к барьерной цене): “EqualOrLess», “EqualOrGreater”, “Equal”, “Less”, “Greater”	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleTriggerTypeEnum

16.9.2.1.2 Выплата по бинарному опциону

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик	Сторона-плательщик выплаты по	mfr	Party1; Party2

<payerPartyReference>	бинарному опциону		
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-получатель выплаты по бинарному опциону	mfr	
Сумма платежа <featurePayment> <amount>	Сумма платежа по бинарному опциону	mfr	Положительное десятичное число
Валюта суммы <featurePayment> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма платежа по бинарному опциону.	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

16.9.2.2 Параметры отменительного условия

16.9.2.2.1 Параметры триггерного условия

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Пороговый уровень <level>	Барьерная цена, с достижением которой опцион прекращает действовать (отменительное условие, knock-out)	mfr	Положительное десятичное число
Тип порогового уровня <triggerType>	Условие достижения барьерной цены (значение рыночной цены по отношению к барьерной цене): “EqualOrLess», “EqualOrGreater”, “Equal”, “Less”, “Greater”	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleTriggerTypeEnum

16.9.2.2.2 Выплата по бинарному опциону

Заполняется аналогично п. 16.8.2.1.2.

16.10 Цена исполнения

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Цена исполнения <strikePrice>	<p>Цена исполнения за одну акцию (корзину акций).</p> <p>Если цена исполнения по условиям договора определяется на будущую дату, указывается либо рыночная цена, либо цена, определенная иным образом на дату заключения договора. При этом, не позднее трех рабочих дней с даты определения цены, следует предоставить в Репозиторий информацию об изменении соответствующего договора.</p> <p><i>В случае барьерного условия может заполняться цена, относительно которой рассчитывается в моменте барьер на дату заключения сделки (текущая рыночная цена, если не оговорено иное).</i></p>	mfr	Положительное десятичное число
Валюта <strike> <currency>	Валюта, в которой выражена цена исполнения	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

Цена исполнения <strikePercentage>	Цена исполнения в процентном отношении (применяется для опционов на фондовый индекс)	mfr	Положительное десятичное число
--	--	-----	--------------------------------

16.11 Цена спот

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Цена спот <spotPrice>	Рыночная цена за единицу базового актива в дату заключения договора. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Положительное десятичное число

16.12 Количество опционов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Количество опционов <numberOfOptions>	Количество опционов, в отношении которого заключен договор	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

16.13 Объем опциона

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Объем опциона <optionEntitlement>	Количество базового актива (акций/корзин) в одном опционе	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

16.14 Премия опциона

16.14.1 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона-покупатель опциона	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-продавец опциона	mfr	

16.14.2 Сумма платежа

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <paymentAmount> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма премии	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <paymentAmount> <amount>	Совокупная сумма премии по договору	mfr	Положительное десятичное число

17. Анкета свопа дохода на облигацию (CM061)

17.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником “ProductType”: [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdru\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdru)). Допустимые значения:

Значение	Описание
InterestRate:Swap:BondSwap:SingleName	Своп на облигацию
InterestRate:Swap:BondSwap:SingleIndex	Своп на индекс облигаций

InterestRate:Swap:BondSwap:Basket	Своп на корзину облигаций
-----------------------------------	---------------------------

17.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

17.3 Описание покупателя и продавца

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-покупатель инструмента <buyerPartyReference>	Сторона-покупатель по договору. Если покупатель не определен в условиях сделки, указывается Сторона-плательщик сумм, привязанных к доходности базового актива (покупатель защиты)	mfr	Party1; Party2
Сторона-продавец инструмента <sellerPartyReference>	Сторона-продавец по договору (продавец защиты)	mfr	

17.4 Выбор типа потока сумм

Параметры платежей по свопу. В Анкете свопа дохода на облигации используются варианты выбора «Суммы фиксированного дохода» (<interestLeg>) и «Суммы дохода от облигации» (<bondReturnLeg>). Вариант выбора «Суммы дохода от актива» в этом случае *не применим*.

Для целей отчетности в Репозиторий первыми указываются обязательства Стороны 1, вторыми – обязательства Стороны 2. Например, первыми определяются платежи Стороны 1, привязанные к доходности базового актива (<bondReturnLeg>), вторыми – платежи Стороны 2, привязанные к заданной процентной ставке (<interestLeg>).

17.4.1 Вариант выбора «Суммы фиксированного дохода»

Параметры платежей, привязанных к процентной ставке.

17.4.1.1 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона-плательщик платежей, привязанных к процентной ставке	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-получатель платежей, привязанных к процентной ставке	mfr	

17.4.1.2 Даты расчетных периодов процентного потока

17.4.1.2.1 Даты изменения плавающей ставки / Периодичность дат изменения плавающей ставки

Не используется.

17.4.1.2.2 Даты платежа

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Даты <interestLegPaymentDates> <unadjustedDate>	Дата платежа по данной части свопа (повторяемый элемент)	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

17.4.1.3 Номинальная сумма

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы	Валюта номинальной суммы	mfr	Значение из

<nominalAmount> <currency>			справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <nominalAmount> <amount>	Совокупная номинальная сумма по договору	mfr	Положительное десятичное число

17.4.1.4 Расчет процентной суммы

17.4.1.4.1 Выбор типа процентной ставки

Вариант выбора «Расчет плавающей ставки»

Элемент		Описание	Сверка	Формат заполнения
Индекс плавающей ставки <floatingRateIndex>		Индекс плавающей ставки. Если значение индекса отсутствует в справочнике, указывается «Прочее» (Other)	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/floating-rate-index(nsdrus)
Период плавающей ставки <indexTenor>	Мультипликатор периода <periodMultiplier>	Мультипликатор, определяющий период плавающей ставки	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
	Тип временного периода <period>	Тип периода плавающей ставки. Например, мультипликатор «3» и период «М» означают, что используется трехмесячная ставка	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodEnum
График множителя плавающей ставки – Начальное значение <floatingRateMultiplierSchedule> <initialValue>		Значение множителя, применимого к плавающей ставке. Если предусмотрено несколько значений множителя, указывается его начальное значение, а в блоке «Шаг изменений» определяется график значений. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки (значение не равно «1»).</i>	mfr	Положительное десятичное число
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения множителя плавающей ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение множителя, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Положительное десятичное число
График спреда плавающей ставки – Начальное значение <spreadSchedule> <initialValue>		Значение спреда, применимого к плавающей ставке. Может принимать положительные и отрицательные значения. Если условиями предусмотрено несколько значений ставки спреда, указывается ее начальное значение, а в блоке «Шаг изменений» определяется график значений. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки (значение не равно «0»).</i>	mfr	Десятичное число. Например, 10 базисных пунктов или 0,1% представляется как 0.001

Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения ставки спреда. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение ставки спреда, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Десятичное число. Например, 0.001
График максимума ставки – Начальное значение <capRateSchedule> <initialValue>		Значение максимума плавающей ставки. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения максимума ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение максимума ставки, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
График минимума ставки – Начальное значение <floorRateSchedule> <initialValue>		Значение минимума плавающей ставки. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения минимума ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Очередное значение минимума ставки, если условиями сделки предусмотрен график изменения минимума ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
Начальное значение ставки <initialRate>		Начальное значение плавающей ставки на дату заключения договора	mfr	Десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05

Вариант выбора «Фиксированная ставка»

Элемент		Описание	Сверка	Формат заполнения
Фиксированная ставка <fixedRate>		Значение фиксированной ставки	mfr	Десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения фиксированной ставки.	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение фиксированной ставки, действующее с указанной даты.	mfr	Десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Коэффициент для расчета дней в процентном периоде <dayCountFraction>	Коэффициент для расчета дней в процентном периоде	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/day-count-fraction(fpmlrus)

17.4.2 Вариант выбора «Суммы дохода от облигации»

Параметры платежей, привязанных к доходности базового актива.

17.4.2.1 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона-плательщик платежей, привязанных к доходности базового актива	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-получатель платежей, привязанных к доходности базового актива	mfr	

17.4.2.2 Дата начала срока форвардного потока

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата <strikeDate> <unadjustedDate>	Дата начала срока форвардного (отложенного) свопа. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

17.4.2.3 Базовый актив

Параметры единичного базового актива (долгового инструмента или индекса) либо корзины активов (корзины облигаций или корзины индексов).

17.4.2.3.1 Вариант выбора «Единичный базовый актив»

Параметры единичного базового актива – долгового финансового инструмента или индекса (<singleUnderlyer>). Варианты выбора «Корзина базовых активов», «Товарный актив», «Акция» в этом случае *не применимы*.

17.4.2.3.1.1 Базовый актив

Вариант выбора «Облигация»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Для ценных бумаг указывается код ISIN или иной депозитарный код ценной бумаги (при отсутствии ISIN), а при отсутствии последнего – код ценной бумаги в системе Bloomberg	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JREQ7
Наименование актива <description>	Полное наименование базового актива. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка

Вариант выбора «Индекс»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Идентификатор (код) индекса	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JREQ7
Наименование актива <description>	Полное наименование индекса. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка

	<i>элемент.</i>		
--	-----------------	--	--

17.4.2.3.1.2 Лот актива

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Лот актива <singleUnderlyer> <openUnits>	Количество базового актива (облигаций) по договору. В случае свопа на индекс указывается значение «1», если иное не определено условиями сделки	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

17.4.2.3.2 Вариант выбора «Корзина базовых активов»

Параметры базового актива в виде корзины долговых финансовых инструментов или корзины индексов (<basket>).

17.4.2.3.2.1 Число единиц активов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Число единиц активов <basket > <openUnits>	Количество корзин по договору	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

17.4.2.3.2.2 Компонент корзины

Параметры активов, входящих в корзину. Данный блок является повторяемым, заполняется для каждого уникального элемента корзины.

Варианты выбора «Корзина базовых активов», «Товарный актив», «Акция» *не применимы.*

17.4.2.3.2.2.1 Базовый актив

Вариант выбора «Облигация»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Для ценных бумаг указывается код ISIN. В случае отсутствия кода ISIN – иной депозитарный код, номер государственной регистрации или код в системе Bloomberg, при этом «Наименование актива» указывается обязательно	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JREQ7.
Наименование актива <description>	Полное наименование базового актива. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка

17.4.2.3.2.2.2 Вес элемента. Выбор типа весового коэффициента

Вес активов, входящих в корзину. В зависимости от того, как выражается данный параметр, используется один из вариантов выбора: «Количество единиц базового актива» или «Вес компонента корзины в процентах». Вариант выбора «Вес компонента корзины в денежном выражении» не используется.

Вариант выбора «Количество единиц базового актива»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Количество единиц базового актива <constituentWeight> <openUnits>	Количество указанного актива (облигаций) в корзине	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

Вариант выбора «Вес компонента корзины в процентах»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Вес компонента корзины в процентах	Вес указанного актива (индекса) в корзине, выраженный в виде	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5%

<basketPercentage>	десятичной дроби		представляется как 0.05
--------------------	------------------	--	-------------------------

17.4.2.4 Оценка потока доходов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата <paymentDates> <unadjustedDate>	Дата(-ы) платежа по данной части свопа (повторяемый элемент)	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

17.4.2.5 Номинальная сумма

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <nominalAmount> <currency>	Валюта номинальной суммы	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма <nominalAmount> <amount>	Совокупная номинальная сумма (объем договора). В случае свопа на облигацию (корзину облигаций) определяется как произведение количества облигаций (корзин) и номинальной стоимости одной облигации (корзины облигаций). В случае свопа на индекс облигаций определяется как произведение значения индекса на дату заключения договора в индексных пунктах на мультипликатор индекса (стоимости 1 пункта индекса в соответствии со спецификацией) либо стоимость договора на дату его заключения в соответствии с данными бухгалтерского учета.	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000

17.4.2.6 Тип дохода

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Тип дохода <return>	Тип дохода: “Interest” (купонный доход), “Price” (изменение цены), “Total” (совокупный доход)	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleBondReturnType

17.5 Платеж основной суммы

Не используется.

17.6 Дополнительный платеж

Не используется.

18. Анкета свопа дохода на акцию (CM062)

18.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником “ProductType”: [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdus\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdus)). Допустимые значения:

Значение	Описание
Equity:Swap:PriceReturnBasicPerformance:SingleName	Своп на акцию
Equity:Swap:PriceReturnBasicPerformance:SingleIndex	Своп на индекс акций

Equity:Swap:PriceReturnBasicPerformance:Basket	Своп на корзину акций
--	-----------------------

18.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

18.3 Описание покупателя и продавца

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-покупатель инструмента <buyerPartyReference>	Сторона-покупатель по договору. Если покупатель не определен в условиях сделки, указывается Сторона-плательщик сумм, привязанных к доходности базового актива (покупатель защиты)	mfr	Party1; Party2
Сторона-продавец инструмента <sellerPartyReference>	Сторона-продавец по договору (продавец защиты)	mfr	

18.4 Выбор типа потока сумм

Параметры платежей по свопу. В Анкете свопа дохода на акцию используются варианты выбора «Суммы фиксированного дохода» (<interestLeg>) и «Суммы дохода от актива» (<returnLeg>). Вариант выбора «Суммы дохода от облигации» в этом случае *не применим*.

Для целей отчетности в Репозиторий первыми указываются обязательства Стороны 1, вторыми – обязательства Стороны 2. Например, первыми определяются платежи Стороны 1, привязанные к доходности базового актива (<returnLeg>), вторыми – платежи Стороны 2, привязанные к заданной процентной ставке (<interestLeg>).

18.4.1 Вариант выбора «Суммы фиксированного дохода»

Параметры платежей, привязанных к процентной ставке.

18.4.1.1 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона-плательщик платежей, привязанных к процентной ставке	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-получатель платежей, привязанных к процентной ставке	mfr	

18.4.1.2 Даты расчетных периодов процентного потока

18.4.1.2.1 Даты изменения плавающей ставки / Периодичность дат изменения плавающей ставки

Не используется.

18.4.1.2.2 Даты платежа

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Даты платежа <interestLegPaymentDates> <unadjustedDate>	Дата платежа по данной части свопа (повторяемый элемент) <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

18.4.1.3 Номинальная сумма

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
---------	----------	--------	-------------------

Валюта суммы <nominalAmount> <currency>	Валюта номинальной суммы	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <nominalAmount> <amount>	Совокупная номинальная сумма	mfr	Положительное десятичное число

18.4.1.4 Расчет процентной суммы

18.4.1.4.1 Выбор типа процентной ставки

Вариант выбора «Расчет плавающей ставки»

Элемент		Описание	Сверка	Формат заполнения
Индекс плавающей ставки <floatingRateIndex>		Индекс плавающей ставки. Если значение индекса отсутствует в справочнике, указывается «Прочее» (Other)	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/floating-rate-index(nsdru)
Период плавающей ставки <indexTenor>	Мультипликатор периода <periodMultiplier>	Мультипликатор, определяющий период плавающей ставки	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
	Тип временного периода <period>	Тип периода плавающей ставки. Например, мультипликатор «3» и период «М» означают, что используется трехмесячная ставка	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodEnum
График множителя плавающей ставки – Начальное значение <floatingRateMultiplierSchedule> <initialValue>		Значение множителя, применимого к плавающей ставке. Если предусмотрено несколько значений множителя, указывается его начальное значение, а в блоке «Шаг изменений» определяется график значений. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки (значение не равно «1»).</i>	mfr	Положительное десятичное число.
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения множителя плавающей ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение множителя, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Положительное десятичное число.
График спреда плавающей ставки – Начальное значение <spreadSchedule> <initialValue>		Значение спреда, применимого к плавающей ставке. Может принимать положительные и отрицательные значения. Если предусмотрено несколько значений ставки спреда, указывается ее начальное значение, а в блоке «Шаг изменений» определяется график значений. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки (значение не равно «0»).</i>	mfr	Десятичное число. Например, 10 базисных пунктов или 0,1% представляется как 0.001

Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения ставки спреда. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение ставки спреда, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Десятичное число. Например, 0.001
График максимума ставки – Начальное значение <capRateSchedule> <initialValue>		Значение максимума плавающей ставки. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения максимума ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение максимума ставки, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
График минимума ставки – Начальное значение <floorRateSchedule> <initialValue>		Значение минимума плавающей ставки. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения минимума ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение минимума ставки, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
Начальное значение ставки <initialRate>		Начальное значение плавающей ставки на дату заключения договора	mfr	Десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05

Вариант выбора «Фиксированная ставка»

Элемент		Описание	Сверка	Формат заполнения
Фиксированная ставка <fixedRate>		Значение фиксированной ставки	mfr	Десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения фиксированной ставки.	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение фиксированной ставки, действующее с указанной даты.	mfr	Десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Коэффициент для расчета дней в процентном периоде <dayCountFraction>	Коэффициент для расчета дней в процентном периоде	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/day-count-fraction(fpmlrus)

18.4.2 Вариант выбора «Суммы дохода от актива»

Параметры платежей, привязанных к доходности базового актива.

18.4.2.1 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона-плательщик платежей, привязанных к доходности базового актива	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-получатель платежей, привязанных к доходности базового актива	mfr	

18.4.2.2 Дата начала срока форвардного потока

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата <strikeDate> <unadjustedDate>	Дата начала срока форвардного (отложенного) свопа. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

18.4.2.3 Базовый актив

Параметры единичного базового актива (акции, индекса акций) либо корзины активов (корзины акций или корзины индексов акций).

18.4.2.3.1 Вариант выбора «Единичный базовый актив»

Параметры единичного базового актива – акции или индекса акций. Варианты выбора «Корзина базовых активов», «Товарный актив», «Облигация» в этом случае *не применимы*.

18.4.2.3.1.1 Базовый актив

Вариант выбора «Акция»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Для ценных бумаг указывается код ISIN. В случае отсутствия кода ISIN – иной депозитарный код, номер государственной регистрации или код в системе Bloomberg, при этом «Наименование актива» указывается обязательно	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JR4A1
Наименование актива <description>	Полное наименование базового актива. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка

Вариант выбора «Индекс»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
---------	----------	--------	-------------------

Идентификатор базового актива <instrumentId>	Идентификатор (код) индекса	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JREQ7
Наименование актива <description>	Полное наименование индекса. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка

18.4.2.3.1.2 Лот актива

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Лот актива <singleUnderlyer> <openUnits>	Количество базового актива по договору	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

18.4.2.3.2 Вариант выбора «Корзина базовых активов»

Параметры базового актива в виде корзины акций или корзины индексов акций.

18.4.2.3.2.1 Лот актива

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Число единиц активов <basket> <openUnits>	Количество корзин по договору	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

18.4.2.3.2.2 Компонент корзины

Параметры активов, входящих в корзину. Данный блок является повторяемым, заполняется для каждого уникального элемента корзины.

Варианты выбора «Корзина базовых активов», «Товарный актив», «Облигация» *не применимы*.

18.4.2.3.2.2.1 Базовый актив

Вариант выбора «Акция»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Для ценных бумаг указывается код ISIN или иной депозитарный код ценной бумаги (при отсутствии ISIN), а при отсутствии последнего – код ценной бумаги в системе Bloomberg	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JR4A1.
Наименование актива <description>	Полное наименование базового актива. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка

18.4.2.3.2.2.2 Вес элемента. Выбор типа весового коэффициента

Вес активов, входящих в корзину. В зависимости от того, как выражается данный параметр, используется один из вариантов выбора: «Количество единиц базового актива» или «Вес компонента корзины в процентах». Вариант выбора «Вес компонента корзины в денежном выражении» не используется.

Вариант выбора «Количество единиц базового актива».

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Количество единиц базового актива <constituentWeight> <openUnits>	Количество указанного актива (акции) в корзине	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

Вариант выбора «Вес компонента корзины в процентах»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
---------	----------	--------	-------------------

Вес компонента корзины в процентах <basketPercentage>	Вес указанного актива (индекса) в корзине, выраженный в виде десятичной дроби	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
---	---	-----	---

18.4.2.4 Оценка потока доходов

18.4.2.4.1 Первоначальная цена¹²

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <initialPrice> <netPrice> <currency>	Валюта, в которой выражена цена базового актива	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма <initialPrice> <netPrice> <amount>	Первоначальная цена базового актива на дату заключения договора	mfr	Положительное десятичное число

18.4.2.4.2 Окончательная цена

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <valuationPriceFinal> <netPrice> <currency>	Валюта, в которой выражена цена базового актива	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма <valuationPriceFinal> <netPrice> <amount>	Окончательная цена базового актива. При первичной регистрации договора, когда окончательная цена не известна, указывается первоначальная цена	mfr	Положительное десятичное число

18.4.2.4.3 Даты платежа

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Промежуточные даты платежей <paymentDatesInterim> <unadjustedDate>	Даты промежуточных платежей по данной части свопа	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Последняя дата платежа <paymentDateFinal> - <unadjustedDate>	Дата последнего платежа по данной части свопа	mfr	

18.4.2.5 Номинальная сумма

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы	Валюта номинальной суммы	mfr	Значение из справочника

¹² В соответствии со Стандартными условиями первоначальная цена должна быть в Подтверждении ИЛИ иным образом определяться в соответствии с подтверждением ИЛИ согласовываться сторонами.

При наличии в свопе корзины акций или индексов разных валют рекомендуется принять за первоначальную цену корзины совокупность начальных цен каждого элемента корзины, приведенных к единой валюте по курсу Банка России на соответствующую дату. Если курс указан в подтверждении, то исходя из указанного курса.

В корзине акций может быть больше одной акции каждого вида. Тогда для определения цены корзины рекомендуется взять сумму произведений цены каждого элемента корзины на количество акций данного вида в корзине на курс соответствующей валюты к рублю исходя из курса Банка России на соответствующую дату.

<nominalAmount> <currency>			http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <nominalAmount> <amount>	Совокупная номинальная сумма (объем договора)	mfr	Положительное десятичное число

18.4.2.6 Индексированная сумма

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Расчетное исполнение <cashSettlement>	Определяет, применяется ли условие расчетного исполнения. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Флаг да/нет (“true”; “false”)
Тип дохода <return>	Тип дохода: “Dividend” (дивидендный доход), “Price” (изменение цены), “Total” (совокупный доход).	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleReturnTypeEnum
Корректировка <notionalAdjustments>	Условие, регулирующее корректировку количества единиц свопа доходов.	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleNotionalAdjustmentEnum

18.5 Платеж основной суммы

Не используется.

19. Анкета товарного форварда (CM051)

19.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником “ProductType”: [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdru\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdru)). Допустимые значения:

Значение	Описание
Commodity:Forward:Physical	Поставочный форвард на товарный актив
Commodity:Forward:Cash	Расчетный форвард на товарный актив

19.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

19.3 Выбор ценовых параметров товарного форварда - Параметры фиксированной цены

19.3.1 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона-покупатель по договору	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-продавец по договору	mfr	

19.3.2 Фиксированная цена

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Цена	Форвардная цена за единицу базового актива.	mfr	Положительное десятичное число

<price>	Если форвардная цена не определена на дату предоставления информации о договоре в Репозиторий, указывается либо текущая рыночная цена, либо начальное значение базового актива, либо цена, определенная иным образом (например, в соответствии с договором) и согласованную сторонами. При этом не позднее трех рабочих дней с даты определения форвардной цены следует предоставить в Репозиторий информацию об изменении соответствующего договора.		
Валюта цены <priceCurrency>	Валюта, в которой выражена форвардная цена	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is-o4217-2001-08-15(fpmlrus)
Единица измерения цены <priceUnit>	Единица измерения, соответствующая форвардной цене	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/p-rice-quote-units(fpmlrus)

19.3.3 Общая сумма

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <totalPrice> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is-o4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <totalPrice> <amount>	Расчетная номинальная сумма по договору. Определяется как произведение количества базового актива и форвардной цены в единицах валюты. Если форвардная цена не определена на дату предоставления информации о договоре в Репозиторий, используется текущая рыночная цена.	mfr	Положительное десятичное число

19.3.4 Определение даты платежа

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата <paymentDates> <unadjustedDate>	Дата расчетов по договору	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

19.4 Выбор части товарной сделки

19.4.1 Вариант выбора «Поставочная часть товарной сделки»

19.4.1.1 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
---------	----------	--------	-------------------

Сторона-платательщик <payerPartyReference>	Сторона, которая поставляет базовый актив (продавец форварда)	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона, которая оплачивает базовый актива (покупатель форварда)	mfr	

19.4.1.2 Товар

Параметры базового актива. Если базовым активом является корзина товаров, блок повторяется для каждого уникального элемента корзины.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Код базового актива в соответствии со справочником	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/verified/current/taxonomy/commodity-instrument-id(nsdru)
Наименование актива <description>	Полное наименование базового актива (например, вид драгоценного металла, сорт нефти, код фьючерса)	afr	Символьная строка.
Единица измерения <unit>	Единица измерения, соответствующая публикуемой цене базового актива	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/verified/current/taxonomy/price-quote-units(fpmlrus)
Валюта товарного актива <currency>	Валюта, в которой выражена публикуемая цена базового актива	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/verified/current/taxonomy/is-o4217-2001-08-15(fpmlrus)

«Выбор источника публикации цены товарного актива» не используется.

19.4.1.3 Периоды поставки

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата <periods> <unadjustedDate>	Дата поставки базового актива	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

19.4.1.4 Поставляемое количество актива

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Единица измерения <totalPhysicalQuantity> <quantityUnit>	Единица измерения, соответствующая количеству базового актива	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/verified/current/taxonomy/price-quote-units(fpmlrus)
Количество <totalPhysicalQuantity> <quantity>	Количество базового актива по договору	mfr	Положительное десятичное число

19.4.1.5 Конверсионный фактор

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Конверсионный фактор <conversionFactor>	Коэффициент, используемый для конвертации единиц измерения, соответствующих цене базового актива, в единицы измерения, соответствующие количеству базового актива (в случае если они не совпадают). Значение по умолчанию	afr	Положительное десятичное число

	- «1». <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>		
--	---	--	--

19.4.2 Вариант выбора «Товарная часть расчетного форварда»

19.4.2.1 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона-продавец форварда	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-покупатель форварда	mfr	

19.4.2.2 Товар

Параметры базового актива. Заполняется аналогично п. 19.4.1.2.

19.4.2.3 Указания номинального количества

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Общее номинальное количество <totalNotionalQuantity>	Количество базового актива по договору. Если базовым активом является индекс, указывается значение «1»	mfr	Положительное десятичное число.

19.4.2.4 Расчет плавающей цены

Не используется.

19.4.2.5 Определение даты платежа

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата <paymentDates> <unadjustedDate>	Дата(-ы) платежа по договору	mfr	YYYY-MM-DD

20. Анкета товарного опциона (CM052)

20.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником “ProductType”: [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdru\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdru)). Допустимые значения:

Значение	Описание
Commodity:Option:American	Товарный опцион американский
Commodity:Option:European	Товарный опцион европейский
Commodity:Option:Asian	Товарный опцион азиатский
Commodity:Option:Weather:American	Американский погодный опцион
Commodity:Option:Weather:European	Европейский погодный опцион

20.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

20.3 Описание покупателя и продавца

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-покупатель инструмента	Сторона-покупатель опциона	mfr	Party1; Party2

<buyerPartyReference>			
Сторона-продавец инструмента <sellerPartyReference>	Сторона-продавец опциона	mfr	

20.4 Выбор типа опциона

20.4.1 Вариант выбора «Товарный опцион»

20.4.1.1 Товарный актив

Параметры базового актива. Если базовым активом является корзина товаров, блок повторяется для каждого уникального элемента корзины.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Код базового актива в соответствии со справочником	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/commodity-instrument-id(nsdru)
Наименование актива <description>	Полное наименование базового актива (например, вид драгоценного металла, сорт нефти, код фьючерса)	afr	Символьная строка
Единица измерения <unit>	Единица измерения, соответствующая публикуемой цене базового актива	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/price-quote-units(fpmlrus)
Валюта товарного актива <currency>	Валюта, в которой выражена публикуемая цена базового актива	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is-o4217-2001-08-15(fpmlrus)

«Выбор источника публикации цены товарного актива» не используется.

20.4.1.2 Выбор способа определения расчетных периодов

Для азиатского опциона указывается период, за который определяется средняя цена базисного актива опциона (если условиями азиатского опциона предусмотрены дискретные даты, за которые определяется средняя цена, указываются первая и последняя даты).

Вариант выбора «Расписание расчетных периодов»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Мультипликатор периода <calculationPeriodsSchedule> <periodMultiplier>	Мультипликатор периода времени	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
Период времени <calculationPeriodsSchedule> <period>	Тип периода времени, соответствующий периодичности определения средней цены для азиатского опциона	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodExtendedEnum

Вариант выбора «Расчетные периоды»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата <calculationPeriods> <unadjustedDate>	Даты, за которые определяется среднее значение цены базового актива (повторяемый элемент)	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

20.4.1.3 Указания номинального количества

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Общее номинальное количество <totalNotionalQuantity>	Совокупное количество базового актива по договору. Если договор состоит из нескольких опционов, определяется как произведение количества опционов и количества базового актива в одном опционе. Если базовым активом является индекс, количество базового актива в одном опционе равно «1»	mfr	Положительное десятичное число

20.4.1.4 Выбор стиля исполнения опциона

Вариант выбора «Американский стиль исполнения»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Начальная дата <commencementDate> <unadjusted date>	Дата начала срока осуществления права на исполнение опциона. Если начальная дата явным образом не определена, указывается дата заключения сделки	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Дата истечения <expirationDate> <unadjustedDate>	Дата окончания срока осуществления права на исполнение опциона	mfr	

Вариант выбора «Европейский стиль исполнения»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата экспирации <expirationDate>	Дата исполнения европейского опциона. В случае бермудского опциона указывается несколько дат (повторяемый элемент)	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

20.4.1.5 Валюта расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта расчетов <settlementCurrency>	Валюта расчетов по договору	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

20.4.1.6 Определение даты платежа

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата <paymentDates> <unadjustedDate>	Дата платежа по договору	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

20.4.1.7 Определение цены страйк

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <strikePricePerUnit> <currency>	Валюта, в которой выражена цена исполнения	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств	Цена исполнения за единицу базового актива.	mfr	Положительное десятичное число

<strikePricePerUnit> <amount>	<p>Если цена исполнения по условиям договора определяется на будущую дату, указывается либо рыночная цена, либо цена, определенная иным образом на дату заключения договора. При этом, не позднее трех рабочих дней с даты определения цены, следует предоставить в Репозиторий информацию об изменении соответствующего договора.</p> <p><i>В случае барьерного условия может заполняться цена, относительно которой рассчитывается в моменте барьер на дату заключения сделки (текущая рыночная цена, если не оговорено иное).</i></p>		
--	--	--	--

20.4.2 Вариант выбора «Погодный опцион»

20.4.2.1 Расчетные периоды погодного контракта

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Первый день расчетного периода <calculationPeriodFirstDay>	Первый день расчетного периода погодного контракта. Если существует только один расчетный период, то его первый день соответствует дате начала срока	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Последний день расчетного периода <calculationPeriodEndDay>	Последний день расчетного периода погодного контракта. Если существует только один расчетный период, то его последний день соответствует дате истечения срока договора	mfr	

20.4.2.2 Номинальная сумма погодного контракта

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <weatherNotionalAmount> <currency>	Валюта, в которой выражена цена	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is-o4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <weatherNotionalAmount> <amount>	Цена за единицу измерения погодного индекса	mfr	Положительное десятичное число

20.4.2.3 Выбор стиля исполнения опциона

Заполняется аналогично п. 20.4.1.4.

20.4.2.4 Валюта расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта расчетов <settlementCurrency>	Валюта расчетов по договору	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is-o4217-2001-08-15(fpmlrus)

20.4.2.5 Определение даты платежа

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата <paymentDates> <unadjustedDate>	Дата (-ы) платежа по договору	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

20.4.2.6 Уровень страйк погодного индекса

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Количество пунктов <weatherIndexStrikeLevel> <quantity>	Цена исполнения погодного опциона (количество пунктов погодного индекса)	mfr	Десятичное число.
Пункт индекса <weatherIndexStrikeLevel> <unit>	Единица измерения погодного индекса	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/price-quote-units(fpmlrus)

20.5 Премия опциона

20.5.1 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона-покупатель опциона	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-продавец опциона	mfr	

20.5.2 Сумма платежа

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <paymentAmount> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма премии	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is04217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <paymentAmount> <amount>	Совокупная сумма премии по договору	mfr	Положительное десятичное число

20.6 Дополнительные характеристики

Параметры азиатского и/или барьерного (в т. ч. бинарного) опциона. Заполняется обязательно, если перечисленные ниже параметры содержатся в условиях сделки.

20.6.1 Параметры азиатского опциона

20.6.1.1 Метод усреднения цены

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Метод усреднения цены <averagingInOut>	Метод усреднения цены, используемый для азиатского опциона. “In” означает, что цена страйк определяется как среднее значение цены базового актива на спот-рынке за указанный период (опцион с азиатским страйком). “Out” означает, что цена базового актива при экспирации опциона определяется как среднее значение цены базового актива на спот-рынке за	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleAveragingInOutEnum

	указанный период (опцион с азиатской ценой). “Both” означает опцион с азиатским страйком и азиатской ценой.		
--	--	--	--

20.6.1.2 Период усреднения цены страйка. График наблюдений

Для азиатского опциона указывается период, за который определяется средняя цена базисного актива опциона (если условиями азиатского опциона предусмотрены дискретные даты, за которые определяется средняя цена, указываются первая и последняя даты).

Заполняется, если указан метод усреднения цены “In” (при этом «Период усреднения цены базового актива» не заполняется) или “Both”.

Элемент		Описание	Сверка	Формат заполнения
Начало периода наблюдения <schedule> <startDate>		Дата начала периода, за который определяется среднее значение цены базового актива	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Окончание периода наблюдения <schedule> <endDate>		Дата окончания периода, за который определяется среднее значение цены базового актива	mfr	
Периодичность расчетного периода <averagingPeriod Frequency>	Мультипликатор периода <periodMultiplier>	Мультипликатор периода времени	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
	Период времени <period>	Тип периода времени, соответствующий периоду, за который определяется среднее значение цены базового актива	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodExtendedEnum

20.6.1.3 Период усреднения цены базового актива. График наблюдений

Заполняется аналогично п. 16.8.1.2, если указан метод усреднения цены “Out” (при этом «Период усреднения цены страйка» не заполняется) или «Both».

20.6.2 Условия барьерного опциона

20.6.2.1 Параметры отлагательного условия

20.6.2.1.1 Параметры триггерного условия

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Пороговый уровень <level>	Барьерная цена, с достижением которой стороны связали возникновение у покупателя опциона права требовать от продавца исполнения договора (отлагательное условие, knock-in)	mfr	Положительное десятичное число
Тип порогового уровня <triggerType>	Условие достижения барьерной цены (значение рыночной цены по отношению к барьерной цене): “EqualOrLess», “EqualOrGreater”, “Equal”, “Less”, “Greater”	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleTriggerTypeEnum

20.6.2.1.2 Выплата по бинарному опциону

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик	Сторона-плательщик выплаты по бинарному опциону	mfr	Party1; Party2

<payerPartyReference>			
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-получатель выплаты по бинарному опциону	mfr	
Сумма платежа <featurePayment> <amount>	Сумма платежа по бинарному опциону	mfr	Положительное десятичное число
Валюта суммы <featurePayment> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма платежа по бинарному опциону	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

20.6.2.2 Параметры отменительного условия

20.6.2.2.1 Параметры триггерного условия

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Пороговый уровень <level>	Барьерная цена, с достижением которой опцион прекращает действовать (отменительное условие, knock-out)	mfr	Положительное десятичное число
Тип порогового уровня <triggerType>	Условие достижения барьерной цены (значение рыночной цены по отношению к барьерной цене): “EqualOrLess», “EqualOrGreater”, “Equal”, “Less”, “Greater”	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleTriggerTypeEnum

20.6.2.2.2 Выплата по бинарному опциону

Заполняется аналогично п. 16.8.2.1.2.

21. Анкета товарного свопа (CM053)

21.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником “ProductType”: [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdus\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdus)). Допустимые значения:

Значение	Описание
Commodity:Swap:Cash	Расчетный товарный своп
Commodity:Swap:Physical	Поставочный товарный своп
Commodity:Swap:Cash:Weather	Расчетный погодный своп

21.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

21.3 Дата начала срока

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата <effectiveDate> <unadjustedDate>	Дата начала срока по договору	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

21.4 Дата окончания срока

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
---------	----------	--------	-------------------

Дата <terminationDate> <unadjustedDate>	Дата истечения срока по договору	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
---	----------------------------------	-----	------------

21.5 Валюта расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта расчетов <settlementCurrency>	Валюта расчетов по договору	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is04217-2001-08-15(fpmlrus)

21.6 Выбор части сделки

Для целей отчетности в Репозиторий первыми определяются обязательства Стороны 1, вторыми – обязательства Стороны 2. Например, первыми определяются обязательства Стороны 1 по уплате сумм, рассчитанных на основе номинального количества товара и плавающей цены (<floatingLegNsd>), вторыми – обязательства Стороны 2 по уплате сумм, рассчитанных на основе номинального количества товара и фиксированной цены (<fixedLeg>).

В случае расчетного товарного свопа используются варианты выбора «Часть сделки с фиксированной ценой» (<fixedLeg>) и «Часть сделки с плавающей ценой» (<floatingLegNsd>). В случае поставочного свопа для одной из частей сделки используется вариант выбора «Поставочная часть товарной сделки» (<commoditySwapPhysicalLeg>), для другой – варианты выбора «Часть сделки с фиксированной ценой» (<fixedLeg>) или «Часть сделки с плавающей ценой» (<floatingLegNsd>).

21.6.1 Вариант выбора «Товарная часть контракта своп»

21.6.1.1 Вариант выбора «Часть сделки с фиксированной ценой»

21.6.1.1.1 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона-плательщик по данной части договора	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-получатель по данной части договора	mfr	

21.6.1.1.2 Выбор способа указания расчетных периодов

Вариант выбора «Расчетные даты».

Не используется.

Вариант выбора «График расчетных периодов»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Мультипликатор периода <calculationPeriodsSchedule> <periodMultiplier>	Мультипликатор периода времени	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
Период времени <calculationPeriodsSchedule> <period>	Тип периода времени, соответствующий периодичности расчетных периодов (периодичности переоценки) для данной части сделки своп	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodExtendedEnum

21.6.1.1.3 Выбор метода определения фиксированной цены

Не используется.

21.6.1.1.4 Итоговая цена

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <totalPrice> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <totalPrice> <amount>	Общая сумма фиксированных платежей по договору (номинальная сумма сделки)	mfr	Положительное десятичное число

21.6.1.1.5 Указания номинального количества

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Общее номинальное количество <totalNotionalQuantity>	Совокупное количество базового актива по договору. Если базовым активом является индекс, указывается значение «1»	mfr	Положительное десятичное число

21.6.1.1.6 Определение даты платежа

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата <paymentDates> <unadjustedDate>	Дата (-ы) платежа по данной части договора	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

21.6.1.2 Вариант выбора «Поставочная часть товарной сделки»

21.6.1.2.1 Товар

Параметры базового актива. Если базовым активом является корзина товаров, блок повторяется для каждого уникального элемента корзины.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Код базового актива в соответствии со справочником	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/commodity-instrument-id(nsdruis)
Наименование актива <description>	Полное наименование базового актива (например, вид драгоценного металла, сорт нефти, код фьючерса)	afr	Символьная строка
Единица измерения <unit>	Единица измерения, соответствующая публикуемой цене базового актива	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/price-quote-units(fpmlrus)
Валюта товарного актива <currency>	Валюта, в которой выражена публикуемая цена базового актива	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

«Выбор источника публикации цены товарного актива»

Не используется.

21.6.1.2.2 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона-плательщик по данной части договора	mfr	Party1; Party2

Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-получатель базового актива	mfr	
---	------------------------------------	-----	--

21.6.1.2.3 Периоды поставки

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата <periods> <unadjustedDate>	Дата (-ы) поставки базового актива	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

21.6.1.2.4 Поставляемое количество актива

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Единица измерения <totalPhysicalQuantity> <quantityUnit>	Единица измерения, соответствующая номинальному количеству базового актива	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versions/current/taxonomy/price-quote-units(fpmlrus)
Количество <totalPhysicalQuantity> <quantity>	Совокупное количество базового актива по договору	mfr	Положительное десятичное число

21.6.1.2.5 Конверсионный фактор

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Конверсионный фактор <conversionFactor>	Коэффициент, используемый для конвертации единиц измерения, соответствующих цене, в единицы измерения, соответствующие номинальному количеству (в случае если они не совпадают). Значение по умолчанию - «1». <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Положительное десятичное число

21.6.1.3 Вариант выбора «Часть сделки с плавающей ценой»

21.6.1.3.1 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона-плательщик по данной части договора	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-получатель по данной части договора	mfr	

21.6.1.3.2 Выбор способа указания расчетных периодов

Заполняется аналогично п. 21.6.1.1.2.

21.6.1.3.3 Товар

Заполняется аналогично п. 21.6.1.2.1.

21.6.1.3.4 Указания номинального количества

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Общее номинальное количество <totalNotionalQuantity>	Совокупное количество базового актива по договору. Если базовым активом является индекс, указывается значение «1»	mfr	Положительное десятичное число

21.6.1.3.5 Даты определения цены

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата <pricingDates> <unadjustedDate>	Дата (-ы) установления публикуемой цены, используемой для определения плавающей цены. <i>Не заполняется, если соответствующие даты не указаны в условиях договора.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

21.6.1.3.6 Метод усреднения

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Метод усреднения <averagingMethod>	Метод усреднения в случае применения более чем одной даты определения плавающей цены. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleAveragingMethodEnum

21.6.1.3.7 Конверсионный фактор

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Конверсионный фактор <conversionFactor>	Коэффициент, используемый для конвертации единиц измерения, соответствующих цене базового актива, в единицы измерения, соответствующие количеству базового актива (в случае если они не совпадают). Значение по умолчанию - «1». <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Положительное десятичное число

21.6.1.3.8 Выбор варианта представления спреда

Не используется.

21.6.1.3.9 Определение даты платежа

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата <paymentDates> <unadjustedDate>	Дата (-ы) платежа по данной части договора	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

21.6.1.3.10 Первоначальная цена единицы товарного актива

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Первоначальная цена единицы товарного актива <initialPrice>	Значение цены товара (индекса) в дату заключения договора	mfr	Положительное десятичное число

21.6.1.3.11 Максимальная цена единицы товарного актива

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Максимальная цена единицы товарного актива <capPrice>	Максимальная цена за единицу базового актива в соответствии с условиями сделки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Десятичное число

21.6.1.3.12 Минимальная цена единицы товарного актива

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Минимальная цена единицы товарного актива <floorPrice>	Минимальная цена за единицу базового актива в соответствии с условиями сделки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Десятичное число

21.6.2 Вариант выбора «Поток по сделке погодного свопа»

21.6.2.1 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона-плательщик по данной части договора	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-получатель по данной части договора	mfr	

21.6.2.2 Уровень погодного индекса

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Количество пунктов <quantity>	Базовый уровень погодного индекса, определенный в условиях договора	mfr	Положительное десятичное число
Пункт индекса <unit>	Единица измерения погодного индекса	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/price-quote-units(fpmlrus)

21.6.2.3 Расчетные периоды погодного контракта

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Первый день расчетного периода <calculationPeriodFirstDay>	Первый день расчетного периода погодного контракта	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Последний день расчетного периода <calculationPeriodEndDay>	Последний день расчетного периода погодного контракта	Mfr	

21.6.2.4 Номинальная сумма погодного контракта

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <weatherNotionalAmount> <currency>	Валюта, в которой выражена цена	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма <weatherNotionalAmount> <amount>	Цена за единицу измерения погодного индекса	mfr	Десятичное число.

21.6.2.5 Расчет погодного индекса

Не используется.

21.6.2.6 Даты платежа

Не используется.

22. Анкета товарного свопциона (CM054)

22.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником "ProductType": [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdru\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdru).). Допустимые значения:

Значение	Описание
Commodity:Swaption:American	Американский товарный свопцион
Commodity:Swaption:European	Европейский товарный свопцион

22.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

22.3 Описание покупателя и продавца

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-покупатель инструмента <buyerPartyReference>	Сторона-покупатель по договору	mfr	Party1; Party2
Сторона-продавец инструмента <sellerPartyReference>	Сторона-продавец по договору	Mfr	

22.4 Товарный своп

Заполняется аналогично пп. 21.3 – 21.6 Анкеты товарного свопа.

22.5 Физическое исполнение - Выбор стиля исполнения опциона

Вариант выбора «Американский стиль исполнения»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Первый день периода <commencementDates> <unadjusted date>	Дата начала срока осуществления права на исполнение	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Дата экспирации <expirationDates> <unadjusted date>	Дата истечения срока осуществления права на исполнение	mfr	

Вариант выбора «Европейский стиль исполнения»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Вариант выбора «Дата экспирации» <expirationDate> <unadjusted date>	Дата исполнения европейского опциона	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Вариант выбора «Даты» <expirationDates> <unadjusted date>	Даты осуществления права на исполнение бермудского опциона (повторяемый элемент)	mfr	

22.6 Премия

22.6.1 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона-плательщик премии (покупатель опциона)	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-получатель премии (продавец опциона)	mfr	

22.6.2 Сумма платежа

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <paymentAmount> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма премии	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <paymentAmount> <amount>	Совокупная сумма премии по договору	mfr	Положительное десятичное число

23. Анкета кредитного дефолтного свопа (CM071)

23.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником “ProductType”: [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdus\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdus)). Допустимые значения:

Значение	Описание
Credit:Swap:Index:Cash	Индексный кредитный дефолтный своп
Credit:Swap:SingleName:Cash	Расчетный кредитный дефолтный своп на одно обязательство
Credit:Swap:SingleName:Physical	Поставочный кредитный дефолтный своп на одно обязательство
Credit:Swap:MultipleName:Cash	Расчетный кредитный дефолтный своп на корзину обязательств
Credit:Swap:MultipleName:Physical	Поставочный кредитный дефолтный своп на корзину обязательств

23.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

23.3 Общие условия

23.3.1 Дата начала срока

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата начала срока <effectiveDate> <unadjustedDate>	Дата начала срока по договору	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

23.3.2 Дата истечения срока

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата окончания срока <scheduledTerminationDate> <unadjustedDate>	Дата окончания срока по договору	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

23.3.3 Описание покупателя и продавца

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-покупатель инструмента <buyerPartyReference>	Сторона-покупатель по договору	mfr	Party1; Party2
Сторона-продавец инструмента <sellerPartyReference>	Сторона-продавец по договору	mfr	

23.3.4 Выбор типа референсного обязательства

В зависимости от типа CDS – свопа на обязательства конкретного референсного лица (single name), индексного свопа либо свопа на корзину обязательств – используется один из вариантов выбора: «Информация о референсном лице», «Референсная информация об индексе», «Референсная информация о корзине».

23.3.4.1 Вариант выбора «Информация о референсном лице»

23.3.4.1.1 Референсное лицо

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Наименование юридического лица <entityName>	Наименование референсного (контрольного) лица – эмитента референсного обязательства (в том числе государства) либо иного лица, принимающего данные обязательства	mfr	Символьная строка
Идентификатор юридического лица <entityId>	Идентификатор референсного лица. Указывается международный код идентификации юридического лица (LEI), а в случае его отсутствия – иной код, позволяющий однозначно определить наименование и местоположение референсного лица, на кредитный риск которого приобретается защита	mfr	Символьная строка

23.3.4.1.2 Выбор варианта определения референсного обязательства

Параметры обязательства референсного лица.

Вариант выбора «Референсное обязательство» - Облигация

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Идентификатор базового актива <instrumentId>	Идентификатор референсного обязательства (облигации, заема, иной долговой ценной бумаги). Для ценных бумаг указывается код ISIN. В случае отсутствия кода ISIN – иной депозитарный код, номер государственной регистрации или код в системе Bloomberg, при этом «Наименование актива» указывается обязательно	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JREQ7.
Наименование актива <description>	Полное наименование референсного обязательства. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка

Вариант выбора «Референсное обязательство не включено»

Не используется.

23.3.4.2 Вариант выбора «Референсная информация об индексе»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Название индекса <indexName>	Наименование индекса	mfr	Символьная строка
Идентификатор индекса <indexId>	Идентификатор индекса. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка

23.3.4.3 Вариант выбора «Референсная информация о корзине»

23.3.4.3.1 Референсный пул - Компонент референсного пула

Параметры обязательств, входящих в корзину. Повторяется для каждого уникального элемента корзины.

23.3.4.3.1.1 Выбор типа весового коэффициента

В зависимости от того, как выражается данный параметр, используется один из вариантов выбора: «Количество единиц базового актива» или «Вес компонента корзины в процентах». Вариант выбора «Вес компонента корзины в денежном выражении» не используется.

Вариант выбора «Количество единиц базового актива»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Количество единиц базового актива <openUnits>	Количество указанного элемента в корзине. В случае отсутствия количества, указывается порядковый номер элемента в корзине	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

Вариант выбора «Вес компонента корзины в процентах»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Вес компонента корзины в процентах <basketPercentage>	Вес указанного элемента в корзине, выраженный в виде десятичной дроби	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05

23.3.4.3.1.2 Референсное лицо и обязательство

Заполняется аналогично п. 23.3.4.1.

23.3.4.3.2 Вариант дефолта

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дефолт по N-ному обязательству <nthToDefault>	Количество референсных обязательств в корзине, наступление дефолтов по которым является условием срабатывания свопа. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
Дефолт по M-ному обязательству <mthToDefault>	Определяет наступление дефолта по M-ному референсному обязательству, позволяющее представить учет от N до M дефолтов по референсным обязательствам. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

23.4 Поток платежей

Параметры платежей по кредитному дефолтному свопу. Для описания платежа, уплачиваемого продавцом кредитной защиты покупателю, используется опциональный блок «Первоначальный платеж». Для описания платежей, уплачиваемых покупателем кредитной защиты продавцу, требуется заполнить блок «Единый платеж» и/или «Периодический платеж».

23.4.1 Первоначальный платеж

Необязательные для заполнения элементы.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <initialPayment> <payerPartyReference>	Сторона, осуществляющая платеж, указанная в этом качестве в Подтверждении	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <initialPayment>	Сторона, получающая платеж, указанная в этом качестве в Подтверждении	mfr	

<receiverPartyReference>			
Дата платежа <initialPayment> <adjustablePaymentDate>	Дата платежа	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Скорректированная дата платежа <initialPayment> <adjustedPaymentDate>	Скорректированная дата платежа, если эта дата попадает на день, не являющийся рабочим. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Валюта суммы <initialPayment> <paymentAmount> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма платежа	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма <initialPayment> <paymentAmount> <amount>	Сумма разового платежа	mfr	Положительное десятичное число

23.4.2 Единый платеж

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата платежа <singlePayment> <adjustablePaymentDate>	Дата платежа	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Скорректированная дата платежа <singlePayment> <adjustedPaymentDate>	Скорректированная дата платежа, если эта дата попадает на день, не являющийся рабочим. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Валюта суммы <singlePayment> <fixedAmount> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма платежа	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма <singlePayment> <fixedAmount> <amount>	Сумма разового платежа (премии), уплачиваемого покупателем кредитной защиты продавцу	mfr	Положительное десятичное число

23.4.3 Периодический платеж

23.4.3.1 Периодичность платежей

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Мультипликатор периода <paymentFrequency> <periodMultiplier>	Мультипликатор периода времени	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
Тип временного периода <paymentFrequency> <period>	Тип периода времени, соответствующий периодичности платежей	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodEnd

			<u>um</u>
--	--	--	-----------

23.4.3.2 Дата начала первого периода

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата начала первого периода <firstPeriodStartDate>	Дата начала первого расчетного периода. Может указываться, если не совпадает с датой начала срока. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	ГГГГ-ММ-ДД

23.4.3.3 Первая дата платежа по договору

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Первая дата платежа <firstPaymentDate>	Дата первого платежа. Может указываться при наличии неполного начального расчетного периода. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	ГГГГ-ММ-ДД

23.4.3.4 Последняя регулярная дата платежа по договору

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Последняя регулярная дата платежа <lastRegularPaymentDate>	Дата последнего регулярного платежа. Может указываться при наличии неполного последнего расчетного периода. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	ГГГГ-ММ-ДД

23.4.3.5 Конвенция периодичности дат

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Конвенция периодичности дат <rollConvention>	Конвенция для определения дат окончания расчетных периодов. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleRollConventionEnum

23.4.3.6 Выбор способа определения фиксированной суммы

Вариант выбора «Фиксированная сумма»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <fixedAmount> <currency>	Валюта, в которой выражен платеж	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма <fixedAmount> <amount>	Сумма периодического фиксированного платежа (премии), уплачиваемого покупателем кредитной защиты продавцу, определенная в условиях договора. См. ISDA Credit Derivatives Definitions: “Fixed Amount”	mfr	Положительное десятичное число

Вариант выбора «Расчет фиксированной суммы»

Используется, если сумма периодического платежа не указана явным образом в условиях договора, а вычисляется как произведение расчетной суммы, фиксированной ставки и коэффициента для расчета количества дней в процентном периоде. См. ISDA Credit Derivatives Definitions: “Fixed Rate Payer Calculation Amount”, “Fixed Amount”.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <calculationAmount> <currency>	Валюта, в которой выражена расчетная сумма	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма <calculationAmount> <amount>	Начальное значение расчетной (номинальной) суммы, используемой для определения периодического платежа	mfr	Положительное десятичное число
Очередная дата <stepDate>	Дата, с которой очередное значение расчетной суммы становится действующим (повторяемый элемент)	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Очередное значение <stepValue>	Очередное значение расчетной суммы (повторяемый элемент)	mfr	Положительное десятичное число
Фиксированная ставка <fixedRate>	Значение фиксированной ставки	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
Коэффициент для расчета дней в процентном периоде <dayCountFraction>	Коэффициент для расчета дней в процентном периоде	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/day-count-fraction(fpmlrus)

23.5 Условия защиты

23.5.1 Расчетная сумма

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <calculationAmount> <currency>	Валюта, в которой выражена расчетная сумма	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма <calculationAmount> <amount>	Расчетная (номинальная) сумма. См. ISDA Credit Derivatives Definitions: “Floating Rate Payer Calculation Amount”	mfr	Положительное десятичное число

23.5.2 Кредитные события

Определение события, с наступлением которого стороны связали возникновение у приобретателя кредитной защиты права требовать исполнения договора (обязательно указание одного события).

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Банкротство <bankruptcy>	Флаг да/нет, определяющий, что кредитным событием является банкротство, т.е. референсное лицо было ликвидировано или стало неплатежеспособным	mfr	“true”; “false”
Неплатеж - применимо <failureToPay> <applicable>	Флаг да/нет, определяющий, что кредитным событием является неплатеж, т.е. по истечении определенного периода референсное лицо не осуществляет соответствующие платежи	mfr	“true”; “false”

	(например, пропущен платеж купона)		
Неплатеж основной суммы <failureToPayPrincipal>	Флаг да/нет, определяющий, что кредитным событием является неуплата основной суммы долга. Референсное лицо не осуществляет платеж соответствующей ожидаемой основной суммы или выплачивает фактическую основную сумму, которая меньше, чем ожидаемая	mfr	“true”; “false”
Неплатеж процентной суммы <failureToPayInterest>	Флаг да/нет, определяющий, что кредитным событием является неуплата процентов. Референсное лицо не осуществляет платеж соответствующей ожидаемой процентной суммы или выплачивает фактическую процентной сумму, которая меньше, чем ожидаемая	mfr	“true”; “false”
Дефолт по обязательству <obligationDefault>	Флаг да/нет, определяющий, что кредитным событием является дефолт по обязательствам, т.е. одно или несколько обязательств не были исполнены в срок в результате дефолта по обязательствам или аналогичного дефолту события, повлекшего неисполнение таких обязательств	mfr	“true”; “false”
Ускорение обязательства <obligationAcceleration>	Флаг да/нет, определяющий, что кредитным событием является досрочное наступление срока исполнения обязательства (вследствие возникновения дефолта или иного аналогичного события)	mfr	“true”; “false”
Мораторий на платежи <repudiationMoratorium>	Флаг да/нет, определяющий, что кредитным событием является мораторий на платежи, т.е. референсное лицо оспаривает законность одного или нескольких обязательств либо налагает мораторий, тем самым откладывая платежи по своим обязательствам	mfr	“true”; “false”
Реструктуризация - применимо <Restructuring> <applicable>	Флаг да/нет, определяющий, что кредитным событием является реструктуризация	mfr	“true”; “false”
Понижение кредитных рейтингов <distressedRatingsDowngrade>	Флаг да/нет, определяющий, что кредитным событием является понижением кредитного рейтинга	mfr	“true”; “false”
Продление срока до погашения <maturityExtension>	Флаг да/нет, определяющий, что кредитным событием является продление срока до погашения, т.е. референсное лицо не в состоянии произвести погашение ожидаемой основной суммы	mfr	“true”; “false”
Списание долга <writedown>	Флаг да/нет, определяющий, что кредитным событием является списание долга.	mfr	“true”; “false”
Подразумеваемое списание <impliedWritedown>	Флаг да/нет, определяющий, что кредитным событием является подразумеваемое списание долга	mfr	“true”; “false”

23.6 Выбор способа исполнения

Не используется.

24. Анкета кредитного дефолтного свопциона (CM072)

24.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником "ProductType": [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsd.rus\)](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsd.rus)). Допустимые значения:

Значение	Описание
Credit.SwapOption.American	Американский кредитный свопцион
Credit.SwapOption.European	Европейский кредитный свопцион
Credit.SwapOption.Bermuda	Бермудский кредитный свопцион

24.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

24.3 Описание покупателя и продавца

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-покупатель инструмента <buyerPartyReference>	Сторона-покупатель по договору	mfr	Party1; Party2
Сторона-продавец инструмента <sellerPartyReference>	Сторона-продавец по договору	mfr	

24.4 Тип опциона

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Тип опциона <optionType>	Тип опциона в соответствии со справочником. Для индексных CDS используются значения Payer/Receiver	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleOptionTypeEnum

24.5 Премия

24.5.1 Определение плательщика и получателя

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик <payerPartyReference>	Сторона-плательщик премии (покупатель опциона)	mfr	Party1; Party2
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-получатель премии (продавец опциона)	mfr	

24.5.2 Сумма платежа

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <paymentAmount> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма премии	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма денежных средств <paymentAmount> <amount>	Совокупная сумма премии по договору	mfr	Положительное десятичное число.

24.6 Выбор стиля исполнения

24.6.1 Вариант выбора «Американский стиль исполнения опциона»

24.6.1.1 Начальная дата

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Начальная дата <commencementDate> <unadjusted date>	Дата начала срока осуществления права на исполнение опциона. Если начальная дата явным образом не определена, указывается дата заключения сделки	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

24.6.1.2 Дата истечения

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата истечения <expirationDate> <unadjusted date>	Дата окончания срока осуществления права на исполнение опциона	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

24.6.1.3 Множественное исполнение

Не используется.

24.6.2 Вариант выбора «Бермудский стиль исполнения опциона»

24.6.2.1 Даты исполнения бермудского опциона

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Даты исполнения бермудского опциона <bermudaExerciseDate> <date>	Даты осуществления права на исполнение бермудского опциона (повторяемый элемент)	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

24.6.2.2 Множественное исполнение

Не используется.

24.6.3 Вариант выбора «Европейский стиль исполнения опциона»

24.6.3.1 Дата истечения

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата истечения <expiryDate>	Дата исполнения европейского опциона.	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

24.6.3.2 Частичное исполнение

Не используется.

24.7 Дополнительные параметры опциона

Параметры азиатского и/или барьерного опциона. Заполняется обязательно, если соответствующие параметры определены в условиях сделки.

24.7.1 Параметры азиатского опциона

24.7.1.1 Метод усреднения цены

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Метод усреднения цены <averagingInOut>	Метод усреднения цены, используемый для азиатского опциона. “In” означает, что цена страйк определяется как среднее значение цены базового актива на спот-рынке за указанный период (опцион с азиатским страйком). “Out” означает, что цена базового актива при экспирации опциона определяется как среднее значение цены базового актива на спот-рынке за	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleAveragingInOutEnum

	указанный период (опцион с азиатской ценой). “Both” означает опцион с азиатским страйком и азиатской ценой.		
--	--	--	--

24.7.1.2 Период усреднения цены страйка. График наблюдений

Для азиатского опциона указывается период, за который определяется средняя цена базисного актива опциона (если условиями азиатского опциона предусмотрены дискретные даты, за которые определяется средняя цена, указываются первая и последняя даты).

Заполняется, если указан метод усреднения цены “In” (при этом «Период усреднения цены базового актива» не заполняется) или “Both”.

Элемент		Описание	Сверка	Формат заполнения
Начало периода наблюдения <schedule> <startDate>		Дата начала периода, за который определяется среднее значение цены базового актива	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Окончание периода наблюдения <schedule> <endDate>		Дата окончания периода, за который определяется среднее значение цены базового актива	mfr	
Периодичность расчетного периода <averagingPeriod Frequency>	Мультипликатор периода <periodMultiplier>	Мультипликатор периода времени	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
	Период времени <period>	Тип периода времени, соответствующий периоду, за который определяется среднее значение цены базового актива	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodExtendedEnum

24.7.1.3 Период усреднения цены базового актива. График наблюдений

Заполняется аналогично п. 24.7.1.2, если указан метод усреднения цены “Out” (при этом «Период усреднения цены страйка» не заполняется) или “Both”.

24.7.2 Условия барьерного опциона

24.7.2.1 Параметры отлагательного условия

24.7.2.1.1 Параметры триггерного условия

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Пороговый уровень <level>	Барьерная цена, с достижением которой стороны связали возникновение у покупателя опциона права требовать от продавца исполнения договора (отлагательное условие, knock-in)	mfr	Положительное десятичное число
Тип порогового уровня <triggerType>	Условие достижения барьерной цены (значение рыночной цены по отношению к барьерной цене): “EqualOrLess», “EqualOrGreater”, “Equal”, “Less”, “Greater”	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleTriggerTypeEnum

24.7.2.1.2 Выплата по бинарному опциону

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Сторона-плательщик	Сторона-плательщик выплаты по бинарному опциону	mfr	Party1; Party2

<payerPartyReference>			
Сторона-получатель <receiverPartyReference>	Сторона-получатель выплаты по бинарному опциону	mfr	
Сумма платежа <featurePayment> <amount>	Сумма платежа по бинарному опциону	mfr	Положительное десятичное число.
Валюта суммы <featurePayment> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма платежа по бинарному опциону	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

24.7.2.2 Параметры отменительного условия

24.7.2.2.1 Параметры триггерного условия

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Пороговый уровень <level>	Барьерная цена, с достижением которой опцион прекращает действовать (отменительное условие, knock-out)	mfr	Положительное десятичное число.
Тип порогового уровня <triggerType>	Условие достижения барьерной цены (значение рыночной цены по отношению к барьерной цене): “EqualOrLess», “EqualOrGreater”, “Equal”, “Less”, “Greater”	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleTriggerTypeEnum

24.7.2.2.2 Выплата по бинарному опциону

Заполняется аналогично п. 24.7.2.1.2.

24.8 Номинальная сумма

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <notionalAmount> <currency>	Валюта номинальной суммы	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
Сумма <notionalAmount> <amount>	Совокупная номинальная стоимость договора. В случае опциона на облигации определяется как произведение количества опционов, количества облигаций в одном опционе и номинальной стоимости одной облигации. В случае опциона на индекс определяется как произведение количества опционов, значения индекса на дату заключения договора в индексных пунктах и мультипликатора индекса либо как совокупная стоимость договора на дату его заключения в соответствии с данными бухгалтерского учета	mfr	Положительное десятичное число.

24.9 Объем лота

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
---------	----------	--------	-------------------

Объем лота <optionEntitlement>	Количество базового актива по договору	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
--	--	-----	--

24.10 Количество опционов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Количество опционов <numberOfOptions>	Количество опционов в соответствии с условиями сделки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

24.11 Тип расчетов

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Тип расчетов <settlementType>	Тип расчетов по договору: “Cash”, “Physical”, “Election” (возможность выбора между расчетным и поставочным исполнением)	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleSettlementTypeEnum

24.12 Цена исполнения (страйк)

Вариант выбора «Спрэд»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Спрэд <spread>	Цена исполнения, определенная как спред в годовом выражении	mfr	Положительное десятичное число

Вариант выбора «Цена исполнения в процентах»

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Цена исполнения <price>	Цена исполнения по отношению к цене базового актива или индекса. Если цена исполнения по условиям договора определяется на будущую дату, указывается либо рыночная цена, либо цена, определенная иным образом на дату заключения договора. При этом, не позднее трех рабочих дней с даты определения цены, следует предоставить в Репозиторий информацию об изменении соответствующего договора.	mfr	Положительное десятичное число

24.13 Кредитный дефолтный своп

Заполняется аналогично пп. 23.1 – 23.6. Анкеты кредитного дефолтного свопа (CM071). Исключение: в качестве значения параметров «Тип продукта» (creditDefaultSwap/productType) и «Код классификации ПФИ и договоров РЕПО» (creditDefaultSwap/productId) указываются те же значения, что и для свопциона.

25. Анкета иной сделки (CM081)

Параметры Анкеты иной сделки (CM081) соответствуют Таблице 8 «Информация об условиях иного договора» Приложения 1 к Указанию Банка России от 16 августа 2016 г. N 4104-У.

Данная анкета используется для структурных продуктов, сложных производных финансовых инструментов, а также в том случае, когда в условиях сделки отсутствуют параметры, обязательные для заполнения в соответствующей анкете форварда, опциона или свопа.

25.1 Тип продукта

Определение финансового инструмента в соответствии со справочником “ProductType”: [http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy\(nsdru\).](http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/product-taxonomy(nsdru).)

Значение	Описание
----------	----------

Other	Иной инструмент
-------	-----------------

25.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО

Значение кода классификации производных финансовых инструментов (ПФИ), формируемое в соответствии с Приложением 3 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

25.3 Обязательство стороны 1

Элемент		Описание	Сверка	Формат заполнения
Код объекта договора <assetCode>		Код базисного актива в соответствии с Приложением 7 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У	mfr	Символьная строка
Наименование объекта договора <assetDescription>		Наименование базисного актива. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	afr	Символьная строка
Код единицы измерения объекта договора <assetMeasureUnit>		Единица измерения базисного актива. Если указано количество базового актива, в качестве единицы его измерения используются, например, штуки, тонны, баррели, литры. В случае указания номинальной стоимости базисного актива используется код валюты	afr	Символьная строка
Номинальная сумма (количество) объекта договора <assetQuantity>		В зависимости от условий договора указывается количество базисного актива в единицах измерения либо номинальная сумма базисного актива в денежном выражении	afr	Положительное десятичное число
Цена за единицу объекта договора <assetUnit Price>	Валюта суммы <currency>	Валюта, в которой выражена цена	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
	Сумма <amount>	Цена за единицу измерения базисного актива. Заполняется, если в качестве «Номинальной суммы (количества) объекта договора» указано количество базисного актива в единицах измерения	mfr	Положительное десятичное число.
Общая денежная сумма, подлежащая уплате контрагенту <nominalAmount>	Валюта суммы <currency>	Валюта, в которой выражена общая денежная сумма, подлежащая уплате Стороне 2	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
	Сумма <amount>	Общая денежная сумма, подлежащая уплате Стороне 2	mfr	Положительное десятичное число.
Дата платежа <settlementDate>		Дата платежа по договору	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Дата поставки объекта договора <deliveryDate>		Дата поставки базисного актива	afr	ГГГГ-ММ-ДД

25.4 Обязательство стороны 2

Элемент		Описание	Сверка	Формат заполнения
Код объекта договора <assetCode>		Код базисного актива в соответствии с Приложением 7 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У	mfr	Символьная строка
Наименование объекта договора <assetDescription>		Наименование базисного актива. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	afr	Символьная строка
Код единицы измерения объекта договора <assetMeasureUnit>		Единица измерения базисного актива. Если указано количество базового актива, в качестве единицы его измерения используются, например, штуки, тонны, баррели, литры. В случае указания номинальной стоимости базисного актива используется код валюты	afr	Символьная строка
Номинальная сумма (количество) объекта договора <assetQuantity>		В зависимости от условий договора указывается количество базисного актива в единицах измерения либо номинальная сумма базисного актива в денежном выражении	afr	Положительное десятичное число
Цена за единицу объекта договора <assetUnitPrice>	Валюта суммы <currency>	Валюта, в которой выражена цена	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
	Сумма <amount>	Цена за единицу измерения базисного актива. Заполняется, если в качестве «Номинальной суммы (количества) объекта договора» указано количество базисного актива в единицах измерения	mfr	Положительное десятичное число.
Общая денежная сумма, подлежащая уплате контрагенту <nominalAmount>	Валюта суммы <currency>	Валюта, в которой выражена общая денежная сумма, подлежащая уплате Стороне 1	mfr	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
	Сумма <amount>	Общая денежная сумма, подлежащая уплате Стороне 1	mfr	Положительное десятичное число.
Дата платежа <settlementDate>		Дата платежа по договору	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Дата поставки объекта договора <deliveryDate>		Дата поставки базисного актива	afr	ГГГГ-ММ-ДД

25.5 Дополнительная информация

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дополнительная информация <additionalInformation>	Дополнительная информация о договоре в формате текстовой строки (например, порядок определения параметров, информация о приложенном документе). <i>Необязательный для заполнения и сверки</i>	afr	Символьная строка

	<i>элемент.</i>		
--	-----------------	--	--

V. Отчет об уплате маржевых сумм (CM092)

Маржевые суммы определяются в соответствии со *Стандартными условиями договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм*, утвержденными Национальной ассоциацией участников фондового рынка (НАУФОР), Национальной валютной ассоциацией (НВА) и Ассоциацией российских банков (АРБ). Если такой договор не заключен или заключен иной договор об обеспечении исполнения обязательств (например, ISDA 2016 Credit Support Annex), обязанность о предоставлении в репозиторий информации о маржевых суммах не установлена (она может предоставляться по желанию сторон).

! Важно С 01.04.2021 информация о маржевых суммах предоставляется только клиринговой организацией, осуществляющей функции центрального контрагента, в случае если такая организация выступает стороной по договору.

1. Регистрационный номер отчета, присвоенный участником

Заполняется в отношении каждого участника (три раза): Репозитария, Стороны 1, Стороны 2.

Элемент	Описание	Формат заполнения
Участник <partyReference href="TradeRepository"/> <partyReference href="Party1"/> <partyReference href="Party2"/>	Ссылка на участника: <ul style="list-style-type: none"> Репозитарий (НКО АО НРД); Сторона 1; Сторона 2 	TradeRepository; Party 1; Party 2
Регистрационный номер <tradeId>	Идентификатор Отчета об уплате маржевых сумм, присвоенный соответствующим участником <ul style="list-style-type: none"> Для Репозитария при первичной регистрации Отчета указывается "NONREF". В случае направления сообщения о внесении изменений в Отчет указывается идентификатор, присвоенный Репозитарием в соответствии с Извещением о регистрации (RM001) Отчета Для Стороны 1/Стороны 2 указывается идентификатор Отчета об уплате маржевых сумм, присвоенный Стороной 1 (Стороной 2). Если идентификатор, присвоенный контрагентом, неизвестен Стороне 1 (Стороне 2), в отношении Стороны 2 (Стороны 1) указывается "NONREF". Для собственного номера, присвоенного стороной, значение "NONREF" не допускается. Если Отчет подается от обеих сторон (в поле <reportParty> указано значение "all"), идентификаторы, присвоенные Стороной 1 и Стороной 2, должны совпадать 	Цифры и буквы латинского алфавита, не более 35 символов Например, CSA1234567890
Регистрационный номер Генерального соглашения <partyReference href="TradeRepository"/> <linkId>	<ul style="list-style-type: none"> Для Репозитария указывается идентификатор Анкеты генерального соглашения (CM010), в рамках которого заключен договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, присвоенный Репозитарием в соответствии с Извещением о регистрации (RM001) данной Анкеты¹³ Для Стороны 1 и Стороны 2 не заполняется 	Первые два символа – "MA", далее 10 цифр. Например, MA0000000123

¹³ Регистрационный номер не указывается, если между сторонами отсутствует заключенное Генеральное соглашение, при этом возникает обязанность по уплате маржевых сумм в рамках такого соглашения (в соответствии с ответом Банка России от 19.08.2020 № 34-1-1-3/520).

Регистрационный номер договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств <originatingTradeId> <tradeId>	<p>Идентификатор договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, присвоенный соответствующей стороной в соответствии с Анкетой договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств (CM015)¹⁴.</p> <p>Если Анкета договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств (CM015) не зарегистрирована, указываются собственные идентификаторы, присвоенные Стороной 1 и Стороной 2, а в качестве значения идентификатора, присвоенного Репозитарием, указывается "NONREF". При этом для собственных идентификаторов, присвоенных Стороной 1 и Стороной 2, значение "NONREF" не допускается</p> <p><i>Заполняется обязательно</i></p>	<p>Цифры и буквы латинского алфавита, не более 35 символов</p> <p>Например, CSA1ID</p>
--	---	--

2. Сторона, от имени которой направлено сообщение

Элемент	Описание	Формат заполнения
Участник <reportParty>	<p>Отчет об уплате маржевых сумм подается без проведения процедуры согласования (в одностороннем порядке) каждой из сторон независимо (Party 1, Party 2) либо одним Информирующим лицом от имени обеих сторон (all). Если одна из сторон не является клиентом Репозитария НРД, значение "all" не допускается</p>	<p>Party 1; Party 2; all.</p>

3. Обеспечение исполнения обязательств

Блок <creditSupportInformation> повторяется, если в рамках одного Отчета об уплате маржевых сумм предоставляется информация о **нескольких датах** расчета маржевой суммы (<valuationDate>).

Особенности изменения (корректировки) блока «Обеспечение исполнения обязательств» в ранее зарегистрированных Отчетах об уплате маржевых сумм:

1. изменение информации путем добавления или удаления блока «Обеспечение исполнения обязательств» - ведет к отказу в регистрации сообщения;
2. корректировка информации путем добавления блока «Обеспечение исполнения обязательств» - ведет к отказу в регистрации сообщения;
3. корректировка информации путем удаления всех блоков «Обеспечение исполнения обязательств» - ведет к исключению Отчета об уплате маржевых сумм из Реестра договоров.

3.1 Дата расчета маржевой суммы

Элемент	Описание	Формат заполнения
Дата расчета маржевой суммы <valuationDate>	<p>Фактическая дата возникновения требования и (или) обязательства по выплате маржевых сумм</p> <p>Для успешной регистрации Отчета об уплате плавающих маржевых сумм необходимо следовать следующим правилам:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Даты в полях <asofDate> и <valuationDate> должны быть указаны в одном календарном месяце либо совпадать 	<p>ГГГГ-ММ-ДД</p>

¹⁴ Регистрационный номер не указывается, если у сторон отсутствует договор, заключенный в целях обеспечения исполнения обязательств, при этом возникают обязательства по уплате маржевых сумм в рамках такого договора (в соответствии с ответом Банка России от 19.08.2020 № 34-1-1-3/520).

	<ul style="list-style-type: none"> Если Отчет подается от имени каждой из сторон (Стороны 1 и Стороны 2) независимо, то на одну дату расчета допускаются разные значения маржевых сумм в Отчетах, имеющих одинаковые идентификаторы, присвоенные соответствующими сторонами В рамках одной даты расчета маржевой суммы осуществляется проверка на отличие идентификаторов Отчета <tradeId>, присвоенных соответствующими участниками, от идентификаторов, указанных в ранее зарегистрированных сообщениях 	
--	---	--

3.2 Общая маржевая сумма

Элемент	Описание	Формат заполнения
Платательщик маржевых сумм <transferorReference>	Сторона, являющаяся плательщиком маржевой суммы	Party1; Party2
Получатель маржевых сумм <transfereeReference>	Сторона, являющаяся получателем маржевой суммы	
Размер маржевой суммы <creditSupportAmount> / <amount>	Размер общей маржевой суммы	Положительное десятичное число.
Валюта маржевой суммы <creditSupportAmount> / <currency>	Валюта общей маржевой суммы	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)
<i>Необязательная для заполнения и сверки Группа элементов (Общая маржевая сумма)</i>		

3.3 Накопленная маржевая сумма

Элемент	Описание	Формат заполнения
Платательщик маржевых сумм <transferorReference>	Сторона, являющаяся плательщиком маржевой суммы	Party1; Party2
Получатель маржевых сумм <transfereeReference>	Сторона, являющаяся получателем маржевой суммы	
Размер маржевой суммы <creditSupportBalance> / <amount>	Размер накопленной маржевой суммы	Положительное десятичное число.
Валюта маржевой суммы <creditSupportBalance> / <currency>	Валюта накопленной маржевой суммы	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

3.4 Начальная маржевая сумма

Элемент	Описание	Формат заполнения
Платательщик маржевых сумм <transferorReference>	Сторона, являющаяся плательщиком маржевой суммы	Party1; Party2
Получатель маржевых сумм <transfereeReference>	Сторона, являющаяся получателем маржевой суммы	
Размер маржевой суммы <independentAmount> / <amount>	Размер начальной маржевой суммы	Положительное десятичное число
Валюта маржевой суммы <independentAmount> / <currency>	Валюта начальной маржевой суммы	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

3.5 Плавающая маржевая сумма

Элемент	Описание	Формат заполнения
Плательщик маржевых сумм <transferorReference>	Сторона, являющаяся плательщиком маржевой суммы	Party1; Party2
Получатель маржевых сумм <transfereeReference>	Сторона, являющаяся получателем маржевой суммы	
Размер маржевой суммы <creditSupportObligations> / <amount>	Размер плавающей маржевой суммы	Положительное десятичное число
Валюта маржевой суммы <creditSupportObligations> / <currency>	Валюта плавающей маржевой суммы ¹⁵	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

¹⁵ В случае необходимости коррекции зарегистрированной информации по маржевым суммам в реестре договоров, участники имеют возможность подать изменение к анкете или, в случае необходимости удаления информации из реестра, подать изменения с нулевыми значениями.

VI. Отчет о расчете справедливой (оценочной) стоимости (CM094)

Информация о справедливой (оценочной) стоимости предоставляется по производным финансовым инструментам и определяется на основании отдельного договора, содержащего порядок определения справедливой (оценочной) стоимости, либо на основании данных бухгалтерского учета. Если по данным бухгалтерского учета справедливая (оценочная) стоимость не определена и не заключен отдельный договор, содержащий порядок определения справедливой (оценочной) стоимости, Отчет о расчете справедливой (оценочной) стоимости не предоставляется.

! Важно. С 01.04.2021 информация о справедливой (оценочной) стоимости предоставляется клиринговой организацией, осуществляющей функции центрального контрагента, в случае если такая организация выступает стороной по договору.

1. Регистрационный номер отчета, присвоенный участником

Заполняется в отношении каждого участника (три раза): Репозитория, Стороны 1, Стороны 2.

Элемент	Описание	Формат заполнения
Участник <partyReference href="TradeRepository"/> <partyReference href="Party1"/> <partyReference href="Party2"/>	Ссылка на участника: <ul style="list-style-type: none">Репозиторий (НКО АО НРД)Сторона 1Сторона 2	TradeRepository Party 1 Party 2
Регистрационный номер <tradeId>	Идентификатор Отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости, присвоенный соответствующим участником <ul style="list-style-type: none">Для Репозитория при первичной регистрации Отчета указывается "NONREF". В случае направления сообщения о внесении изменений указывается идентификатор, присвоенный Репозитарием в соответствии с Извещением о регистрации (RM001) ОтчетаДля Стороны 1 и Стороны 2 указывается идентификатор Отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости, присвоенный Стороной 1 (Стороной 2). Если идентификатор, присвоенный контрагентом, неизвестен Стороне 1 (Стороне 2), в отношении Стороны 2 (Стороны 1) указывается "NONREF". Для собственного номера, присвоенного стороной, значение "NONREF" не допускается. Если Отчет подается от обеих сторон (в поле <reportParty> указано значение "all"), идентификаторы, присвоенные Стороной 1 и Стороной 2, должны совпадать	Цифры и буквы латинского алфавита, не более 35 символов

2. Идентификатор договора о расчете справедливой стоимости

Элемент	Описание	Формат заполнения
Идентификатор договора о расчете справедливой стоимости <MTMIdentifier>	Идентификатор договора, содержащего порядок определения справедливой (оценочной) стоимости, на основании которого направляется отчет Если не применимо (справедливая стоимость определяется на основании данных бухгалтерского учета), не заполняется	Цифры и буквы латинского алфавита, не более 35 символов

3. Тип оценки стоимости

Элемент	Описание	Формат заполнения
Тип оценки стоимости <valuationMethod>	Метод оценки: “М” - рыночная оценка (mark-to-market), “О” - оценка, полученная на основе модели (mark-to-model)	М; О

4. Сторона, от имени которой направлено сообщение

Элемент	Описание	Формат заполнения
Сторона, от имени которой направлено сообщение <reportParty>	Отчет о расчете справедливой (оценочной) стоимости подается без проведения процедуры согласования (в одностороннем порядке) каждой из сторон независимо (Party 1, Party 2) либо одним Информирующим лицом от имени обеих сторон (all). Если одна из сторон не является клиентом Репозитория НРД, значение “all” не допускается	Party 1; Party 2; all

5. Справедливая/оценочная стоимость

Блок <markToMarketDetails> повторяется, если в рамках одного Отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости предоставляется информация о **нескольких датах** оценки (<valuationDate>)¹⁶

Особенности изменения (корректировки) блока «Справедливая/оценочная стоимость» в ранее зарегистрированных Отчетах о расчете справедливой (оценочной) стоимости:

1. изменение информации путем добавления или удаления блока «Справедливая (оценочная) стоимость» - ведет к отказу в регистрации сообщения;
2. корректировка информации путем добавления блока «Справедливая (оценочная) стоимость» - ведет к отказу в регистрации сообщения;
3. корректировка информации путем удаления всех блоков «Справедливая (оценочная) стоимость» - ведет к исключению Отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости из Реестра договоров.

5.1. Дата оценки

Элемент	Описание	Формат заполнения
Дата оценки <valuationDate>	<p>Фактическая дата оценки справедливой (оценочной) стоимости</p> <p>Для успешной регистрации Отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости необходимо следовать следующим правилам:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Даты в полях <asofDate> и <valuationDate> должны быть указаны в одном календарном месяце либо совпадать • Если Отчет подается от имени каждой из сторон (Стороны 1 и Стороны 2) независимо, то на одну дату оценки допускаются разные значения справедливой (оценочной) стоимости в Отчетах, имеющих одинаковые идентификаторы, присвоенные соответствующими сторонами • В рамках одной даты оценки осуществляется проверка на отличие идентификаторов Отчета <tradeId>, присвоенных соответствующими участниками, от 	ГГГГ-ММ-ДД

¹⁶ Информация о справедливой (оценочной) стоимости может направляться как в течение месяца, в котором осуществляется переоценка (по мере ее проведения), так и не позднее пяти рабочих дней месяца, следующего за месяцем, в котором осуществлена переоценка (за каждый день месяца, в который производилась соответствующая переоценка).

	идентификаторов, указанных в ранее зарегистрированных сообщениях	
Дата и время оценки <valuationDateTime>	Дата и время расчета справедливой (оценочной) стоимости договора. Заполняется, если зафиксировано время, на которое приводится информация о справедливой (оценочной) стоимости	YYYY-MM-DDThh:mm:ss

5.2. Справедливая/оценочная стоимость

Блок <markToMarketInformation> повторяется, если в рамках одного Отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости на одну дату оценки предоставляется информация о *нескольких договорах (портфеле договоров)*. При этом все договоры, указанные в Отчете, должны быть: 1) заключены и зарегистрированы в репозитории в рамках одного Генерального соглашения либо 2) заключены и зарегистрированы вне рамок Генерального соглашения.

Элемент	Описание	Формат заполнения
Идентификатор сделки <tradeId>	Идентификатор договора, в отношении которого определяется справедливая (оценочная) стоимость, присвоенный Репозитарием в соответствии с Извещением о регистрации (RM001) Анкеты договора ¹⁷	Цифры и буквы латинского алфавита, не более 35 символов
Справедливая/оценочная стоимость <amount>	Значение справедливой (оценочной) стоимости договора на фактическую дату оценки. Отрицательное значение указывается со знаком «минус»	Десятичное число
Валюта <currency>	Валюта, в которой выражена справедливая (оценочная) стоимость	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)

¹⁷ Допускается указание идентификатора договора, зарегистрированного только на уровне Журнала учета сообщений, то есть не попавшего в реестр договоров на момент регистрации Отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости (например, если контрагент не подтвердил соответствующую Анкету договора). В этом случае идентификатор договора заполняется в соответствии с Уведомлением о нахождении Анкеты в состоянии «Ожидание» (RM007)

VII. Анкета договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств (CM015)

Анкета договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств (CM015) является необязательной для отчетности в репозиторий. Она может быть предоставлена при условии, что зарегистрирована Анкета генерального соглашения (CM010), в рамках которого заключен договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм. Анкета CM015 применима для всех договоров, заключенных в целях обеспечения исполнения обязательств, в том числе заключенных в соответствии с иностранным правом

1. Регистрационный номер отчета, присвоенный участником

Заполняется в отношении каждого участника (три раза): Репозитария, Стороны 1, Стороны 2.

Элемент	Описание	Формат заполнения
Участник <partyReference href="TradeRepository"/> <partyReference href="Party1"/> <partyReference href="Party2"/>	Ссылка на участника: <ul style="list-style-type: none">Репозитарий (НКО АО НРД)Сторона 1Сторона 2	TradeRepository Party 1 Party 2
Регистрационный номер <tradeId>	Идентификатор договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, присвоенный соответствующим участником <ul style="list-style-type: none">Для Репозитария при первичной регистрации Анкеты CM015 указывается "NONREF". В случае направления сообщения о внесении изменений указывается идентификатор, присвоенный Репозитарием в соответствии с Извещением о регистрации (RM001) АнкетыДля Стороны 1 и Стороны 2 указывается идентификатор договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, присвоенный Стороной 1 (Стороной 2). Если идентификатор, присвоенный контрагентом, неизвестен Стороне 1 (Стороне 2), в отношении Стороны 2 (Стороны 1) указывается "NONREF"	Цифры и буквы латинского алфавита, не более 35 символов Например, CSA0001234567
Регистрационный номер генерального соглашения <partyReference href="TradeRepository"/> <linkId>	<ul style="list-style-type: none">Для Репозитария указывается идентификатор Анкеты генерального соглашения (CM010), в рамках которого заключен договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, присвоенный Репозитарием в соответствии с Извещением о регистрации (RM001) данной АнкетыДля Стороны 1 и Стороны 2 не заполняется	Первые два символа – "MA", далее 10 цифр Например, MA0000000123

2. Особые параметры

Элемент	Описание	Формат заполнения
Дата сделки <tradeDate>	Дата заключения договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм	ГГГГ-ММ-ДД
Тип договора <tradeType>	Наименование организации, опубликовавшей стандартную документацию для договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм Для Стандартных условий договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, утвержденных Национальной ассоциацией участников фондового рынка, Национальной	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/master-agreement-organization(nsdru)

	валютной ассоциацией и Ассоциацией российских банков, используется значение “NASMP”	
Тип обеспечения по договору <collateralType>	<p>Тип обеспечения (маржинальных требований) согласно договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм</p> <p>“FC” – полное обеспечение (используется одновременно первоначальная и плавающая маржевая сумма)</p> <p>“PC” – частичное обеспечение (используется только плавающая маржевая сумма)</p> <p>“OC” – одностороннее обеспечение (первоначальная и (или) плавающая маржевая сумма вносится только одной стороной)</p> <p>“U” – договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм не заключен</p>	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleMarginType
Форма обеспечения по договору <collateralForm>	<p>Форма обеспечения согласно договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм</p> <p>“Т” – обязательства по данному договору обеспечиваются индивидуально</p> <p>“G” – обязательства по данному договору обеспечиваются совокупно с обязательствами по иным заключенным договорам в составе портфеля (кумулятивное обеспечение) – например, в рамках одного Генерального соглашения</p> <p>“U” – договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм не заключен</p>	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleCollateralForm
Способ подтверждения сделки <confirmationMethod>	Способ подтверждения Анкеты: “MXME” - последовательное либо комбинированное подтверждение, “MATH” - встречное подтверждение	MXME; MATH.
Дополнительная информация о договоре <additionalInformation>	<p>Дополнительная информация о договоре в формате текстовой строки.</p> <p><i>Необязательный для заполнения элемент.</i></p>	Символьная строка

VIII. Анкета о состоянии обязательств по договорам (СМ093)

Анкета о состоянии обязательств по договорам (СМ093) предоставляется в случае изменения состояния обязательств или прекращения обязательств по договору не позднее трех рабочих дней с даты события, указанного в поле «Статус обязательств по сделкам» (<tradeObligationStatus>).¹⁸ Информация об изменении кода состояния обязательств по договору должна быть предоставлена не позднее трех рабочих дней с даты вступления в силу соответствующих изменений и/или наступления соответствующего события.¹⁹

1. Перечень сделок для отчета (Выбор типов идентификаторов)

Выбор сделок, по которым предоставляется информация о состоянии обязательств.

1.1 Вариант выбора «Все сделки»

Элемент	Описание	Формат заполнения
Все сделки <allTrades>	Фиксированное значение: “true”. Определяет, что информация о состоянии обязательств предоставляется по всем зарегистрированным договорам между Стороной 1 и Стороной 2	“true”

1.2 Вариант выбора «Идентификаторы сделок»

Элемент	Описание	Формат заполнения
Идентификатор сделки <tradeId>	Указывается идентификатор договора, присвоенный Репозитарием в соответствии с Извещением о регистрации (RM001) Анкеты договора. Если предоставляется информации о нескольких договорах, элемент повторяется Определяет, что информация о состоянии обязательств предоставляется по конкретному договору или договорам, заключенным между Стороной 1 и Стороной 2. При этом отправитель Анкеты СМ093 должен иметь полномочия Информирующего лица по соответствующим типам договоров	Цифры и буквы латинского алфавита, не более 35 символов

1.3 Вариант выбора «Идентификаторы Генеральных соглашений»

Элемент	Описание	Формат заполнения
Идентификационный номер Генерального соглашения <masterAgreementId>	Указывается идентификатор Генерального соглашения, присвоенный Репозитарием в соответствии с Извещением о регистрации (RM001) соответствующей Анкеты генерального соглашения. Если предоставляется информации о нескольких Генеральных соглашениях, элемент повторяется. По закрытым Анкетам генерального соглашения информация не предоставляется. Определяет, что информация о состоянии обязательств предоставляется по всем зарегистрированным договорам в рамках указанного Генерального соглашения. При этом отправитель Анкеты СМ093 должен иметь полномочия Информирующего лица по всем типам договоров в рамках данного Генерального соглашения.	Первые два символа – “МА”, далее 10 цифр. Например, МА0000000123

¹⁸ Если в Анкете договора элемент «Автоматическое закрытие сделки в дату окончания срока действия договора» (<automaticExecution>) имеет значение “Y”, соответствующая Анкета о состоянии обязательств по договорам (СМ093) не предоставляется. См. Инструкцию по автоматической deregистрации договоров в реестре

¹⁹ Например, если исполнение обязательств по договору просрочено, в течение трех рабочих дней с плановой даты исполнения договора предоставляется СМ093 со статусом “С”, а в течение трех рабочих дней с фактической даты исполнения договора предоставляется СМ093 со статусом “Т”

2. Статус обязательств по сделкам

Элемент	Описание	Формат заполнения
<p>Статус обязательств по сделкам <tradeObligationStatus></p>	<p>Статус состояния обязательств по договору на дату события. Заполняется в соответствии со справочником:</p> <p>“R” - исключение записи о заключении договора ввиду ошибочного внесения в раздел 2 реестра договоров или признания договора недействительным;</p> <p>“N” - прекращение обязательств новацией (новация отражается регистрацией нового договора);</p> <p>“W” - прекращение регистрации договора в репозитории ввиду перехода клиента в другой репозиторий;</p> <p>“T” - прекращение обязательств надлежащим исполнением в срок;</p> <p>“TD” - прекращение обязательств надлежащим исполнением досрочно;</p> <p>“C” - исполнение обязательств просрочено;</p> <p>“P” - исполнение обязательств приостановлено по предусмотренным в договоре основаниям;</p> <p>“D” - прекращение обязательств по иным основаниям;</p> <p>“E” - продление срока действия договора по предусмотренным договором основаниям;</p> <p>“O” - договор открыт (используется при совершении операции коррекции статуса Анкеты договора в реестре);</p> <p>“SO” - прекращение обязательств зачетом (неттингом), а также по основаниям, предусмотренным статьей 4.1 Федерального закона от 26 октября 2002 года N 127-ФЗ «О несостоятельности (банкротстве)»;</p> <p>“ССР” - прекращение обязательств заменой новым обязательством между каждой из сторон первоначального обязательства и центральным контрагентом.</p>	<p>Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/deal-status(nsdrus)</p>

IX. Анкета генерального соглашения (СМ010)

Условия Генерального соглашения.

Элемент	Описание	Формат заполнения
Тип Генерального соглашения <masterAgreementType>	Тип Генерального соглашения. Если форма Генерального соглашения разработана сторонами самостоятельно, указывается “Bespoke”. Если необходимое значение отсутствует в справочнике, указывается “Other”	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/master-agreement-type(nsdrus)
Версия формы Генерального соглашения <masterAgreementVersion>	Версия Генерального соглашения. Если необходимое значение отсутствует в справочнике, указывается “Other”	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/master-agreement-version(nsdrus)
Организация, опубликовавшая форму Генерального соглашения <masterAgreementOrganization>	Наименование организации, опубликовавшей стандартную документацию для Генерального соглашения. Для указания Стандартной документации для срочных сделок на финансовых рынках, утвержденных Национальной ассоциацией участников фондового рынка, Национальной валютной ассоциацией и Ассоциацией российских банков, используется значение “NASMP”. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	Значение из справочника http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/master-agreement-organization(nsdrus)
Способ подтверждения сделки <confirmationMethod>	Способ подтверждения Анкеты: “MXME” - последовательное либо комбинированное подтверждение, “MATH” - встречное подтверждение	MXME; MATH.
Свободное описание формы соглашения <narrativeDescription>	Дополнительная информация о Генеральном соглашении в формате текстовой строки. Заполняется, если тип или версия Генерального соглашения имеет значение “Other”. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	Символьная строка
Признак связанности стороны 1 и стороны 2 <partiesAreAffiliated>	Определяет, являются ли Сторона 1 и Сторона 2 аффилированными в соответствии с Указанием Банка России от 16.08.2016 № 4104-У	Y; N

X. Анкета прекращения генерального соглашения (CM011)

Условия прекращения Генерального соглашения.

Элемент	Описание	Формат заполнения
Номер Генерального соглашения <masterAgreementId>	Номер зарегистрированной анкеты Генерального соглашения, присвоенный репозитарием	MA0123456789
Причина разрыва Генерального соглашения <maTerminatingReason>	Причина прекращения Генерального соглашения. если необходимое значение отсутствует в справочнике, указывается “Other”	Значение из справочника https://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleMasterAgreementTerminatingReason

XI. Заявление о назначении Информировующих лиц (СМ016)

Сведения об Информировующем лице предоставляются клиентом Репозитория в Заявлении о назначении Информировующих лиц (СМ016). В Заявлении указываются все Информировующие лица с соответствующими полномочиями. Назначение каждого Информировующего лица в отдельном Заявлении не допускается.

Если клиент – юридическое лицо не предоставил Заявление о назначении Информировующих лиц и имеет:

- 1) один репозитарный код – по умолчанию считается, что функции Информировующего лица клиент выполняет самостоятельно²⁰;
- 2) несколько репозитарных кодов – по умолчанию считается, что функции Информировующего лица клиент выполняет самостоятельно по каждому репозитарному коду²¹. Для распределения полномочий по конкретным репозитарным кодам (собственным кодам или кодам иных клиентов) клиенту необходимо направить Заявление о назначении Информировующих лиц от каждого репозитарного кода с указанием соответствующих реквизитов.

Если стороной Генерального соглашения/договора выступает лицо, не обязанное предоставлять информацию в Репозиторий и не являющееся клиентом Репозитория, внесение сведений в Реестр договоров Репозитория осуществляется Информировующим лицом клиента, являющегося второй стороной Генерального соглашения/договора, в одностороннем порядке.

Для прекращения действующих полномочий Информировующего лица по инициативе клиента клиент должен подать в Репозиторий Заявление о назначении информирующих лиц с указанием реквизитов нового Информировующего лица и его полномочий. Каждое новое Заявление является заменой предыдущего. Если клиент берет на себя выполнение функций Информировующего лица, то в Заявлении о назначении информирующих лиц следует указать собственные реквизиты.

! Важно: С 01.04.2021 Отправителем, в случае если одной из Сторон договора является клиринговая организация, осуществляющая функции центрального контрагента, может выступать только клиринговая организация, осуществляющая функции центрального контрагента.

Исключение составляет информация «Цель заключения договора», которая предоставляется Стороной-контрагентом в отношении себя (или назначенным ею Информировующим лицом).

Для указанных договоров не требуется назначение клиринговой организации, осуществляющей функции центрального контрагента, Информировующим лицом в отношении Стороны-контрагента посредством формы СМ016.

1. Параметры сообщения

1.1. Сторона

Элемент	Описание	Формат заполнения
Идентификационный код <party id="Party"> <partyId>	Репозитарный код клиента – отправителя Заявления в соответствии со Справочником участников Репозитория (столбец «Идентификационный код / Identification Code»)	Значение из справочника на сайте https://www.nsd.ru/services/repozitariy/
Наименование участника <party id="Party"> <partyName>	Указывается «Полное наименование» в соответствии со Справочником участников Репозитория	

1.2. LEI/SWIFT/INN стороны

Элемент	Описание	Формат заполнения
---------	----------	-------------------

²⁰ При самостоятельном выполнении функций Информировующего лица предоставление Заявления о назначении Информировующих лиц не требуется.

²¹ Если в Анкете договора Сторона указана с ее первым репозитарным кодом (Код 1), то в качестве репозитарного кода Отправителя данной Анкеты должен быть указан тот же репозитарный код (Party = Sender = Код 1). Соответственно, если контрагент укажет в Анкете договора данную Сторону с ее вторым репозитарным кодом (Код 2), то Репозиторий направит Анкету договора для подтверждения на Код 2, и только с этого кода Сторона сможет согласовать данную Анкету (Party = Sender = Код 2).

<p>Идентификационный код</p> <p><party id="Party"></p> <p><partyId></p>	<p>Для юридических лиц, обязанных предоставлять информацию в репозиторий, указывается международный код идентификации юридического лица (Legal Entity Identifier, LEI)</p> <p>Для физических лиц указывается номер паспорта (PASS) или страховой номер индивидуального лицевого счета, СНИЛС (SNILS). Например, SNILS_XXX-XXX-XXX XX (X – цифры от 0 до 9)</p> <p>Для юридических лиц, не обязанных предоставлять информацию в репозиторий и не имеющих кода LEI, применимы следующие типы кодов: для юридических лиц – ИНН (INN), дополнительно для иностранных юридических лиц – код SWIFT (SWIFT), коды информационных систем Bloomberg (BLOOM) и Thomson Reuters (THRTR) либо иной код (OWN)</p>	<p>Маска: «LEI» «нижнее подчеркивание» «код», не более 35 символов.</p> <p>Например, LEI_253400M18U5TB02TW421</p>
--	--	---

1.3. Отправитель

Элемент	Описание	Формат заполнения
<p>Идентификационный код</p> <p><party id="Sender"></p> <p><partyId></p>	<p>Репозитарный код клиента в соответствии со Справочником участников Репозитария (столбец «Идентификационный код / Identification Code»)</p> <p>Заявление о назначении Информированных лиц (СМ016) и Заявление об отказе от функций Информированного лица (СМ017) могут подаваться только клиентом Репозитария НРД от своего имени (Party = Sender)</p>	<p>Значение из справочника на сайте https://www.nsd.ru/services/repozitariy/</p>
<p>Наименование участника</p> <p><party id="Sender"></p> <p><partyName></p>	<p>Указывается «Полное наименование» в соответствии со Справочником участников Репозитария</p>	

1.4. LEI/SWIFT/INN отправителя

Элемент	Описание	Формат заполнения
<p>Идентификационный код</p> <p><party id="Sender"></p> <p><partyId></p>	<p>Указывается международный код идентификации юридического лица (Legal Entity Identifier, LEI) – клиента репозитария (см. п. 1.2)</p>	<p>Например, LEI_253400M18U5TB02TW421</p>

1.5. Дата совершения отчитываемого события

Элемент	Описание	Формат заполнения
<p>Дата совершения отчитываемого события</p> <p><asOfDate></p>	<p>Дата подачи заявления</p>	<p>ГГГГ-ММ-ДД</p> <p>Например, 2015-12-31</p>

1.6. Номер сообщения

Элемент	Описание	Формат заполнения
<p>Номер сообщения</p> <p><messageId></p>	<p>Произвольный уникальный идентификатор сообщения. В Web-кабинете генерируется</p>	<p>Цифры и буквы латинского алфавита, не</p>

	автоматически при отправке сообщения	более 35 символов
--	--------------------------------------	-------------------

1.7. Уникальный код цепочки сообщений

Элемент	Описание	Формат заполнения
Уникальный код цепочки сообщений <correlationId>	Идентификатор, используемый для связи нескольких сообщений между собой. В Web-кабинете значение генерируется автоматически при отправке сообщения	[Репозитарный код отправителя]-[Год]-[Номер сообщения]

2. Особые параметры

2.1 Регистрационный номер заявления

Элемент	Описание	Формат заполнения
Регистрационный номер заявления <applicationId>	Идентификатор Заявления, присвоенный Репозитарием. При первичной регистрации указывается "NONREF"	Цифры и буквы латинского алфавита, не более 35 символов

2.2 Информирующее лицо

Блок <agreementReportingAgent> повторяется для указания **нескольких Информирующих лиц**. Каждое Информирующее лицо должно иметь уникальный набор полномочий («Тип отчетности информирующего лица»).

Элемент	Описание	Формат заполнения
Идентификатор участника <party id="ReportingAgent1"> <partyId> ²²	Репозитарный код Информирующего лица в соответствии со Справочником участников Репозитария (столбец «Идентификационный код / Identification Code»)	Значение из справочника ²³ на сайте https://www.nsd.ru/services/repozitariy/
Наименование участника <party id="ReportingAgent1"> <partyName>	Указывается «Полное наименование» в соответствии со Справочником участников Репозитария	
Идентификатор участника <party id="ReportingAgent1"> <partyId>	Указывается международный код идентификации юридического лица (Legal Entity Identifier, LEI) – Информирующего лица	Например, LEI_253400M18U5TB02TW421

2.3 Тип отчетности информирующего лица

2.3.1. Выбор контрагента

Заполняется, если необходимо определить полномочия Информирующего лица в рамках конкретного (-ых) Генерального (-ых) соглашения (-й) или с конкретным (-и) контрагентом (-ами).

Обращаем внимание, что при назначении клиентом Информирующего лица без заполнения блока «Выбор контрагента» Информирующее лицо:

- 1) получает право направлять информацию в Репозитарий по всем контрагентам и в рамках всех Анкет

²² Ссылка на идентификатор Информирующего лица задаётся по правилу "ReportingAgentN", где "N" - порядковый номер. Например, ReportingAgent1, ReportingAgent2.

²³ Изменение данных Информирующего лица в Справочнике участников репозитария (дополнительного идентификатора участника и/или наименования участника) не требует внесения изменений в Заявление.

генеральных соглашений клиента, полномочия по которым не переданы другим Информирующим лицам;

2) в случае получения полномочий отчитываться по Генеральным соглашениям (в поле «Тип документа» <documentType> указано значение “MasterAgreement”): получает возможность просматривать в веб-кабинете Репозитория все Анкеты договоров, одной из сторон которых является клиент;

3) в случае получения полномочий отчитываться по Анкетам договоров (в поле «Тип документа» <documentType> указано значение, отличное от “ALLD”, “MasterAgreement”, “creditSupportAnnex”, “transfersAndExecution”, “markToMarketValuation”): получает возможность просматривать в веб-кабинете Репозитория все Анкеты генеральных соглашений, одной из сторон которых является клиент;

4) в случае получения полномочий отчитываться по всем видам договоров (в поле «Тип документа» <documentType> указано значение “ALLD”): получает возможность просматривать в веб-кабинете Репозитория все Анкеты договоров и Генеральных соглашений, одной из сторон которых является клиент.

Вариант выбора «Код идентификации Генерального соглашения»

Заполняется для определения полномочий Информирующего лица в рамках **конкретного Генерального соглашения** по всем или отдельным типам договоров, указанным в поле «Тип документа» <documentType>.

Элемент	Описание	Формат заполнения
Код идентификации Генерального соглашения <linkId>	Идентификатор Анкеты генерального соглашения (CM010), присвоенный Репозиторием в соответствии с Извещением о регистрации (RM001) Элемент повторяется для указания нескольких Генеральных соглашений	Первые два символа – «МА», далее 10 цифр. Например, MA0000000123

Вариант выбора «Контрагент»

Заполняется для определения полномочий Информирующего лица по всем или отдельным типам договоров, указанным в поле «Тип документа» <documentType>, которые заключены с **конкретным контрагентом**. Блок повторяется для указания нескольких контрагентов.

Элемент	Описание	Формат заполнения
Идентификатор участника <party id="CounterParty1"> <partyId> ²⁴	Репозитарный код контрагента в соответствии со Справочником участников Репозитория (столбец «Идентификационный код / Identification Code»). Если контрагент не является клиентом Репозитория НРД, указывается “NONREF”	Значение из справочника ²⁵ на сайте https://www.nsd.ru/services/repozitariy/
Наименование участника <party id="CounterParty1"> <partyName>	Наименование контрагента. Для клиентов Репозитория НРД указывается «Полное наименование» в соответствии со Справочником участников Репозитория Для физических лиц указывается фамилия, имя и отчество (при наличии) на русском или английском языке	
Идентификатор участника <party id="CounterParty1"> <partyId>	Для юридических лиц, обязанных предоставлять информацию в репозитарий, указывается международный код идентификации юридического лица (Legal Entity Identifier, LEI)	Например, LEI_253400M18U5TB02TW421

²⁴ Ссылка на идентификатор контрагента задаётся по правилу "CounterPartyN", где "N" - порядковый номер. Например, CounterParty1, CounterParty2.

²⁵ Изменение данных контрагента в Справочнике участников репозитория (дополнительного идентификатора участника и/или наименования участника) не требует внесения изменений в Заявление. Изменение данных контрагента, не являющегося клиентом Репозитория НРД, после регистрации Заявления о назначении Информирующих лиц требует внесения соответствующих изменений в Заявление (направления обновленного Заявления).

	<p>Для физических лиц указывается номер паспорта (PASS) или страховой номер индивидуального лицевого счета, СНИЛС (SNILS). Например, SNILS_XXX-XXX-XXX XX (X – цифры от 0 до 9)</p> <p>Для юридических лиц, не обязанных предоставлять информацию в репозиторий и не имеющих кода LEI, применимы следующие типы кодов: для юридических лиц – ИНН (INN), дополнительно для иностранных юридических лиц – код SWIFT (SWIFT), коды информационных систем Bloomberg (BLOOM) и Thomson Reuters (THRTR) либо иной код (OWN)</p>	
--	---	--

2.3.2. Тип отчетности информирующего лица

Тип (-ы) договоров, по которым указанное Информирующее лицо получает полномочия. Не допускается пересечение полномочий у разных Информирующих лиц, т. е. «Тип документа» не может быть повторно указан для другого Информирующего лица без добавления в Заявление о назначении Информирующих лиц дополнительных фильтров, обеспечивающих уникальность полномочий данного Информирующего лица.

Элемент	Описание	Формат заполнения
<p>Тип документа</p> <p><documentType></p>	<p>Тип документа в соответствии со справочником. Значение “ALLD” означает все Анкеты договоров и Анкету генерального соглашения.</p> <p>Для определения полномочий на регистрацию Отчета об уплате маржевых сумм (CM092) указывается: 1) значение “transfersAndExecution” либо 2) “ALLD”, “MasterAgreement” или “creditSupportAnnex” с флагом «Да» в поле «Отчет об уплате маржевых сумм» (<transfersAndExecution>)</p> <p>Для определения полномочий на регистрацию Отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости (CM094) указывается: 1) значение “markToMarketValuation” либо 2) “ALLD” или отдельные типы договоров с флагом «Да» в поле «Отчет о расчете справедливой (оценочной) стоимости» (<markToMarketValuation>)</p> <p>Элемент повторяется для указания нескольких типов договоров</p>	<p>Значение из справочника http://repository.nsd.ru/verified/current/reference/types/simpleDocumentType</p>
<p>Получение исторических выписок по данному классу сделок</p> <p><historyStatementReport></p>	<p>Определяет наличие у Информирующего лица полномочий на получение выписок по указанным типам договоров, зарегистрированным как данным Информирующим лицом, так и другими Информирующими лицами, действовавшими до регистрации данного Заявления</p>	<p>Флаг да/нет (“true”; “false”)</p>
<p>Отчет об уплате маржевых сумм</p> <p><transfersAndExecution></p>	<p>Определяет наличие у Информирующего лица полномочий на регистрацию Отчета об уплате маржевых сумм (CM092). Флаг «Да» применим, если элемент «Тип документа» содержит значение “ALLD”, “MasterAgreement” или “creditSupportAnnex”</p>	<p>Флаг да/нет (“true”; “false”)</p>

Отчет о расчете справедливой (оценочной) стоимости <markToMarketValuation>	Определяет наличие у Информирующего лица полномочий на регистрацию Отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости (СМ094) по указанным типам договоров	Флаг да/нет (“true”; “false”)
--	---	-------------------------------

ХП. Заявление об отказе от функций Информирующего лица (СМ017)

Информирующее лицо, имеющее действующие полномочия, может предоставить в Репозиторий Заявление об отказе от функций Информирующего лица (СМ017) ²⁶. Заявление может быть подано только Информирующим лицом, ранее зарегистрированным в качестве Информирующего лица по Заявлению о назначении Информирующих лиц (СМ016) и подтвердившим свои полномочия.

1. Параметры сообщения

См. Заявление о назначении Информирующих лиц (СМ016).

2. Особые параметры

2.1 Регистрационный номер заявления

Элемент	Описание	Формат заполнения
Регистрационный номер заявления <applicationId>	Идентификатор Заявления, присвоенный Репозитарием. При первичной регистрации указывается "NONREF"	Цифры и буквы латинского алфавита, не более 35 символов

2.2 Сторона по сделкам

Элемент	Описание	Формат заполнения
Идентификационный код <party id="AgreementParty1"> <partyId> ²⁷	Репозитарный код Стороны-клиента Репозитария, Информирующее лицо которой отказывается от выполнения соответствующих функций, в соответствии со Справочником участников Репозитария (столбец «Идентификационный код / Identification Code»)	Значение из справочника на сайте https://www.ns.d.ru/services/repozitariy/
Наименование участника <party id="AgreementParty1"> <partyName>	Указывается «Полное наименование» клиента в соответствии со Справочником участников Репозитария	
LEI участника <party id="AgreementParty1"> <partyId>	Для юридических лиц, обязанных предоставлять информацию в репозитарий, указывается международный код идентификации юридического лица (Legal Entity Identifier, LEI) Для физических лиц указывается номер паспорта (PASS) или страховой номер индивидуального лицевого счета, СНИЛС (SNILS). Например, SNILS_XXX-XXX-XXX XX (X – цифры от 0 до 9) Для юридических лиц, не обязанных предоставлять информацию в репозитарий и не имеющих кода LEI, применимы следующие типы кодов: для юридических лиц – ИНН (INN), дополнительно для иностранных юридических лиц – код SWIFT (SWIFT), коды информационных систем Bloomberg (BLOOM) и Thomson Reuters (THRTR) либо иной код (OWN)	Например, LEI_253400M18U5TB02TW421

²⁶ Для взаимодействия с Репозитарием клиент, Информирующее лицо которого отказалось от выполнения соответствующих функций, обязан назначить новое Информирующее лицо либо принять на себя выполнение функций Информирующего лица путем направления в Репозитарий Заявления о назначении информирующих лиц с указанием реквизитов нового Информирующего лица и его полномочий, либо с указанием собственных реквизитов.

²⁷ Ссылка на идентификатор задаётся по правилу "AgreementPartyN", где "N" - порядковый номер. Например, AgreementParty1, AgreementParty2.

ХIII. Заявление на подключение/отключение сервиса форматно-логического контроля (СМ018)

Информирующее лицо, желающее контролировать качество своей отчетности в Репозиторий, может предоставить в Репозиторий Заявление на подключение [сервиса](#) форматно-логического контроля (СМ018). Заявление может быть подано как Информирующим лицом, так и клиентом, которе намеревается стать Информирующим лицом. Для подключения клиента к сервису достаточно подать Заявление по одному из его репозитарных кодов. Заявление, поданное через WEB-кабинет Репозитария, также является волеизъявлением клиента на присоединение к Регламенту сопутствующих услуг Репозитария.

1. Параметры запроса

1.1. Стороны запроса

Элемент	Описание	Формат заполнения
Идентификационный код Стороны <partyId>	Репозитарный код Стороны-клиента Репозитария, в соответствии со Справочником участников Репозитария (столбец «Идентификационный код / Identification Code»)	Значение из справочника на сайте https://www.nsd.ru/services/repozitariy/
Наименование Стороны <partyName>	Указывается «Полное наименование» клиента в соответствии со Справочником участников Репозитария	
Идентификационный код Стороны <partyId>	Для юридических лиц, обязанных предоставлять информацию в репозитарий, указывается международный код идентификации юридического лица (Legal Entity Identifier, LEI). Для физических лиц указывается номер паспорта (PASS) или страховой номер индивидуального лицевого счета, СНИЛС (SNILS). Например, SNILS_XXX-XXX-XXX XX (X – цифры от 0 до 9). Для юридических лиц, не обязанных предоставлять информацию в репозитарий и не имеющих кода LEI, применимы следующие типы кодов: для юридических лиц – ИНН (INN), дополнительно для иностранных юридических лиц – код SWIFT (SWIFT), коды информационных систем Bloomberg (BLOOM) и Thomson Reuters (THRTR) либо иной код (OWN)	Например, LEI_253400M18U5TB02TW421
Идентификационный код Отправителя <partyId>	Репозитарный код Стороны-клиента Репозитария, в соответствии со Справочником участников Репозитария (столбец «Идентификационный код / Identification Code»)	Значение из справочника на сайте https://www.nsd.ru/services/repozitariy/
Наименование Отправителя <partyName>	Указывается «Полное наименование» клиента в соответствии со Справочником участников Репозитария	
Идентификационный код Отправителя <partyId>	Для отправителя сообщения в Репозитарий указывается международный код идентификации юридического лица (Legal Entity Identifier, LEI)	Например, LEI_253400M18U5TB02TW421

1.2. Выбор варианта подключения

Элемент	Описание	Формат заполнения
---------	----------	-------------------

<requestToConnect>	Запрос на подключение к сервису форматно-логического контроля	<Да><true>
<requestToDisconnect>	Запрос на отключение от сервиса форматно-логического контроля	<Да><true>
<ConnectTabularReports>	Запрос на подключение к сервису формирования табличных отчетов	<Да><true>
<DisconnectTabularReports>	Запрос на отключение от сервиса формирования табличных отчетов	<Да><true>

XIV. Правила формирования сообщений в bulk-формате (CM083, CM084, CM085)

При необходимости, Информирующее лицо имеет возможность предоставлять в Репозиторий информацию в одном сообщении одновременно по нескольким договорам, обязательства по которым были исполнены на момент отчетности.

Данный формат сообщения (bulk-формат) преимущественно используется участниками для отчетности сделок по переносу коротких позиций своих клиентов на следующий торговый день (технические или спец. сделки), в частности, для сделок репо, валютного свопа и конверсионных сделок.

1. Особенности заполнения и отправки сообщений

Сделки объединяются в сообщении по следующим параметрам:

- Дата сделки
- Статус исполнения обязательств по сделкам (либо T, либо SO, либо D)
- Даты расчетов/поставки по первой и второй части сделки (или форвардная дата для конверсионных сделок)

Для предоставления сообщений по формам в Репозиторий для:

- CM083 – repoBulkReport в Заявлении CM016 Информирующее лицо должно быть определено по типам договоров («documentType»): ALLD или repo (без детализации по параметрам «counterParty» и «executionVenueType»).
- CM084 – fxSwapBulkReport в Заявлении CM016 Информирующее лицо должно быть определено по типам договоров («documentType»): ALLD или fxSwap (без детализации по параметрам «counterParty» и «executionVenueType»).
- CM085 – fxSingleLegBulkReport в Заявлении CM016 Информирующее лицо должно быть определено по типам договоров («documentType»): ALLD или fxSingleLeg (без детализации по параметрам «counterParty» и «executionVenueType»).

Порядок заполнения информации внутри сообщений

Отчеты содержат повторяющиеся группы с описанием параметров контрактов «repos», «swaps», «singleLegs».

Данные группы состоят из двух параметров:

- Контрагент («counterparty») – группа элементов, описывающая контрагента по сделкам, входящим в соответствующую группу «repos»/«swaps»/«singleLegs».
- Детали контракта («repoDetails», «swapDetails», «singleLegDetails») – повторяющаяся группа элементов, описывающих параметры отдельно взятых сделок, объединенных в группы «repos»/«swaps»/«singleLegs» по контрагенту «counterparty».

! Важно: две группы параметров контракта («repos»/«swaps»/«singleLegs») в одном bulk-отчете не могут содержать одинаковые группы «counterparty» (контрагент). Группы «repos»/«swaps»/«singleLegs» объединяются по разным контрагентам.

! Важно: блок repoDetails/swapDetails/singleLegDetails описывает параметры одной сделки, где Тип стороны Buyer/Seller и Payer/Receiver относится к первой части данной сделки для Party1, который является клиентом Репозитория.

По умолчанию контрагентом по сделкам, входящим в отчет, является Сторона договора - не клиент Репозитория, при этом в группе «counterparty» указываются:

- «id» - заполняется по правилу «CounterpartyN+1» (N от 0);
- «partyId» - основной код - по умолчанию NONREF;
- «partyId» - дополнительный код – заполняется по общим правилам;
- «partyName» - полное официальное наименование;
- «classification» - вид экономической деятельности, значение из справочника;
- «country» - страна, значение из справочника;
- «organizationType» - тип лица, значение из справочника.

! Важно: если Стороны по сделке совпадают, группа Counterparty (для «CounterpartyN») заполняется аналогично группе party (для «Party1»).

В сообщениях группа party должна заполняться 4 раза (отдельно для «Party1», «Party2», «Sender» и «TradeRepository»).

Группа party для «Party1» заполняется данными о Стороне - клиенте репозитория НРД, от имени которой направляется отчет.

! Важно: по концепции формата Party1 – это профучастник, совершающий технические сделки для своих клиентов.

Группа party для «Party2» заполняется по правилу:

- Если bulk-сообщение отправляется по сделкам вне рамок Генерального соглашения (далее – ГС), то в полях «partyId» и «partyName» указывается значение NONREF (поля «classification», «country», «organizationType» не заполняются). Контрагент(ы) по сделкам, включенным в отчет, указывается(ются) в группе «counterparty» в части сообщения, описывающем параметры сделок.
- Если bulk-отчет отправляется по сделкам в рамках ГС, то заполняется данными о Стороне-контрагенте репозитория НРД, в соответствии с ГС (указываются 2 кода «partyId», «partyName», «classification», «country», «organizationType»). При этом группа «counterparty» в части сообщения, описывающем параметры сделок, должна совпадать с данными контрагента («Party2») и может быть заполнена только один раз.

! Важно: контрагенты (Counterparty1+n) по текущей реализации – не клиенты Репозитория, но клиенты брокера – Party1, которым брокер предоставляет заемные средства.

Группа party для «Sender» заполняется данными об Информирующем лице Стороны клиента репозитория, указанной в группе party («Party1»), от имени которого направляется отчет.

Полномочия Информирующего лица («Sender») на предоставление соответствующего отчета определяются на основании зарегистрированного Заявления о назначении информирующих лиц (СМ016) Стороны-клиента («Party1»).

В bulk-сообщениях стандартная группа элементов с информацией о клиентах сторон «clientDetails» не заполняется. Вместо него форматом предусмотрен опциональный множественный элемент «client» - «Клиент стороны» на уровне каждой сделки, входящей в отчет.

! Важно: в подразделе «Клиент стороны» могут перечисляться клиенты профучастника (Party1), которые не являются сторонами по сделке, но, в интересах которых, или за счет которых, брокер мог совершать сделки, давая заемные средства.

2. Коррекция сообщения Bulk -формата

Операция коррекции доступна для изменения информации в зарегистрированной анкете СМ083-СМ085 в реестре.

В зарегистрированную анкету xml-сообщения добавляются следующие элементы:

- <amendment xsi:type="nsdext:TradeAmendmentContent">
- <agreementDate>YYYY-MM-DD</agreementDate>
- <effectiveDate>YYYY-MM-DD</effectiveDate>
- <nsdext:correctRegisteredInfo>true</nsdext:correctRegisteredInfo>
- </amendment>

При этом, в сообщении на регистрацию коррекции необходимо указать информацию по всем ранее зарегистрированным сделкам в отчете и откорректировать необходимые параметры.

! Важно: Операция коррекции не допускает добавление сделок в отчет или исключение ошибочно отчитанных сделок в сообщении. Если требуется добавить или удалить часть зарегистрированных сделок в отчете, необходимо удалить все сообщение целиком с помощью подачи анкеты СМ093 со статусом – R и подать сообщение заново с корректным составом сделок.

! Важно: С 01.04.2021 в отчетность вводится элемент <nsdext:hedgeInfo> («Цель заключения договора»), который указывает, что договор относится к инструментам хеджирования и (или) заключается в рамках операций хеджирования (в соответствии с Указанием Банка России от 16.08.2016 № 4104-У).

Элемент указывается для каждой сделки один раз в конце блока, описывающего сделку - <nsdext:repoDetails> <nsdext:swapDetails> и <nsdext:fxsinglelegDetails> как: <nsdext:hedgeInfo>{H1 – Party1 или H2 –

nsdext:counterparty или H3 – Party1 и nsdext:counterparty}</nsdext:hedgeInfo>/

Отсутствие элемента для стороны договора в сообщении означает, что договор не относится к инструментам хеджирования и (или) не заключается в рамках операций хеджирования для соответствующей стороны договора.

Пример сообщения:

```
<nonpublicExecutionReport>
<header>
...
</header>
<isCorrection>>false</isCorrection>
<correlationId correlationIdScheme="">[P00000000111]-[2016]-[MesIdCM083]</correlationId>
<asOfDate>2016-07-01</asOfDate>
<amendment xsi:type="nsdext:TradeAmendmentContent">
<trade xsi:type="nsdext:TradeNsd">
...
</trade>
<agreementDate>2016-07-01</agreementDate>
<effectiveDate>2016-07-01</effectiveDate>
<nsdext:correctRegisteredInfo>true</nsdext:correctRegisteredInfo>
</amendment>
<party>
...
</party>
</nonpublicExecutionReport>
```

3. Пример заполнения xml-сообщения для CM083 - repoBulkReport

```
<nonpublicExecutionReport
xmlns="http://www.fpml.org/FpML-5/recordkeeping"
xmlns:nsdext="http://www.fpml.org/FpML-5/recordkeeping/nsd-ext"
xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
xmlns:fpmlext="http://www.fpml.org/FpML-5/ext"
xsi:schemaLocation="http://www.fpml.org/FpML-5/recordkeeping fpml-recordkeeping-merged-schema.xsd
http://www.fpml.org/FpML-5/recordkeeping/nsd-ext nsd-ext-merged-schema.xsd"
fpmlVersion="5-4" actualBuild="5">
<!--Заголовок сообщения.-->
<header>
  <!--Номер сообщения-->
  <messageId messageIdScheme="">MesIdCM083</messageId>
  <!--Отправитель сообщения-->
  <sentBy>P00000000111</sentBy>
  <!--Получатель сообщения-->
  <sendTo>NDC000000000</sendTo>
  <!--Время создания сообщения-->
  <creationTimestamp>2016-07-01T19:03:13</creationTimestamp>
  <!--Версия спецификации.-->
  <implementationSpecification>
    <!--Версия спецификации.-->
    <version>4.2</version>
  </implementationSpecification>
</header>
<!--Признак корректирующего сообщения-->
<isCorrection>false</isCorrection>
<!--Уникальный код цепочки сообщений-->
<correlationId correlationIdScheme="">[P00000000111]-[2016]-[MesIdCM083]</correlationId>
<!--Дата совершения отчитываемого события-->
<asOfDate>2016-07-01</asOfDate>
<!--Регистрация Анкеты-->
<trade xsi:type="nsdext:TradeNsd">
<!--Общая информация об отчете.-->
<tradeHeader>
  <!--Идентификатор отчета, присвоенный Репозитарием.-->
  <partyTradeIdentifier>
    <!--Участник.-->
    <partyReference href="TradeRepository"/>
    <!--Идентификатор отчета.-->
    <tradeId>NONREF</tradeId>
  </partyTradeIdentifier>
```

```

<!--Идентификатор отчета, присвоенный Стороной1-->
<partyTradeIdentifier>
  <!--Участник.-->
  <partyReference href="Party1"/>
  <!--Идентификатор отчета.-->
  <tradeId>CM083-Party-NUM1</tradeId>
</partyTradeIdentifier>
<!--Идентификатор отчета, присвоенный Стороной2-->
<partyTradeIdentifier>
  <!--Участник.-->
  <partyReference href="Party2"/>
  <!--Идентификатор отчета.-->
  <tradeId>NONREF</tradeId>
</partyTradeIdentifier>
<!--Информация стороны о сделке.-->
<partyTradeInformation>
  <!--Участник.-->
  <partyReference href="TradeRepository"/>
  <!--Регулятивный режим отчетности.-->
  <reportingRegime>
    <!--Наименование правил регулятивной отчетности.-->
    <name>RussianFederation</name>
  </reportingRegime>
  <nonStandardTerms>true</nonStandardTerms>
</partyTradeInformation>
<!--Дата сделки.-->
<tradeDate>2015-12-01</tradeDate>
</tradeHeader>
<!--Отчет по сделкам репо.-->
<nsdext:repoBulkReport>
  <!--Тип продукта.-->
  <productType>Other</productType>
  <!--Код классификации ПФИ.-->
  <productId>UKWN</productId>
  <!--Статус исполнения обязательств-->
  <nsdext:tradesObligationStatus>T</nsdext:tradesObligationStatus >
  <!--Дата расчетов по первой части.-->
  <nsdext:spotLegSettlementDate>2016-07-01</nsdext:spotLegSettlementDate>
  <!--Дата поставки по первой части.-->
  <nsdext:spotLegDeliveryDate>2016-07-01</nsdext:spotLegDeliveryDate>
  <!--Дата расчетов по второй части -->

```

```

<nsdext:forwardLegSettlementDate>2016-07-01</nsdext:forwardLegSettlementDate>
<!--Дата поставки по второй части.-->
<nsdext:forwardLegDeliveryDate>2016-07-01</nsdext:forwardLegDeliveryDate>
<!--Параметры контракта (1).-->
<nsdext:repos>
  <!--Контрагент 1.-->
  <nsdext:counterparty id="Counterparty1">
    <!--Идентификатор участника – репозитарный код.-->
    <partyId>NONREF</partyId>
    <!--Идентификатор участника – дополнительный Код (LEI, INN...)-->
    <partyId>INN_1234567890</partyId>
    <!--Наименование участника.-->
    <partyName>Контрагент 1</partyName>
    <!--Вид экономической деятельности-->
    <classification>Other</classification>
    <!--Страна.-->
    <country>RU</country>
    <!--Тип лица-->
    <organizationType>L</organizationType>
  </nsdext:counterparty>
  <!--Детали контракта 1 по контрагенту 1.-->
  <nsdext:repoDetails>
    <!--Идентификаторы сделки:
    "r" - Идентификатор сделки, присвоенный репозитарием;
    "p" - Идентификатор сделки, присвоенный участником;
    "u" - UTI сделки;
    "pid" - Код классификации ПФИ-->
    <nsdext:tradeId r="NONREF" p="TRADE1" u="UTI1" pid="REOFF"/>
    <!--Тип стороны.-->
    <nsdext:side>Buyer</nsdext:side>
    <!--Фиксированная ставка репо.-->
    <nsdext:rate>0.0512</nsdext:rate>
    <!--Сумма расчетов по первой части договора:
    "a" – Сумма
    "с" – Валюта-->
    <nsdext:spot a="1000" c="RUB"/>
    <!--Сумма расчетов по второй части договора:
    "a" – Сумма
    "с" – Валюта-->
    <nsdext:forward a="1000.14" c="RUB"/>
    <!--Акция.

```

"id" - Код базисного актива

"n" - Количество ценных бумаг

"p" - Цена единицы актива

"c" - Валюта цены-->

```
<nsdext:equity id="123456" n="5" p="200" c="RUB"/>
```

```
<!--Клиент Стороны.
```

"i" - Идентификатор

"t" - Тип клиента

"n" - Наименование

"c" - Страна-->

```
<nsdext:client i="PASS_1234 567890" t="P" n="Иванов Иван Иванович" c="RU"/>
```

```
<nsdext:client i="SNILS_000-000-000 02" t="P" n="Петров Петр Петрович" c="RU"/>
```

```
</nsdext:repoDetails>
```

```
<!--Детали контракта 2 по контрагенту 1-->
```

```
<nsdext:repoDetails>
```

```
<nsdext:tradeId r="NONREF" p="TRADE11" u="UTI2" pid="RDOLF"/>
```

```
<nsdext:side>Buyer</nsdext:side>
```

```
<!--Плавающая ставка репо
```

"f" - Плавающая ставка репо

"t" - Мультипликатор периода ставки

"p" - Тип временного периода ставки

"i" - Начальное значение плавающей ставки-->

```
<nsdext:floatingRate t="2" p="D" i="0.0512">RUB-RUONIA-OIS-  
COMPOUND</nsdext:floatingRate>
```

```
<nsdext:spot a="1000" c="RUB"/>
```

```
<nsdext:forward a="1000.14" c="RUB"/>
```

```
<!--Облигация.
```

"id" - Код базисного актива;

"n" - Номинальная сумма (Кол-во * номинал единицы БА);

"c" - Валюта-->

```
<nsdext:bond id="123456" n="1000" c="RUB"/>
```

```
</nsdext:repoDetails>
```

```
</nsdext:repos>
```

```
<!--Параметры контракта (2).-->
```

```
<nsdext:repos>
```

```
<!--Контрагент 2.-->
```

```
<nsdext:counterparty id="Counterparty2">
```

```
<!--Идентификатор участника – репозитарный код.-->
```

```
<partyId>NONREF</partyId>
```

```
<!--Идентификатор участника – дополнительный Код (LEI, INN...).-->
```

```
<partyId>INN_0987654321</partyId>
```

```
<!--Наименование участника.-->
```

```

        <partyName>Контрагент 2</partyName>
        <!--Вид экономической деятельности-->
        <classification>Other</classification>
        <!--Страна.-->
        <country>RU</country>
        <!--Тип лица-->
        <organizationType>L</organizationType>
    </nsdext:counterparty>
    <!--Детали контракта 1 по контрагенту 2-->
    <nsdext:repoDetails>
        <nsdext:tradeId r="NONREF" p="TRADE21" u="UTI3" pid="REOFF"/>
        <nsdext:side>Buyer</nsdext:side>
        <nsdext:rate>0.0512</nsdext:rate>
        <nsdext:spot a="1000" c="RUB"/>
        <nsdext:forward a="1000.14" c="RUB"/>
        <nsdext:equity id="123456" n="5" p="200" c="RUB"/>
    </nsdext:repoDetails>
    <!--Детали контракта 2 по контрагенту 2-->
    <nsdext:repoDetails>
        <nsdext:tradeId r="NONREF" p="TRADE31" u="UTI4" pid="REOLF"/>
        <nsdext:side>Buyer</nsdext:side>
        <nsdext:floatingRate t="1" p="D" i="0.0512">RUB-RUONIA-OIS-
COMPOUND</nsdext:floatingRate>
        <nsdext:spot a="1000" c="RUB"/>
        <nsdext:forward a="1000.14" c="RUB"/>
        <nsdext:equity id="123456" n="5" p="200" c="RUB"/>
        <nsdext:client i="PASS_1122 334455" t="P" n="Петров Петр Петрович" c="RU"/>
    </nsdext:repoDetails>
</nsdext:repos>
</nsdext:repoBulkReport>
<!--Обеспечение по сделке-->
<nsdext:collateral>
    <!--Тип обеспечения по договору.-->
    <nsdext:marginType>U</nsdext:marginType>
    <!--Форма обеспечения-->
    <nsdext:collateralForm>U</nsdext:collateralForm>
</nsdext:collateral>
<!--Специальные атрибуты сделок.-->
<nsdext:nsdSpecificTradeFields>
    <!--Обязанность централизованного клиринга-->
    <nsdext:cleared>N</nsdext:cleared>
    <!--Условия согласования параметров сделки (договора).-->

```

```

<nsdext:reconciliationType>FULL</nsdext:reconciliationType>
<!--Тип расчетов.-->
<nsdext:clearSettlementType>CS</nsdext:clearSettlementType>
<!--Метод расчетов.-->
<nsdext:clearSettlementMethod>C</nsdext:clearSettlementMethod>
<!--Способ подтверждения сделки.-->
<nsdext:confirmationMethod>MXME</nsdext:confirmationMethod>
<!--Признак связанности стороны 1 и стороны 2-->
<nsdext:partiesAreAffiliated>N</nsdext:partiesAreAffiliated>
<!--Регуляторный тип сделки.-->
<nsdext:regulatoryStatus>Repo</nsdext:regulatoryStatus>
<!--Дата начала срока действия договора.-->
<nsdext:startAgreementDate>2016-07-01</nsdext:startAgreementDate>
<!--Дата окончания срока действия договора.-->
<nsdext:endAgreementDate>2016-07-01</nsdext:endAgreementDate>
</nsdext:nsdSpecificTradeFields>
</trade>
<!--Участники Анкеты - Репозитарий.-->
<party id="TradeRepository">
  <!--Идентификатор участника – репозитарный код.-->
  <partyId>NDC000000000</partyId>
  <!--Идентификатор участника - LEI.-->
  <partyId>LEI_00000000000000000001</partyId>
  <!--Наименование участника.-->
  <partyName>НКО АО НРД</partyName>
</party>
<!--Участники Анкеты – Сторона1.-->
<party id="Party1">
  <!--Идентификатор участника – репозитарный код.-->
  <partyId>P00000000111</partyId>
  <!--Идентификатор участника – дополнительный Код (LEI, INN...)-->
  <partyId>LEI_00000000000000000001</partyId>
  <!--Наименование участника.-->
  <partyName>Клиент репозитария, Сторона</partyName>
  <!--Вид экономической деятельности-->
  <classification>Other</classification>
  <!--Страна.-->
  <country>RU</country>
  <!--Тип лица-->
  <organizationType>L</organizationType>
</party>

```

```

<!--Участники Анкеты – Сторона2.-->
<party id="Party2">
    <partyId>NONREF</partyId>
    <partyId>NONREF</partyId>
    <partyName>NONREF</partyName>
</party>
<!--Участники Анкеты – Отправитель сообщения (ИЛ).-->
<party id="Sender">
    <!--Идентификатор участника – репозитарный код.-->
    <partyId>P00000000111</partyId>
    <!--Идентификатор участника - LEI.-->
    <partyId>LEI_00000000000000000001</partyId>
    <!--Наименование участника.-->
    <partyName>Клиент репозитария</partyName>
</party>
</nonpublicExecutionReport>

```


XV. Проверки, вызывающие отказы в обработке сообщений

В соответствии с Указанием Банка России от 16.08.2016 4104-У, пункт 13:

Репозиторий отказывает во внесении записи, содержащей информацию о договоре, при нарушении следующих требований:

предоставление в репозиторий сообщения, содержащего информацию о договоре, заключенном на условиях Генерального соглашения, должно осуществляться с одновременным предоставлением в репозиторий информации о соответствующем Генеральном соглашении;

сообщение должно быть получено репозитарием от лица, являющегося стороной договора или информирующим лицом;

в сообщении должен содержаться международный код идентификации юридического лица - стороны договора, обязанной предоставлять информацию в репозиторий, а также информирующего лица (в случае его привлечения);

сообщение не может предоставляться для изменения уникального кода идентификации договора;

в сообщении должен содержаться уникальный код идентификации договора;

сообщение не должно содержать уникальный код идентификации договора, содержащийся в записи, ранее внесенной в раздел 2 реестра договоров, за исключением случаев, когда сообщение, содержащее уникальный код идентификации договора, предоставлено с целью изменения информации о договоре, указанном в [пункте 1](#) настоящего Указания, запись о котором была внесена в раздел 2 реестра договоров ранее;

сообщение должно быть составлено в соответствии с требованиями, предусмотренными правилами осуществления репозитарной деятельности.

Клиенты, при указании информации в отчетных формах, используют действующий формат сообщений Репозитария, являющийся неотъемлемой частью Правил осуществления репозитарной деятельности, который, наряду с требованиями в пункте 13 Указания, содержит дополнительные требования по наличию информации, указанной в разделах I – XIII данного документа и в случае отсутствия обязательной информации в сообщениях, Репозиторий направляет отказ с кодом ошибки [NRD001](#).

Также, для осуществления дополнительного контроля качества предоставляемой информации в Репозиторий, в рамках формата сообщений Репозитария, разработан список контролей, которые вызывают отказы в обработке сообщений.

Примечание: проверка не выполняется, если указанный для проверки тэг отсутствует во входящем сообщении (при условии, что по xsd-схеме допускается отсутствие тэга и нет дополнительных проверок его обязательного заполнения)

1. Проверка наименования стороны по договору, не являющейся клиентом Репозитария НРД

№	Описание проверки	Номер ошибки
1	partyName ≠ NONREF partyName ≠ NONAME partyName ≠ « » (пробел) Если условие не выполняется – отказ	NRD204

2. Проверка корректного указания кода клиента стороны

№	Описание проверки	Номер ошибки
1	Для классификатора и страны клиента стороны P, RU указывается код по маске PASS_ или SNILS	NRD143
2	Для классификатора и страны и клиента стороны L, F, RU указывается код по маске LEI_ или INN	NRD143
3	Для классификатора и страны клиента стороны P, не RU указывается код по маске OWN_ или PASS	NRD143
4	Для классификатора и страны клиента стороны L, F, не RU указывается код по маске LEI_ или SWIFT_ или BLOOM_ или THRTR_ или OWN_ или INN	NRD143

3. Проверка хронологии указания дат

№	Описание проверки	Номер ошибки
1	Для всех сделок	
1.1	Дата сделки ≤ Дата регистрации сообщения в журнале входящих сообщений (текущая дата) tradeDate ≤ Reg_date	NRD199

	Если условие не выполняется – отказ	
1.2	Дата сделки <= Дата совершения отчитываемого события tradeDate <= asOfDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
1.3	Дата начала срока действия договора <= Дата окончания срока действия договора startAgreementDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
2	Анкета валютного свопа (CM021 – fxSwap)	
2.1	Дата сделки <= Дата валютирования (1 части) tradeDate <= nearLeg/valueDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
2.2	Дата валютирования (1 части) <= Дата валютирования (2 части) nearLeg/valueDate <= farLeg/valueDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
2.3	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата валютирования (2 части) <= Дата окончания срока действия договора farLeg/valueDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226
3	Анкета конверсионной сделки (валютного форварда) (CM022 – fxSingleLeg)	
3.1	Дата сделки <= Дата валютирования tradeDate <= valueDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
3.2	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата валютирования <= Дата окончания срока действия договора. valueDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226
4	Анкета валютного опциона (CM023 – fxOption)	
4.1	Дата сделки <= Начальная дата <= Даты истечения американского/бермудского опциона <= Дата истечения tradeDate <= americanExercise/commencementDate или americanExercise/bermudaExerciseDates <= americanExercise/expiryDate Если условия не выполняются – отказ	NRD201
4.2	Дата сделки <= Дата истечения европейского опциона tradeDate <= europeanExercise/expiryDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
4.3	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора americanExercise/bermudaExerciseDates или americanExercise/expiryDate или europeanExercise/expiryDate <= endAgreementDate Если условия не выполняются – отказ	NRD226
5	Анкета бинарного валютного опциона (CM024 – fxDigitalOption)	
5.1	Дата сделки <= Начальная дата <= Даты истечения <= Дата истечения tradeDate <= americanExercise/commencementDate или americanExercise/bermudaExerciseDates <= americanExercise/expiryDate Если условия не выполняются – отказ	NRD201
5.2	Дата сделки <= Дата истечения tradeDate <= europeanExercise/expiryDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
5.3	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора americanExercise/bermudaExerciseDates/date или americanExercise/expiryDate или europeanExercise/expiryDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226
6	Анкета соглашения о будущей процентной ставке (CM031 – fra)	
6.1	Дата сделки <= Дата платежа tradeDate <= paymentDate Если условие не выполняется – отказ	NRD201
6.2	Дата сделки <= Дата истечения срока tradeDate <= adjustedTerminationDate	NRD201

	Если условие не выполняется – отказ	
6.3	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата платежа <= Дата окончания срока действия договора paymentDate, adjustedTerminationDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226
7	Анкета процентного свопа (CM032 – swap)	
7.1	Дата сделки <= Дата истечения срока tradeDate <= terminationDate Если условие не выполняется – отказ	NRD200
7.2	Дата сделки <= Дата истечения срока tradeDate <= terminationDate Если условие не выполняется – отказ	NRD200
7.3	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения срока <= Дата окончания срока действия договора terminationDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226
8	Анкета договора фиксации максимальной/ минимальной процентной ставки (CM033 – capFloor)	
8.1	Дата сделки <= Дата истечения срока tradeDate <= terminationDate Если условие не выполняется – отказ	NRD200
8.2	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения срока <= Дата окончания срока действия договора terminationDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226
9	Анкета свопциона (CM034 – swaption)	
9.1	Дата сделки <= Начальная дата <= Дата истечения tradeDate <= americanExercise/commencementDate <= americanExercise/expirationDate Если условие не выполняется – отказ	NRD200
9.2	Дата сделки <= Даты истечения tradeDate <= bermudaExercise/bermudaExerciseDates Если условие не выполняется – отказ	NRD199
9.3	Дата сделки <= Дата истечения tradeDate <= europeanExercise/expirationDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
9.4	Дата сделки <= Дата истечения срока tradeDate <= terminationDate Если условие не выполняется – отказ	NRD200
9.6	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения срока <= Дата окончания срока действия договора americanExercise/expirationDate или bermudaExercise/bermudaExerciseDates или europeanExercise/expirationDate <= terminationDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226
10	Анкета договора РЕПО (CM041 - repo)	
10.1	Дата сделки <= Дата расчетов (1 части) tradeDate <= spotLeg/settlementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
10.2	Дата расчетов (1 части) <= Дата расчетов (2 части) spotLeg/settlementDate <= forwardLeg/settlementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
10.3	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата расчетов (2 части) <= Дата окончания срока действия договора forwardLeg/settlementDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226
10.4	Дата сделки <= Дата поставки (1 части) tradeDate <= spotLeg/deliveryDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
10.5	Дата поставки (1 части) <= Дата поставки (2 части) spotLeg/deliveryDate <= forwardLeg/deliveryDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199

11	Анкета договора купли-продажи облигации (CM042 – bondSimpleTransaction)	
11.1	Дата сделки <= Дата расчетов tradeDate <= settlementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
11.2	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата расчетов <= Дата окончания срока действия договора settlementDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226
11.3	Дата сделки <= Дата поставки tradeDate <= deliveryDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
12	Анкета форварда на облигацию или индекс (CM043 bondForward)	
12.1	Дата сделки <= Дата расчетов tradeDate <= settlementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
12.2	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата расчетов <= Дата окончания срока действия договора settlementDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226
13	Анкета опциона на облигацию (CM044 – bondOption)	
13.1	Дата сделки <= Начальная дата <= Дата истечения tradeDate <= americanExercise/commencementDate <= americanExercise/expirationDate Если условия не выполняются – отказ	NRD200
13.2	Дата сделки <= Даты истечения tradeDate <= bermudaExercise/bermudaExerciseDates Если условие не выполняется – отказ	NRD199
13.3	Дата сделки <= Дата истечения tradeDate <= europeanExercise/expirationDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
13.4	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора americanExercise/expirationDate или bermudaExercise/bermudaExerciseDates или europeanExercise/expirationDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226
14	Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (CM045 – bondBasketOption)	
14.1	Дата сделки <= Начальная дата <= Дата истечения tradeDate <= americanExercise/commencementDate <= americanExercise/expirationDate Если условия не выполняются – отказ	NRD200
14.2	Дата сделки <= Даты истечения tradeDate <= bermudaExercise/bermudaExerciseDates Если условие не выполняется – отказ	NRD199
14.3	Дата сделки <= Дата истечения tradeDate <= europeanExercise/expirationDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
14.4	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора americanExercise/expirationDate или bermudaExercise/bermudaExerciseDates или europeanExercise/expirationDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226
15	Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (CM045 – bondBasketOption)	
15.1	Дата сделки <= Дата расчетов tradeDate <= settlementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
15.2	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата расчетов <= Дата окончания срока действия договора settlementDate <= endAgreementDate	NRD226

	Если условие не выполняется – отказ	
15.3	Дата сделки <= Дата поставки tradeDate <= deliveryDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
16	Анкета форварда на акцию (CM047 – equityForward)	
16.1	Дата сделки <= Дата расчетов tradeDate <= expirationDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
16.2	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата расчетов <= Дата окончания срока действия договора expirationDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226
17	Анкета опциона на акцию (CM048 equityOption)	
17.1	Дата сделки <= Начальная дата. <= Дата истечения tradeDate <= equityAmericanExercise/commencementDate <= equityAmericanExercise/expirationDate Если условия не выполняются – отказ	NRD200
17.2	Дата сделки <= Начальная дата <= Даты истечения <= Дата истечения tradeDate <= equityBermudaExercise/commencementDate <= equityBermudaExercise/bermudaExerciseDates <= equityBermudaExercise/:expirationDate Если условия не выполняются – отказ	NRD201
17.3	Дата сделки <= Дата истечения tradeDate <= equityEuropeanExercise/expirationDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
17.4	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора equityAmericanExercise/expirationDate или equityBermudaExercise/expirationDate или equityEuropeanExercise/expirationDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226
18	Анкета товарного форварда (CM051 – commodityForward)	
18.1	Дата сделки <= Даты платежей tradeDate <= fixedLeg/paymentDates Если условие не выполняется – отказ	NRD199
18.2	Дата сделки <= Даты поставки tradeDate <= commodityForwardPhysicalLeg/deliveryPeriods/periods Если условие не выполняется – отказ	NRD199
18.3	Дата сделки <= Даты платежей tradeDate <= floatingForwardLeg/paymentDates Если условие не выполняется – отказ	NRD199
18.4	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Даты платежей <= Дата окончания срока действия договора Max (fixedLeg/paymentDates, commodityForwardPhysicalLeg/deliveryPeriods/periods, floatingForwardLeg/paymentDates) <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226
19	Анкета товарного опциона (CM052 – commodityOption)	
19.1	Дата сделки <= Начальная дата <= Дата истечения tradeDate <= americanExercise/exercisePeriod/commencementDate <= americanExercise/exercisePeriod/expirationDate Если условия не выполняются – отказ	NRD200
19.2	Дата сделки <= Даты истечения tradeDate <= europeanExercise/expirationDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
19.3	Дата сделки <= Даты платежей tradeDate <= paymentDates Если условие не выполняется – отказ	NRD199
19.4	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора americanExercise/exercisePeriod/expirationDate или	NRD226

	europeanExercise/expirationDate, paymentDates <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	
20	Анкета товарного свопа (CM053 – commoditySwap)	
20.1	Дата сделки <= Даты платежей tradeDate <= fixedLeg/paymentDates Если условие не выполняется – отказ	NRD201
20.2	Дата сделки <= Дата истечения срока tradeDate <= terminationDate Если условие не выполняется – отказ	NRD201
20.3	Дата сделки <= Даты поставки tradeDate <= commoditySwapPhysicalLeg/deliveryPeriods/periods Если условия не выполняются – отказ	NRD201
20.4	Дата сделки <= Дата истечения срока tradeDate <= terminationDate Если условия не выполняются – отказ	NRD201
20.5	Дата сделки <= Даты платежей tradeDate <= floatingLegNsd/paymentDates Если условия не выполняются – отказ	NRD201
20.6	Дата сделки <= Дата истечения срока tradeDate <= terminationDate Если условия не выполняются – отказ	NRD201
20.4	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения срока <= Дата окончания срока действия договора terminationDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226
21	Анкета товарного свопциона (CM054 – commoditySwaption)	
21.1	Дата сделки <= Даты платежей tradeDate <= fixedLeg/paymentDates Если условия не выполняются – отказ	NRD201
21.2	Дата сделки <= Дата истечения срока tradeDate <= terminationDate Если условия не выполняются – отказ	NRD201
21.3	Дата сделки <= Даты поставки tradeDate <= commoditySwapPhysicalLeg/deliveryPeriods/periods Если условия не выполняются – отказ	NRD201
21.4	Дата сделки <= Дата истечения срока tradeDate <= terminationDate Если условия не выполняются – отказ	NRD201
21.5	Дата сделки <= Даты платежей tradeDate <= floatingLegNsd/paymentDates Если условия не выполняются – отказ	NRD201
21.6	Дата сделки <= Дата истечения срока tradeDate <= terminationDate Если условия не выполняются – отказ	NRD201
21.7	Дата сделки <= Начальная дата <= Дата истечения americanExercise/commencementDates <= americanExercise/expirationDates Если условия не выполняются – отказ	NRD200
21.8	Дата сделки <= Дата истечения tradeDate <= europeanExercise/expirationDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
21.9	Дата сделки <= Даты истечения tradeDate <= europeanExercise/expirationDates Если условие не выполняется – отказ	NRD199
21.10	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора americanExercise/expirationDates или europeanExercise/expirationDate или europeanExercise/expirationDates <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226
22	Анкета свопа дохода на облигацию (CM061 – bondSwap)	
22.1	Дата сделки <= Даты платежей	NRD199

	tradeDate <= bondReturn/paymentDates Если условие не выполняется – отказ	
22.2	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Даты платежей <= Дата окончания срока действия договора Max (interestLegPaymentDates, bondReturn/paymentDates) <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226
23	Анкета свопа дохода на акцию (CM062 – equitySwapTransactionSupplement)	
23.1	Дата сделки <= Дата платежа tradeDate <= rateOfReturn/paymentDates/paymentDateFinal Если условие не выполняется – отказ	NRD199
23.2	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата платежа <= Дата окончания срока действия договора Max (interestLegPaymentDates, rateOfReturn/paymentDates/paymentDateFinal) <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226
24	Анкета кредитного дефолтного свопа (CM071 – creditDefaultSwap)	
24.1	Дата сделки <= Плановая дата окончания срока. tradeDate <= scheduledTerminationDate Если условие не выполняется – отказ	NRD200
24.2	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Плановая дата окончания срока <= Дата окончания срока действия договора scheduledTerminationDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226
25	Анкета кредитного дефолтного свопциона (CM072 – creditDefaultSwapOption)	
25.1	Дата сделки <= Дата истечения срока tradeDate <= scheduledTerminationDate Если условие не выполняется – отказ	NRD200
25.2	Дата сделки <= Начальная дата <= Дата истечения tradeDate <= americanExercise/commencementDate <= americanExercise/expirationDate Если условия не выполняются – отказ	NRD200
25.3	Дата сделки <= Даты истечения tradeDate <= bermudaExercise/bermudaExerciseDates Если условие не выполняется – отказ	NRD199
25.4	Дата сделки <= Дата истечения tradeDate <= europeanExercise/expirationDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
25.5	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора americanExercise/expirationDate или bermudaExercise/bermudaExerciseDates или europeanExercise/expirationDate, scheduledTerminationDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется - отказ	NRD226
26	Анкета иной сделки (CM081 – generalProduct)	
26.1	Дата сделки <= Даты платежей tradeDate <= settlementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD199
26.3	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Даты платежей <= Дата окончания срока действия договора. settlementDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ	NRD226

4. Проверка последовательности указания частей сделки/валюты (валютный своп)

При заполнении сведений о первой и второй частях сделки «валютный своп» выполняется проверка последовательности указания валют, проверка на указание одной и той же валютной пары в обеих частях сделки.

№	Описание проверки	Номер Ошибки
---	-------------------	--------------

	Анкета валютного свопа (CM021 – fxSwap)	
1	<p>Currency1 = Currency1</p> <ul style="list-style-type: none"> nearLeg/exchangedCurrency1/paymentAmount/currency = nearLeg/exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency1 = farLeg/exchangedCurrency1/paymentAmount/currency = farLeg/exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency1 <p>Если условия не выполняются – отказ</p>	NRD202
2	<p>Currency2 = Currency2</p> <ul style="list-style-type: none"> nearLeg/exchangedCurrency2/paymentAmount/currency = nearLeg/exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency2 = farLeg/exchangedCurrency2/paymentAmount/currency = farLeg/exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency2 <p>Если условия не выполняются – отказ</p>	NRD202

5. Проверка на указание неотрицательного значения для полей типа «Количество» и «Номинальная сумма»

№	Описание проверки	Номер ошибки
1	Анкета валютного свопа (CM021 – fxSwap)	
1.1	<p>Проверить значения сумм: exchangedCurrency1/paymentAmount exchangedCurrency2/paymentAmount Если значение < 0, то отказ</p>	NRD233
2	Анкета конверсионной сделки (валютного форварда) (CM022 – fxSingleLeg)	
2.1	<p>Проверить значения сумм: exchangedCurrency1/paymentAmount exchangedCurrency2/paymentAmount Если значение < 0, то отказ</p>	NRD233
3.	Анкета валютного опциона (CM023 – fxOption)	
3.1	<p>Проверить значения сумм: putCurrencyAmount callCurrencyAmount premium/paymentAmount Если значение < 0, то отказ</p>	NRD233
4.	Анкета бинарного валютного опциона (CM024 – fxDigitalOption)	
4.1	<p>Проверить значения сумм: payout premium/paymentAmount Если значение < 0, то отказ</p>	NRD233
5.	Анкета соглашения о будущей процентной ставке (CM031 – fra)	
5.1	<p>Проверить значение суммы: notional Если значение < 0, то отказ</p>	NRD233
6.	Анкета процентного свопа (CM032 – swap)	
6.1	<p>Проверить значение суммы: notionalStepSchedule/initialValue knownAmountSchedule/initialValue Если значение < 0, то отказ</p>	NRD233
7.	Анкета договора фиксации максимальной/ минимальной процентной ставки (CM033 – capFloor)	
7.1	<p>Проверить значения сумм: notionalStepSchedule/initialValue premium/paymentAmount Если значение < 0, то отказ</p>	NRD233
8	Анкета свопциона (CM034 – swaption)	
8.1	<p>Проверить значения сумм: notionalStepSchedule/initialValue knownAmountSchedule/initialValue premium/paymentAmount Если значение < 0, то отказ</p>	NRD233

9.	Анкета договора РЕПО (CM041 - repo)	
9.1	Проверить значения: spotLeg/settlementAmount spotLeg/collateral/nominalAmount/amount* spotLeg/collateral/numberOfUnits* spotLeg/collateral/unitPrice/amount* forwardLeg/settlementAmount/amount Если значение <0, то отказ Поля блока <collateral> (отмечены *) не проверяются для сделок из шины СУО-Репозитарий	NRD203
10.	Анкета договора купли-продажи облигации (CM042 – bondSimpleTransaction)	
10.1	Проверить значения: notionalAmount price/cleanPrice Если значение < 0, то отказ	NRD203
11.	Анкета форварда на облигацию или индекс (CM043 – bondForward)	
11.1	Проверить значения: notionalAmount forwardPrice/forwardPricePercentage underlyer/singleUnderlyer/openUnits underlyer/basket/openUnits underlyer/basket/basketConstituent/constituentWeight/openUnits underlyer/basket/basketConstituent/constituentWeight/basketAmount Если значение < 0, то отказ	NRD203
12.	Анкета опциона на облигацию (CM044 – bondOption)	
12.1	Проверить значения: optionEntitlement numberOfOptions notionalAmount premium/paymentAmount strike/price/strikePrice strike/price/strikePercentage Если значение < 0, то отказ	NRD203
13	Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (CM045 – bondBasketOption)	
13.1	Проверить значения: notionalAmount optionEntitlement numberOfOptions premium/paymentAmount strike/price/strikePrice strike/price/strikePercentage basket/openUnits basket/basketConstituent/constituentWeight/openUnits basket/basketConstituent/constituentWeight/basketAmount Если значение < 0, то отказ	NRD203
14.	Анкета договора купли-продажи акции (CM046 – equitySimpleTransaction)	
14.1	Проверить значения: numberOfUnits unitPrice/amount Если значение < 0, то отказ	NRD203
15.	Анкета форварда на акцию (CM047 – equityForward)	
15.1	Проверить значения: forwardPrice/amount underlyer/singleUnderlyer/openUnits underlyer/basket/openUnits underlyer/basket/basketConstituent/constituentWeight/openUnits underlyer/basket/basketConstituent/constituentWeight/basketAmount Если значение < 0, то отказ	NRD203
16.	Анкета опциона на акцию (CM048 – equityOption)	
16.1	Проверить значения:	NRD203

	numberOfOptions optionEntitlement underlying/singleUnderlyer/openUnits underlying/basket/openUnits underlying/basket/basketConstituent/constituentWeight/openUnits underlying/basket/basketConstituent/constituentWeight/basketAmount equityPremium/paymentAmount strike/strikePrice Если значение < 0, то отказ	
17.	Анкета товарного форварда (CM051 – commodityForward)	
17.1	Проверить значения: floatingForwardLeg/totalNotionalQuantity commodityForwardPhysicalLeg/deliveryQuantity/totalPhysicalQuantity/quantity fixedLeg/totalPrice/amount fixedLeg/fixedPrice/price Если значение < 0, то отказ	NRD203
18.	Анкета товарного опциона (CM052 – commodityOption)	
18.1	Проверить значения: totalNotionalQuantity premium/paymentAmount weatherIndexStrikeLevel/quantity Если значение < 0, то отказ	NRD203
19.	Анкета товарного свопа (CM053 – commoditySwap)	
19.1	Проверить значения: floatingLegNsd/totalNotionalQuantity commoditySwapPhysicalLeg/deliveryQuantity/totalPhysicalQuantity/quantity fixedLeg/totalNotionalQuantity fixedLeg/totalPrice/amount floatingLegNsd/initialPrice weatherLeg/weatherIndexLevel/quantity Если значение < 0, то отказ	NRD203
20.	Анкета товарного свопциона (CM054 – commoditySwaption)	
20.1	Проверить значения: floatingLegNsd/totalNotionalQuantity commoditySwapPhysicalLeg/deliveryQuantity/totalPhysicalQuantity/quantity fixedLeg/totalNotionalQuantity fixedLeg/totalPrice/amount premium/paymentAmount floatingLegNsd/initialPrice weatherLeg/weatherIndexLevel/quantity Если значение < 0, то отказ	NRD203
21.	Анкета свопа дохода на облигацию (CM061 – bondSwap)	
21.1	Проверить значения: interestLeg/notional/notionalAmount/amount bondReturnLeg/underlyer/singleUnderlyer/openUnits bondReturnLeg/underlyer/basket/openUnits bondReturnLeg/underlyer/basket/basketConstituent/constituentWeight/openUnits bondReturnLeg/underlyer/basket/basketConstituent/constituentWeight/basketAmount/amount bondReturnLeg/notionalAmount/amount Если значение < 0, то отказ	NRD203
22.	Анкета свопа дохода на акцию (CM062 – equitySwapTransactionSupplement)	
22.1	Проверить значения: interestLeg/notional/notionalAmount/amount returnLeg/notional/notionalAmount/amount returnLeg/underlyer/singleUnderlyer/openUnits returnLeg/underlyer/basket/openUnits returnLeg/underlyer/basket/basketConstituent/constituentWeight/openUnits returnLeg/underlyer/basket/basketConstituent/constituentWeight/basketAmount/amount returnLeg/rateOfReturn/initialPrice/netPrice/amount	NRD203

	returnLeg/rateOfReturn/valuationPriceFinal/netPrice/amount Если значение < 0, то отказ	
23.	Анкета кредитного дефолтного свопа (CM071 – creditDefaultSwap)	
23.1	Проверить значение суммы: protectionTerms/calculationAmount Если значение < 0, то отказ	NRD203
24.	Анкета кредитного дефолтного свопциона (CM072 – creditDefaultSwapOption)	
24.1	Проверить значения: protectionTerms/calculationAmount/amount premium/paymentAmount notionalAmount/amount strike/spread strike/price Если значение < 0, то отказ	NRD203
25.	Анкета иной сделки (CM081 – generalProduct)	
25.1	Проверить значения сумм: party1Obligations/nominalAmount party2Obligations/nominalAmount Если значение < 0, то отказ	NRD203

6. Проверка корректности заполнения типа продукта (productType) в зависимости от параметров сообщения

№	Описание проверки	Номер ошибки
1	Анкета валютного свопа (CM021 – fxSwap)	
1.1	В качестве значения «Типа продукта» используется: ForeignExchange:FXSwap ForeignExchange:FXSwap:NonDerivative ForeignExchange:FXSwap:Cash Иначе – отказ	NRD208
1.2	Проверить, что: для ForeignExchange:FXSwap <ul style="list-style-type: none"> Метод расчетов ≠ "C" Код классификации ≠ "UKWN" для ForeignExchange:FXSwap:Cash <ul style="list-style-type: none"> Метод расчетов ≠ "P" Код классификации ≠ "UKWN" для ForeignExchange:FXSwap:NonDerivative <ul style="list-style-type: none"> Метод расчетов ≠ "C" Код классификации = "UKWN" Если условия не выполняются – отказ	NRD227
2	Анкета конверсионной сделки (валютного форварда) (CM022 – fxSingleLeg)	
2.1	В качестве значения «Типа продукта» используется: ForeignExchange:Forward ForeignExchange:NDF ForeignExchange:Term ForeignExchange:Spot Иначе – отказ	NRD208
2.2	Проверить, что: для ForeignExchange:Forward <ul style="list-style-type: none"> Метод расчетов ≠ "C" Код классификации ≠ "UKWN" для ForeignExchange:NDF <ul style="list-style-type: none"> Метод расчетов ≠ "P" Код классификации ≠ "UKWN" для ForeignExchange:Term <ul style="list-style-type: none"> Код классификации = "UKWN" для ForeignExchange:Spot	NRD227

	<ul style="list-style-type: none"> Код классификации = "UKWN" Разница между Датой валютирования и Датой сделки меньше 3-х рабочих дней <p>Если условия не выполняются – отказ</p>	
3.	Анкета валютного опциона (CM023 – fxOption)	
3.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>ForeignExchange:VanillaOption:American ForeignExchange:VanillaOption:Bermuda ForeignExchange:VanillaOption:European ForeignExchange:CashOption:American ForeignExchange:CashOption:Bermuda ForeignExchange:NDO ForeignExchange:SimpleExotic:Asian ForeignExchange:SimpleExotic:Barrier ForeignExchange:SimpleExotic:BarrierAsian Иначе – отказ</p>	NRD208
3.2	<p>Проверить, что:</p> <p>для ForeignExchange:VanillaOption:American</p> <ul style="list-style-type: none"> Выбран «Американский стиль исполнения опциона» Метод расчетов ≠ "C" <p>для ForeignExchange:VanillaOption:Bermuda</p> <ul style="list-style-type: none"> Выбран «Бермудский стиль исполнения опциона» Метод расчетов ≠ "C" <p>для ForeignExchange:VanillaOption:European</p> <ul style="list-style-type: none"> Выбран «Европейский стиль исполнения опциона» Метод расчетов ≠ "C" <p>для ForeignExchange:CashOption:American</p> <ul style="list-style-type: none"> Выбран «Американский стиль исполнения опциона» Метод расчетов ≠ "P" <p>для ForeignExchange:CashOption:Bermuda</p> <ul style="list-style-type: none"> Выбран «Бермудский стиль исполнения опциона» Метод расчетов ≠ "P" <p>для ForeignExchange:NDO</p> <ul style="list-style-type: none"> Выбран «Европейский стиль исполнения опциона» Метод расчетов ≠ "P" <p>для ForeignExchange:SimpleExotic:Asian</p> <ul style="list-style-type: none"> Заполнено «Условия азиатского опциона» Не заполнено «Условия барьерного опциона» <p>для ForeignExchange:SimpleExotic:Barrier</p> <ul style="list-style-type: none"> Не заполнено «Условия азиатского опциона» Заполнено «Условия барьерного опциона» <p>для ForeignExchange:SimpleExotic:BarrierAsian</p> <ul style="list-style-type: none"> Заполнено «Условия азиатского опциона» Заполнено «Условия барьерного опциона» <p>Если условия не выполняются – отказ</p>	NRD227
4.	Анкета бинарного валютного опциона (CM024 – fxDigitalOption)	
4.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>ForeignExchange:SimpleExotic:Digital:American ForeignExchange:SimpleExotic:Digital:Bermuda ForeignExchange:SimpleExotic:Digital:European Иначе – отказ</p>	NRD208
4.2	<p>Проверить, что:</p> <p>для ForeignExchange:SimpleExotic:Digital:American выбран «Американский стиль и условия касания»</p> <p>для ForeignExchange:SimpleExotic:Digital:European выбран «Европейский стиль и условия касания»</p> <p>для ForeignExchange:SimpleExotic:Digital:Bermuda выбран «Бермудский стиль и условия касания»</p> <p>Если условия не выполняются – отказ</p>	NRD227
5.	Анкета соглашения о будущей процентной ставке (CM031 – fra)	

5.1	В качестве значения «Типа продукта» используется: InterestRate:FRA Иначе – отказ	NRD208
6.	Анкета процентного свопа (CM032 – swap)	
6.1	В качестве значения «Типа продукта» используется: InterestRate:IRSwap:FixedFloat InterestRate:IRSwap:FixedFixed InterestRate:IRSwap:Basis InterestRate:IRSwap:OIS InterestRate:CrossCurrency:Basis InterestRate:CrossCurrency:FixedFloat InterestRate:CrossCurrency:FixedFixed Иначе – отказ	NRD208
6.2	<p>Проверить, что:</p> <p>Заполнены два блока «Платежи по свопу» для InterestRate:IRSwap:FixedFloat</p> <ul style="list-style-type: none"> Для одного платежа по свопу указан выбор «График фиксированной ставки» или «График известных сумм», для другого – «Определение плавающей ставки» или «График известных сумм» Валюта первого платежа = валюте второго платежа <p>для InterestRate:IRSwap:FixedFixed</p> <ul style="list-style-type: none"> Для двух платежей по свопу указан выбор «График фиксированной ставки» или «График известных сумм» Валюта первого платежа = валюте второго платежа <p>для InterestRate:IRSwap:Basis</p> <ul style="list-style-type: none"> Для двух платежей по свопу указан выбор «Определение плавающей ставки» Валюта первого платежа = валюте второго платежа <p>для InterestRate:IRSwap:OIS</p> <ul style="list-style-type: none"> Для одного платежа по свопу указан выбор «График фиксированной ставки», для другого – «Определение плавающей ставки» Валюта первого платежа = валюте второго платежа <p>для InterestRate:CrossCurrency:Basis</p> <ul style="list-style-type: none"> Для двух платежей по свопу указан выбор «Определение плавающей ставки» Валюта первого платежа ≠ валюте второго платежа <p>для InterestRate:CrossCurrency:FixedFloat</p> <ul style="list-style-type: none"> Для одного платежа по свопу указан выбор «График фиксированной ставки» или «График известных сумм», для другого – «Определение плавающей ставки» или «График известных сумм» Валюта первого платежа ≠ валюте второго платежа <p>для InterestRate:CrossCurrency:FixedFixed</p> <ul style="list-style-type: none"> Для двух платежей по свопу указан выбор «График фиксированной ставки» или «График известных сумм» Валюта первого платежа ≠ валюте второго платежа <p>Если условия не выполняются – отказ</p>	NRD227
7.	Анкета договора фиксации максимальной/ минимальной процентной ставки (CM033 – capFloor)	
7.1	В качестве значения «Типа продукта» используется: InterestRate:CapFloor:Cap InterestRate:CapFloor:Floor InterestRate:CapFloor:Collar InterestRate:CapFloor:Straddle Иначе – отказ	NRD208
7.2	<p>Проверить, что:</p> <p>Не заполнен выбор «График фиксированной ставки» для InterestRate:CapFloor:Cap</p> <ul style="list-style-type: none"> Заполнено «График максимума ставки» Не заполнено «График минимума ставки» <p>для InterestRate:CapFloor:Floor</p>	NRD227

	<ul style="list-style-type: none"> • Не заполнено «График максимума ставки» • Заполнено «График минимума ставки» для InterestRate:CapFloor:Collar <ul style="list-style-type: none"> • Заполнено «График максимума ставки» • Заполнено «График минимума ставки» для InterestRate:CapFloor:Straddle <ul style="list-style-type: none"> • Заполнено «График максимума ставки» • Заполнено «График минимума ставки» Если условия не выполняются – отказ	
8	Анкета свопциона (CM034 – swaption)	
8.1	В качестве значения «Типа продукта» (productType и swap/productType – единый код) используется: InterestRate:Option:Swaption:American InterestRate:Option:Swaption:European InterestRate:Option:Swaption:Bermuda Иначе – отказ	NRD208
8.2	Проверить, что: для InterestRate:Option:Swaption:American выбран «Американский стиль исполнения» для InterestRate:Option:Swaption:European выбран «Европейский стиль исполнения» для InterestRate:Option:Swaption:Bermuda выбран «Бермудский стиль исполнения» Если условия не выполняются – отказ	NRD227
9.	Анкета договора РЕПО (CM041 - repo)	
9.1	В качестве значения «Типа продукта» используется: CrossAsset:Repo:BasketRepo InterestRate:Repo:BondRepo Equity:Repo:EquityRepo Иначе – отказ	NRD208
9.2	Проверить, заполнен ли тэг spotLeg/collateral (обеспечение по первой части РЕПО). Если не заполнен либо отсутствует – отказ	NRD001
9.3	Проверить, что для InterestRate:Repo:BondRepo указан идентификатор облигации bond/instrumentId (и только один); для Equity:Repo:EquityRepo указан идентификатор акции equity/instrumentId (и только один) Если условия не выполняются – отказ	
10.	Анкета договора купли-продажи облигации (CM042 – bondSimpleTransaction)	
10.1	В качестве значения «Типа продукта» используется: InterestRate:Other:DebtSpot InterestRate:Other:DebtTerm Иначе – отказ	NRD208
10.2	Проверить, что для InterestRate:Other:DebtSpot разница между Датой расчетов и Датой сделки < 3-х рабочих дней; для InterestRate:Other:DebtTerm разница между Датой расчетов и Датой сделки >= 3 рабочих дней Если условия не выполняются – отказ	NRD227
11.	Анкета форварда на облигацию или индекс (CM043 bondForward)	
11.1	В качестве значения «Типа продукта» используется: InterestRate:Forward:DebtForward:SingleName InterestRate:Forward:DebtForward:SingleIndex InterestRate:Forward:DebtForward:Basket InterestRate:Forward:DebtForward:BasketIndex Иначе – отказ	NRD208
11.2	Проверить, что для InterestRate:Forward:DebtForward:SingleName в выборе «Единичный базовый актив» указан базовый актив «Облигация»;	NRD227

	<p>для InterestRate:Forward:DebtForward:SingleIndex в выборе «Единичный базовый актив» указан базовый актив «Индекс»;</p> <p>для InterestRate:Forward:DebtForward:Basket в выборе «Корзина базовый активов» указан базовый актив «Облигация», причем элемент «Идентификатор базового актива» имеет более одного значения;</p> <p>для InterestRate:Forward:DebtForward:BasketIndex в выборе «Корзина базовый активов» указан базовый актив «Индекс», причем элемент «Идентификатор базового актива» имеет более одного значения</p> <p>Если условия не выполняются – отказ</p>	
12	Анкета опциона на облигацию (CM044 – bondOption)	
12.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>InterestRate:Option:DebtOption:SingleName</p> <p>Иначе – отказ</p>	NRD208
13	Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (CM045 – bondBasketOption)	
13.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>InterestRate:Option:DebtOption:SingleIndex</p> <p>InterestRate:Option:DebtOption:Basket</p> <p>InterestRate:Option:DebtOption:BasketIndex</p> <p>Иначе – отказ</p>	NRD208
13.2	<p>Проверить, что:</p> <p>для InterestRate:Option:DebtOption:SingleIndex в выборе базового актива указан «Индекс»;</p> <p>для InterestRate:Option:DebtOption:Basket в выборе «Корзина» указан базовый актив «Облигация», причем элемент «Идентификатор базового актива» имеет более одного значения;</p> <p>для InterestRate:Option:DebtOption:BasketIndex в выборе «Корзина» указан базовый актив «Индекс», причем элемент «Идентификатор базового актива» имеет более одного значения.</p> <p>Если условия не выполняются – отказ</p>	NRD227
14.	Анкета договора купли-продажи акции (CM046 – equitySimpleTransaction)	
14.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>Equity:Other:EquitySpot</p> <p>Equity:Other:EquityTerm</p> <p>Иначе – отказ</p>	NRD208
14.2	<p>Проверить, что</p> <p>для Equity:Other:EquitySpot разница между Датой расчетов и Датой сделки < 3-х рабочих дней;</p> <p>для Equity:Other:EquityTerm разница между Датой расчетов и Датой сделки >= 3 рабочих дней</p> <p>Если условия не выполняются – отказ</p>	NRD227
15.	Анкета форварда на акцию (CM047 – equityForward)	
15.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>Equity:Forward:PriceReturnBasicPerformance:SingleName</p> <p>Equity:Forward:PriceReturnBasicPerformance:Basket</p> <p>Иначе – отказ</p>	NRD208
15.2	<p>Проверить, что:</p> <p>для Equity:Forward:PriceReturnBasicPerformance:SingleName в выборе «Единичный базовый актив» указан базовый актив «Акция»;</p> <p>для Equity:Forward:PriceReturnBasicPerformance:Basket в выборе «Корзина базовый активов» указан базовый актив «Акция», причем элемент «Идентификатор базового актива» имеет более одного значения</p> <p>Если условия не выполняются – отказ</p>	NRD227
16.	Анкета опциона на акцию (CM048 equityOption)	
16.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>Equity:Option:PriceReturnBasicPerformance:SingleName</p> <p>Equity:Option:PriceReturnBasicPerformance:Basket</p> <p>Иначе – отказ</p>	NRD208
16.2	Проверить, что:	NRD227

	<p>для Equity:Option:PriceReturnBasicPerformance:SingleName в выборе «Единичный базовый актив» указан базовый актив «Акция»;</p> <p>для Equity:Option:PriceReturnBasicPerformance:Basket в выборе «Корзина базовый активов» указан базовый актив «Акция», причем элемент «Идентификатор базового актива» имеет более одного значения.</p> <p>Если условия не выполняются – отказ</p>	
17.	Анкета товарного форварда (CM051 – commodityForward)	
17.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>Commodity:Forward:Physical</p> <p>Commodity:Forward:Cash</p> <p>Иначе – отказ</p>	NRD208
17.2	<p>Проверить, что:</p> <p>для Commodity:Forward:Physical заполнено «Поставочная часть товарной сделки»;</p> <p>для Commodity:Forward:Cash заполнено «Товарная часть расчетного форварда»</p> <p>Если условия не выполняются – отказ</p>	NRD227
18.	Анкета товарного опциона (CM052 – commodityOption)	
18.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>Commodity:Option:American</p> <p>Commodity:Option:European</p> <p>Commodity:Option:Asian</p> <p>Commodity:Option:Weather:American</p> <p>Commodity:Option:Weather:European</p> <p>Иначе – отказ</p>	NRD208
18.2	<p>Проверить, что:</p> <p>для Commodity:Option:American выбран тип «Товарный опцион» и «Американский стиль исполнения»;</p> <p>для Commodity:Option:European выбран тип «Товарный опцион» и «Европейский стиль исполнения»;</p> <p>для Commodity:Option:Asian в выборе способа определения расчетных периодов используется вариант выбора «Расчетные периоды»;</p> <p>для Commodity:Option:Weather:American выбран тип «Погодный опцион» и «Американский стиль исполнения»;</p> <p>для Commodity:Option:Weather:European выбран тип «Погодный опцион» и «Европейский стиль исполнения»</p> <p>Если условия не выполняются – отказ</p>	NRD227
19.	Анкета товарного свопа (CM053 – commoditySwap)	
19.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>Commodity:Swap:Cash</p> <p>Commodity:Swap:Physical</p> <p>Commodity:Swap:Cash:Weather</p> <p>Иначе – отказ</p>	NRD208
19.2	<p>Проверить, что:</p> <p>для Commodity:Swap:Cash в выборе «Товарная часть контракта своп» указаны две части свопа, одна из которых – «Часть сделки с фиксированной ценой», другая – «Часть сделки с плавающей ценой»;</p> <p>для Commodity:Swap:Physical в выборе «Товарная часть контракта своп» указаны две части свопа, одна из которых – «Часть сделки с фиксированной ценой» или «Часть сделки с плавающей ценой», другая – «Поставочная часть товарной сделки»;</p> <p>для Commodity:Swap:Cash:Weather заполнен «Поток по сделке погодного свопа»</p> <p>Если условия не выполняются – отказ</p>	NRD227
20.	Анкета товарного свопциона (CM054 – commoditySwaption)	
20.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>Commodity:Swaption:American</p> <p>Commodity:Swaption:European</p> <p>Иначе – отказ</p>	NRD208

20.2	<p>Проверить, что для Commodity:SwapOption:American выбран «Американский стиль исполнения»; для Commodity:SwapOption:European выбран «Европейский стиль исполнения» Если условия не выполняются – отказ</p>	NRD227
21.	Анкета свопа дохода на облигацию (CM061 – bondSwap)	
21.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется: InterestRate:Swap:BondSwap:SingleName InterestRate:Swap:BondSwap:SingleIndex InterestRate:Swap:BondSwap:Basket Иначе – отказ</p>	NRD208
21.2	<p>Проверить, что: Указаны два потока по свопу активов, один из которых – «Суммы фиксированного дохода», другой – «Суммы дохода от облигации»; для InterestRate:Swap:BondSwap:SingleName В потоке «Суммы дохода от облигации» в выборе «Единичный базовый актив» указан базовый актив «Облигация»; для InterestRate:Swap:BondSwap:SingleIndex В потоке «Суммы дохода от облигации» в выборе «Единичный базовый актив» указан базовый актив «Индекс»; для InterestRate:Swap:BondSwap:Basket В потоке «Суммы дохода от облигации» в выборе «Корзина базовых активов» указан базовый актив «Облигация», причем элемент «Идентификатор базового актива» имеет более одного значения Если условия не выполняются – отказ</p>	NRD227
22.	Анкета свопа дохода на акцию (CM062 – equitySwapTransactionSupplement)	
22.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется: Equity:Swap:PriceReturnBasicPerformance:SingleName Equity:Swap:PriceReturnBasicPerformance:SingleIndex Equity:Swap:PriceReturnBasicPerformance:Basket Иначе – отказ</p>	NRD208
22.2	<p>Проверить, что: Указаны два потока по свопу активов, один из которых – «Суммы фиксированного дохода», другой – «Суммы дохода от актива»; для Equity:Swap:PriceReturnBasicPerformance:SingleName В потоке «Суммы дохода от актива» в выборе «Единичный базовый актив» указан базовый актив «Акция»; для Equity:Swap:PriceReturnBasicPerformance:SingleIndex В потоке «Суммы дохода от актива» в выборе «Единичный базовый актив» указан базовый актив «Индекс»; для Equity:Swap:PriceReturnBasicPerformance:Basket в потоке «Суммы дохода от актива» в выборе «Корзина базовых активов» указан базовый актив «Акция», причем элемент «Идентификатор базового актива» имеет более одного значения. Если условия не выполняются – отказ</p>	NRD227
23.	Анкета кредитного дефолтного свопа (CM071 – creditDefaultSwap)	
23.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется: Credit:Swap:Index:Cash Credit:Swap:SingleName:Cash Credit:Swap:SingleName:Physical Credit:Swap:MultipleName:Cash Credit:Swap:MultipleName:Physical Иначе – отказ</p>	NRD208
23.2	<p>Проверить, что для Credit:Swap:Index:Cash <ul style="list-style-type: none"> В выборе типа референсного обязательства указана «Референсная информация об индексе» для Credit:Swap:SingleName:Cash <ul style="list-style-type: none"> В выборе типа референсного обязательства указана «Информация о </p>	NRD227

	<p>референсном лице» и «Референсное обязательство»</p> <ul style="list-style-type: none"> • Метод расчетов ≠ "P" <p>для Credit:Swap:SingleName:Physical</p> <ul style="list-style-type: none"> • В выборе типа референсного обязательства указана «Информация о референсном лице» и «Референсное обязательство» • Метод расчетов ≠ "C" <p>для Credit:Swap:MultipleName:Cash</p> <ul style="list-style-type: none"> • В выборе типа референсного обязательства указана «Референсная информация о корзине» • Метод расчетов ≠ "P" <p>для Credit:Swap:MultipleName:Physical</p> <ul style="list-style-type: none"> • В выборе типа референсного обязательства указана «Референсная информация о корзине» • Метод расчетов ≠ "C" <p>Если условия не выполняются – отказ</p>	
24.	Анкета кредитного дефолтного свопциона (CM072 – creditDefaultSwapOption)	
24.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» (productType и creditDefaultSwap/productType – единый код) используется:</p> <p>Credit:SwapOption:American</p> <p>Credit:SwapOption:European</p> <p>Credit:SwapOption:Bermuda</p> <p>Иначе – отказ</p>	NRD208
24.2	<p>Проверить, что</p> <p>для Credit:SwapOption:American выбран «Американский стиль исполнения»;</p> <p>для Credit:SwapOption:European выбран «Европейский стиль исполнения»;</p> <p>для Credit:SwapOption:Bermuda выбран «Бермудский стиль исполнения»</p> <p>Если условия не выполняются – отказ</p>	NRD227
	<p>Отчет по сделкам репо (CM083)</p> <p>Отчет по сделкам валютный своп (CM084)</p> <p>Отчет по конверсионным сделкам (CM085)</p>	
25	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется: Other</p> <p>Иначе – отказ</p>	NRD208

7. Проверка корректности указания покупателя/продавца и плательщика/покупателя по первой и второй частям договора РЕПО и валютного свопа

№	Описание проверки	Номер ошибки
1	Анкета договора РЕПО (CM041 - repo)	
1.1	<p>Проверить, что:</p> <ul style="list-style-type: none"> • spotLeg/buyerPartyReference = forwardLeg/sellerPartyReference • spotLeg/sellerPartyReference = forwardLeg/buyerPartyReference <p>Если условие не выполняется – отказ</p>	NRD209
2	Анкета валютного свопа (CM021 – fxSwap)	
2.1	<p>Проверить, что:</p> <ul style="list-style-type: none"> • nearLeg/exchangedCurrency1/payerPartyReference = nearLeg/exchangedCurrency2/receiverPartyReference = farLeg/exchangedCurrency1/receiverPartyReference = farLeg/exchangedCurrency2/payerPartyReference • nearLeg/exchangedCurrency1/receiverPartyReference = nearLeg/exchangedCurrency2/payerPartyReference = farLeg/exchangedCurrency1/payerPartyReference = farLeg/exchangedCurrency2/receiverPartyReference <p>Если условие не выполняется – отказ</p>	NRD209

8. Контроль отсутствия неиспользуемых элементов

№	Описание проверки	Номер ошибки
1	Анкета договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки (CM033 – capFloor)	
1.1	Проверить отсутствие элементов:	NRD210

	calculation/fixedRateSchedule knownAmountSchedule principalExchanges Если элемент присутствует – отказ	
2	Анкета форварда на облигацию или индекс (CM043 bondForward)	
2.1	Проверить отсутствие элементов: singleUnderlyer/basket singleUnderlyer/commodity singleUnderlyer/equity basket/basketConstituent/basket basket/basketConstituent/commodity basket/basketConstituent/equity Если элемент присутствует – отказ	NRD210
3	Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (CM045 – bondBasketOption)	
3.1	Проверить отсутствие элементов: basket/basketConstituent/basket basket/basketConstituent/commodity basket/basketConstituent/equity Если элемент присутствует – отказ	NRD210
4	Анкета форварда на акцию (CM047 – equityForward)	
4.1	Проверить отсутствие элементов: singleUnderlyer/basket singleUnderlyer/bond singleUnderlyer/commodity singleUnderlyer/index basket/basketConstituent/basket basket/basketConstituent/bond basket/basketConstituent/commodity basket/basketConstituent/index equityExercise/equityAmericanExercise equityExercise/equityBermudaExercise feature Если элемент присутствует – отказ	NRD210
5	Анкета опциона на акцию (CM048 equityOption)	
5.1	Проверить отсутствие элементов: singleUnderlyer/basket singleUnderlyer/bond singleUnderlyer/commodity singleUnderlyer/index basket/basketConstituent/basket basket/basketConstituent/bond basket/basketConstituent/commodity basket/basketConstituent/index Если элемент присутствует – отказ	NRD210
6	Анкета свопа дохода на облигацию (CM061 – bondSwap)	
6.1	Проверить отсутствие элементов: returnLeg bondReturnLeg/underlyer/singleUnderlyer/basket bondReturnLeg/underlyer/singleUnderlyer/commodity bondReturnLeg/underlyer/singleUnderlyer/equity bondReturnLeg/underlyer/basket/basketConstituent/basket bondReturnLeg/underlyer/basket/basketConstituent/commodity bondReturnLeg/underlyer/basket/basketConstituent/equity Если элемент присутствует – отказ	NRD210
7	Анкета свопа дохода на акцию (CM062 – equitySwapTransactionSupplement)	
7.1	Проверить отсутствие элементов: bondReturnLeg returnLeg/underlyer/singleUnderlyer/basket	NRD210

	returnLeg/underlyer/singleUnderlyer/bond returnLeg/underlyer/singleUnderlyer/commodity returnLeg/underlyer/basket/basketConstituent/basket returnLeg/underlyer/basket/basketConstituent/bond returnLeg/underlyer/basket/basketConstituent/commodity Если элемент присутствует – отказ	
--	--	--

9. Проверка кода классификации ПФИ и РЕПО

№	Описание проверки	Номер ошибки
1.	Для сообщений CM021, CM032, CM053, CM061, CM062, CM071, CM084	
1.1	Проверить заполнение Кода классификации ПФИ 1) Если productId = 7 символов и <ul style="list-style-type: none"> 1-ый символ = 'S' и 2-ой символ является одним из группы {'V','P','G','C','A','M'} и 3-ий символ является одним из группы {'F','V','D','X'} и 4-ый символ является одним из группы {'A','H','W','N','X'} и 5-ый символ является одним из группы {'F','N'} и 6-ой символ является одним из группы {'E','T','W','N'} и 7-ой символ является одним из группы {'U','D','W','N'} 2) Или (Метод расчетов = 'P' или 'E') и productId ='UKWN' 3) Или тип сообщения CM084 и productId ='UKWN' – проверка пройдена, иначе отказ	NRD228
2.	Для сообщений CM023, CM024, CM034, CM044, CM045, CM048, CM052, CM054, CM072	
2.1	Проверить заполнение Кода классификации ПФИ: Если productId = 6 символов и <ul style="list-style-type: none"> 1-ый символ = 'O' и 2-ой символ является одним из группы {'P','C','Z'} и 3-ий символ является одним из группы {'A','E','B'} и 4-ый символ является одним из группы {'F','L','X'} и 5-ый символ является одним из группы {'N','B','D','M','X'} и 6-ой символ является одним из группы {'E','D','C','V','A','X','M'} – проверка пройдена, иначе отказ	NRD228
3.	Для сообщений CM022, CM031, CM043, CM047, CM051, CM085	
3.1	Проверить заполнение Кода классификации ПФИ: 1) Если productId = 5 символов и <ul style="list-style-type: none"> 1-ый символ = 'F' и 2-ой символ является одним из группы {'E','D','C','V','A','X','M'} и 3-ий символ является одним из группы {'O','W','S'} и 4-ый символ является одним из группы {'F','L','R'} и 5-ый символ является одним из группы {'E','N'} 2) Или (Метод расчетов = 'P' или 'E') и productId ='UKWN' 3) Или тип сообщения CM022 или CM085 и productId ='UKWN' – проверка пройдена, иначе отказ	NRD228
4.	Для сообщений CM041, CM083	
4.1	Проверить заполнение Кода классификации договоров РЕПО: 1) Если productId = 5 символов и <ul style="list-style-type: none"> 1-ый символ = 'R' и 2-ой символ является одним из группы {'E','D','X'} и 3-ий символ является одним из группы {'O','W','S'} и 4-ый символ является одним из группы {'F','Z','L','R'} и 5-ый символ является одним из группы {'F','E','O'} 2) Или тип сообщения CM083 и productId ='UKWN' – проверка пройдена, иначе отказ	NRD228
5.	Для сообщений CM042, CM046	
5.1	Проверить заполнение Кода классификации ПФИ: Если productId ='UKWN' – проверка пройдена, иначе отказ	NRD228
6.	Для сообщений CM081	
6.1	Проверить заполнение Кода классификации ПФИ:	NRD228

	Если productId содержит от 4 до 7 символов, либо 'UKWN', либо соответствует условиям, описанным в данной таблице в п. 1.1 либо 2.1 либо 3.1 либо 4.1 (в зависимости от 1-го символа кода 'S','O','F' или 'R') – проверка пройдена, иначе отказ	
7.	Для сообщений CM033	
7.1	Проверить заполнение Кода классификации ПФИ: Если productId соответствует условиям, описанным в данной таблице в п. 1.1 либо 2.1 либо 3.1 – проверка пройдена, иначе отказ	NRD228

10. Проверка параметров, влияющих на расчет объема по сделке

Проверки предназначены для выявления случаев, когда указанные в анкете параметры могут противоречить экономическому смыслу инструмента, что может повлиять на корректность расчета объема договора как на стороне Репозитория, так и на стороне Банка России.

Если сравниваемые суммы выражены в различных валютах, в процессе выполнения проверки они конвертируются в рубли по официальному курсу Банка России на дату сделки.

№	Описание проверки	Номер ошибки
1.	Анкета валютного опциона (CM023 – fxOption)	
1.1	Проверить, что отношение номинальной суммы <i>putCurrencyAmount</i> к премии <i>premium/paymentAmount</i> $\Rightarrow 1$ Если значение $< 0,9$, то отказ Если премия = 0, проверка не выполняется	NRD229
2.	Анкета бинарного валютного опциона (CM024 – fxDigitalOption)	
2.1	Проверить, что отношение суммы выплаты <i>payout</i> к премии <i>premium/paymentAmount</i> $\Rightarrow 1$ Если значение $< 0,9$, то отказ Если премия = 0, проверка не выполняется	NRD229
3.	Анкета договора фиксации максимальной/ минимальной процентной ставки (CM033 – capFloor)	
3.1	Проверить, что отношение номинальной суммы <i>notionalStepSchedule/initialValue</i> к премии <i>premium/paymentAmount</i> $\Rightarrow 1$ Если значение $< 0,9$, то отказ Если премия = 0, проверка не выполняется	NRD229
4	Анкета свопциона (CM034 – swaption)	
4.1	Проверить, что отношение номинальной суммы <i>notionalStepSchedule/initialValue</i> или <i>knownAmountSchedule/initialValue</i> к премии <i>premium/paymentAmount</i> $\Rightarrow 1$ Если значение $< 0,9$, то отказ Если премия = 0, проверка не выполняется	NRD229
5.	Анкета опциона на облигацию (CM044 – bondOption)	
5.1	Проверить, что отношение номинальной суммы <i>notionalAmount</i> к премии <i>premium/paymentAmount</i> $\Rightarrow 1$ Если значение $< 0,9$, то отказ Если премия = 0, проверка не выполняется	NRD229
6.	Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (CM045 – bondBasketOption)	
6.1	Проверить, что отношение номинальной суммы <i>notionalAmount</i> к премии <i>premium/paymentAmount</i> $\Rightarrow 1$ Если значение $< 0,9$, то отказ Если премия = 0, проверка не выполняется	NRD229
7.	Анкета опциона на акцию (CM048 equityOption)	
7.1	Проверить, что отношение совокупного количества базового актива по договору (определяется как произведение количества опционов <i>numberOfOptions</i> и объема опциона <i>optionEntitlement</i>) к лоту актива <i>openUnits</i> = 1 (если частое от деления – дробное число, например, 0,99 или 1,01, то оно округляется до целого) Если условие не выполняется, то отказ	NRD230
7.2	Проверить, что отношение расчетной номинальной суммы (определяется как произведение количества опционов <i>numberOfOptions</i> , объема опциона <i>optionEntitlement</i> и цены исполнения <i>strikePrice</i>) к премии <i>premium/paymentAmount</i> $\Rightarrow 1$	NRD229

	Если значение < 1, то отказ Если премия = 0, проверка не выполняется	
8.	Анкета товарного опциона (CM052 – commodityOption)	
8.1	Проверить, что отношение расчетной номинальной суммы (определяется как произведение общего номинального количества базового актива <i>totalNotionalQuantity</i> и цены исполнения <i>strikePricePerUnit</i>) к премии <i>premium/paymentAmount</i> => 1 Если значение < 0,9, то отказ Если премия = 0, проверка не выполняется	NRD229
9.	Анкета товарного свопциона (CM054 – commoditySwaption)	
9.1	Проверить, что отношение расчетной номинальной суммы (определяется как произведение общего номинального количества базового актива <i>totalNotionalQuantity</i> либо <i>weatherNotionalAmount</i> и цены базового актива <i>initialPrice</i> либо <i>weatherIndexLevel</i>) к премии <i>premium/paymentAmount</i> => 1 Если значение < 0,9, то отказ Если премия = 0, проверка не выполняется	NRD229
10.	Анкета кредитного дефолтного свопциона (CM072 – creditDefaultSwapOption)	
10.1	Проверить, что отношение номинальной суммы <i>calculationAmount</i> к премии <i>premium/paymentAmount</i> => 1 Если значение < 0,9, то отказ Если премия = 0, проверка не выполняется	NRD229

11. Логические проверки внутри сообщений

№	Описание проверки	Номер ошибки
1.	Анкета валютного свопа (CM021 – fxSwap)	
1.1	Проверить, что Валюта 1 и Валюта 2 не совпадают: <ul style="list-style-type: none"> <i>nearLeg/exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency1</i> ≠ <i>nearLeg/exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency2</i> <i>farLeg/exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency1</i> ≠ <i>farLeg/exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency2</i> Если условие не выполняется – отказ	NRD232
2.	Анкета конверсионной сделки (валютного форварда) (CM022 – fxSingleLeg)	
2.1	Проверить, что Валюта 1 и Валюта 2 не совпадают: <ul style="list-style-type: none"> <i>exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency1</i> ≠ <i>exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency2</i> <i>exchangedCurrency1/paymentAmount/currency</i> ≠ <i>exchangedCurrency2/paymentAmount/currency</i> Если условие не выполняется – отказ	NRD232
3.	Анкета валютного опциона (CM023 – fxOption)	
3.1	Проверить, что Валюта на продажу и Валюта на покупку не совпадают: <i>putCurrencyAmount/currency</i> ≠ <i>callCurrencyAmount/currency</i> Если условие не выполняется – отказ	NRD232
3.2	Проверить, что Валюта 1 и Валюта 2 не совпадают: <i>features/barrier/quotedCurrencyPair/currency1</i> ≠ <i>features/barrier/quotedCurrencyPair/currency2</i> Если условие не выполняется – отказ	NRD232
3.3	Проверить, что покупатель опциона является плательщиком премии, а продавец – получателем премии: <i>buyerPartyReference</i> = <i>premium/payerPartyReference</i> <i>sellerPartyReference</i> = <i>premium/receiverPartyReference</i> Если условие не выполняется – отказ	NRD232
4.	Анкета бинарного валютного опциона (CM024 – fxDigitalOption)	
4.1	Проверить, что Дата начала периода наблюдения меньше или равна Дате окончания периода наблюдения: <i>touch/observationStartDate</i> ≤ <i>touch/observationEndDate</i> Если условие не выполняется – отказ	NRD232
4.2	Проверить, что покупатель опциона является плательщиком премии, а продавец – получателем премии: <i>buyerPartyReference</i> = <i>premium/payerPartyReference</i> <i>sellerPartyReference</i> = <i>premium/receiverPartyReference</i> Если условие не выполняется – отказ	NRD232

5.	Анкета договора фиксации максимальной/ минимальной процентной ставки (CM033 – capFloor)	
5.1	Проверить, что покупатель опциона является плательщиком премии, а продавец – получателем премии: capFloorStream/receiverPartyReference = premium/payerPartyReference capFloorStream/payerPartyReference = premium/receiverPartyReference Если условие не выполняется – отказ	NRD232
6.	Анкета свопциона (CM034 – swaption)	
6.1	Проверить, что покупатель опциона является плательщиком премии, а продавец – получателем премии: buyerPartyReference = premium/payerPartyReference sellerPartyReference = premium/receiverPartyReference Если условие не выполняется – отказ	NRD232
7.	Анкета договора РЕПО (CM041 - repo)	
7.1	Проверить, что валюты суммы расчетов по первой и второй частям РЕПО совпадают: spotLeg/settlementAmount/currency = forwardLeg/settlementAmount/currency Если условие не выполняется – отказ	NRD232
8.	Анкета опциона на облигацию (CM044 – bondOption)	
8.1	Проверить, что покупатель опциона является плательщиком премии, а продавец – получателем премии: buyerPartyReference = premium/payerPartyReference sellerPartyReference = premium/receiverPartyReference Если условие не выполняется – отказ	NRD232
9.	Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (CM045 – bondBasketOption)	
9.1	Проверить, что покупатель опциона является плательщиком премии, а продавец – получателем премии: buyerPartyReference = premium/payerPartyReference sellerPartyReference = premium/receiverPartyReference Если условие не выполняется – отказ	NRD232
10.	Анкета опциона на акцию (CM048 equityOption)	
10.1	Проверить, что покупатель опциона является плательщиком премии, а продавец – получателем премии: buyerPartyReference = equityPremium/payerPartyReference sellerPartyReference = equityPremium/receiverPartyReference Если условие не выполняется – отказ	NRD232
11.	Анкета товарного опциона (CM052 – commodityOption)	
11.1	Проверить, что покупатель опциона является плательщиком премии, а продавец – получателем премии: buyerPartyReference = premium/payerPartyReference sellerPartyReference = premium/receiverPartyReference Если условие не выполняется – отказ	NRD232
12.	Анкета товарного свопциона (CM054 – commoditySwaption)	
12.1	Проверить, что покупатель опциона является плательщиком премии, а продавец – получателем премии: buyerPartyReference = premium/payerPartyReference sellerPartyReference = premium/receiverPartyReference Если условие не выполняется – отказ	NRD232
13.	Анкета кредитного дефолтного свопциона (CM072 – creditDefaultSwapOption)	
13.1	Проверить, что покупатель опциона является плательщиком премии, а продавец – получателем премии: buyerPartyReference = premium/payerPartyReference sellerPartyReference = premium/receiverPartyReference Если условие не выполняется – отказ	NRD232

12. Общие проверки Репозитория

№	Описание проверки	Номер ошибки
1.	Проверки заполнения документа перед регистрацией в журнале входящих сообщений	
1.1	Проверить сообщение на используемые namespace	NRD061

	Допустимы только nsdext:, fpmlexт:. В случае использования иных namespace – отказ	
1.2	Если входящее сообщение начинается с nonpublicExecutionReport to: В нём обязательно должен быть блок header В блоке header обязательно должен присутствовать тэг messageID В блоке header обязательно должен присутствовать тэг sentBy В блоке header обязательно должен присутствовать и только один тэг sendTo В блоке header обязательно должен присутствовать тэг creationTimestamp Если условие не выполняется – отказ	NRD059
1.3	Если входящее сообщение начинается с nonpublicExecutionReport to: В нём обязательно должен быть и только один тэг CorrelationID Если условие не выполняется – отказ	NRD001
1.4	Если входящее сообщение начинается с nonpublicExecutionReport to: Должен быть блок <party id="TradeRepository"> Должен быть блок <party id="Party1"> Должен быть блок <party id="Party2"> Должен быть блок <party id="Sender"> В каждом из блоков Party должно быть три обязательных тэга: один обязательный тэг partyID (Репозитарный код) один обязательный тэг partyID (Дополнительный код) один обязательный тэг partyName Так же в сообщении может быть блок <party id="UTIGeneratingParty"> (опционально) В случае его наличия, в этом блоке должно быть три обязательных тэга: один обязательный тэг partyID (Репозитарный код) – Может иметь значение NONREF один обязательный тэг partyID (Обязательно LEI код) один обязательный тэг partyName При этом блок <party id="Sender">, в качестве дополнительного кода, должен иметь код LEI В случае получения сообщения, CM002, сервер репозитария должен проверять только наличие Репозитарного кода и LEI кода отправителя сообщения, и не проверять прочие поля в других блоках	NRD026
1.5	Если входящее сообщение начинается с nonpublicExecutionReport и в нём есть тэг trade, то В нём обязательно должен быть блок tradeHeader В блоке tradeHeader должны быть 3 обязательных блока partyTradeIdentifier В каждом из блоков должны быть один тэг partyReference один и только один тэг tradeID Должен быть блок, где для partyReference href=TradeRepository Должен быть блок, где для partyReference href=Party1 Должен быть блок, где для partyReference href=Party2 Может быть блок, где для partyReference href=UTIGeneratingParty Если условие не выполняется – отказ	NRD061
1.6	Отправитель, определённый транспортной системой, входит в картотеку участников репозитарной деятельности (проверяется наличие кода). А также, не является ли Отправитель Клиентом/Стороной, с которой расторгнуто репозитарное соглашение. Для выполнения проверки производится поиск кода клиента, указанный в транспортной подсистеме среди кодов соответствующего типа в Справочнике участников репозитарной деятельности В случае отсутствия кода в «Справочнике участников репозитарной деятельности», либо определения Отправителя как Клиента/Сторону, с которой расторгнуто репозитарное соглашение – выдается отказ	NRD002
1.7	Проверить, что код, указанный header\sendBy соответствует коду, указанному в party[id="Sender"]/partyId В случае расхождения – ошибка	NRD027
1.8	Проверить, что для каждого блока party, код partyName соответствует в справочнике участников репозитарной деятельности полному наименованию клиента, репозитарный код которого совпадает с partyID или с NOT_REPORTING_CLIENT_NAME (для дополнительного кода) В случае расхождения – отказ	NRD055

	В случае, одностороннего репортинга, при указании тэгов <partyId> для информирующего лица со значением NONREF, допускается указание <partyName> со значением NONREF	
1.9	Проверить, что в базе репозитория не существует не забракованного сообщения такого же типа с тем же значением в поле Код_взаимосвязи (CorrelaltionID) Параметры: 1. Полное наименование отправителя найденного дубликата 2. Дата регистрации сообщения найденного дубликата	NRD034
1.10	Проверить, что поле Код взаимосвязи (CorrelaltionID) заполнен в соответствии с правилами заполнения сообщений репозитория – соответствует маске '[%s]-[%s]-[%s]', где %s – произвольная строка, центральный элемент содержит 4 цифровых символа	NRD063
1.11	В случае, если головной тэг сообщения является тэгом 'nonpublicExecutionReport' проверить, что в поле Код взаимосвязи (CorrelaltionID) первый блок содержит значение, соответствующее полю 'header/sentBy' сообщения	NRD063
1.12	Проверяем соответствие полного наименования стороны, отправителя (для Репозитарного или Дополнительного кода) коду из Справочника участников репозитарной деятельности	NRD055
1.13	После определения корневого тэга, проверить, что присланная анкета имеет тип сообщения, поддерживаемый Репозитарием	NRD162
1.14	Проверить значение поля partyName для Отправителя на его соответствие значению указанного в Справочнике участников репозитарной деятельности	NRD044
2.	Проверки полей Анкеты генерального соглашения	
2.1	Дата сообщения [Дата_формирования_сообщения] не может быть больше текущей календарной даты и меньше [текущая дата – 3 дня]. В противном случае считается, что дата сообщения указана не верно	NRD014
2.2	Соответствие Отправителя Анкеты [Код отправителя сообщения] и отправителя сообщения, указанного транспортной системой. Сверяется [Код отправителя сообщения] и значение ID_Sender в журнале учета сообщений. В случае, если поля совпадают, проверка считается пройденной успешно	NRD015
2.3	Проверяется наличие скана соглашения. Если с сообщением передан файл со сканом, в XML сообщении должно быть заполнено поле [Имя_файла_со_сканом], и наоборот, если заполнено поле [Имя_файла_со_сканом], должен присутствовать файл с XML	NRD003 NRD004
2.4	Проверить, что заполнен регистрационный номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием, и соответствующее ген соглашение действительно зарегистрировано в журнале учёта Генеральных соглашений	NRD017
2.5	Проверить, что соответствующее Генеральное соглашение на дату обработки сообщения обслуживается в репозитарии. Для этого необходимо обратиться к журналу учёта Генеральных соглашений и проверить поле, "Статус Генерального соглашения". Проверка считается пройденной, если Генеральное соглашение не deregистровано, не отменено и не расторгнут соответствующий договор	NRD016
2.6	Проверить, что сторона, от имени которой направляется анкета соглашения, является действующими клиентами репозитария. Необходимо проверить в Справочнике участников репозитарной деятельности, что сторона ген соглашения входит в Справочник и у нее есть действующий договор. Договор считается действующим, если текущий операционный день репозитария больше или равен дате заключения договора и меньше либо равна дате закрытия	NRD021
2.7	Проверить, что указанные в анкете стороны ген соглашения соответствуют сторонам этого ген соглашения, зарегистрированного в журнале учёта договоров, и не нарушен порядок их указания	NRD017
2.8	Проверить, что в сообщении заполнен тэг correlationId, и он уникален для анкет Генеральных соглашений	NRD034
2.9	Проверить, что в сообщении есть блоки party с идентификаторами 'TradeRepository', 'Party1', 'Party2', 'Sender'	NRD026
2.10	Проверить, что код, указанный в header\SentBy соответствует коду, указанному в блоке Party[id='Sender']	NRD027
2.11	Проверить, что код, указанный в header\sendTo соответствует коду, указанному в блоке Party[id='TradeRepository']	NRD028
2.12	Проверить, что сообщение представлено активным ИЛом стороны, по которому имеются действующие на данный момент полномочия в справочнике полномочий ИЛ, для подачи соответствующей анкеты, включая соответствия дополнительным	NRD032

	ограничениям, при их наличии (по номеру ГС/Контрагенту) Не осуществлять данную проверку, в случае если Отправитель = ИЛ-НРД (NSD000CBRBIL)	
2.13	Для каждого блока party, в котором заполнен partyName, проверить по справочнику участников репозитарной деятельности соответствие полного наименования и кода, указанного в partyId В случае внесения изменений в ранее зарегистрированное ГС, при котором происходит изменение Дополнительного кода (2-го partyId) либо наименования (partyName) одной из сторон, проверить, что сторона, по которой производится такое изменение: либо не является действующим клиентом репозитария. Выполняется одно из условий: Клиент найден в базе репозитария и дата расторжения договора с репозитарием <= текущей даты. Клиент не найден в базе репозитария. В случае если проверка пройдена, произвести изменение указанных реквизитов. Либо изменяемый реквизит отсутствует в базе репозитария. В случае прохождения проверки, допускать изменение реквизитов. В случае если проверка не пройдена – отказ	NRD044
2.14	При регистрации нового ГС, в случае наличия по какой-либо из сторон Репозитарного кода, проверить его дату расторжения репозитарного договора. В случае если клиент найден в базе репозитария и дата расторжения репозитарного договора <= текущей даты - отказ	NRD101
2.15	В случае указания для стороны/ИЛ в блоке Party дополнительного тэга partyID (например, LEI/SNILS код), проверить данный код LEI/SNILS на соответствие маске {LEI_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX} {SNILS_XXXXXXXXXXXX}. Типов кодов больше	NRD087
2.16	В случае указания стороной/ИЛом в блоке Party дополнительного тэга partyID (например, LEI/SNILS код), проверить данный код LEI/SNILS на соответствие указанному репозитарному коду в Справочнике участников репозитарной деятельности. В случае наличия кодов LEI/SNILS в Справочнике и не соответствия кодов данного участника, указанным в анкете – формируем отказ	NRD149
2.17	Проверить, что со стороной, от имени которой направлена, анкета не расторгнут репозитарный договор. В случае односторонней отчетности, при котором, с одной из сторон расторгнуто репозитарное соглашение: дата расторжения репозитарного договора <= текущей даты. Либо сторона отказалась от репортига (признак NOT_REPORTING = 'Y') Необходимо проверить по Справочнику участников репозитарной деятельности, что стороны ген соглашения входят в Справочник и не имеют признаков, определяющих ее как участника с которым расторгнуто репозитарное соглашение/отказавшегося от репортига	NRD021
2.18	Проверка для отправителя, уна казание 2-х идентификационных кодов (тэгов PartyID): Репозитарного кода и кода LEI В случае если, у ИЛ отсутствует один из кодов - отказ	NRD161
2.19	Проверка для блока, описывающего Сторону1/2, заполнение поля <Country> и соответствие значения справочнику «cs\iso3166» В случае отсутствия данного поля – отказ В случае некорректного заполнения (значение, отсутствующее в справочнике) – отказ	NRD007
2.20	Проверка для блока, описывающего Сторону1/2 заполнение поля <Classification> и соответствие значения справочнику «cs\north-american-industry-classification-system(nsd)» В случае отсутствия данного поля – отказ В случае некорректного заполнения (значение, отсутствующее в справочнике) – отказ	NRD007
2.21	Проверка для блока, описывающего Сторону1/2, заполнение поля <organizationType> и соответствие значения справочнику «cs\organization-type(nsd)» В случае отсутствия данного поля – отказ В случае некорректного заполнения (значение, отсутствующее в справочнике) – отказ	NRD007

2.22	Для Стороны, осуществляется проверка обязанности отчитываться в Репозиторий согласно указанным признакам В случае если Сторона не обязана отчитываться в Репозиторий, допускается указание идентификационных кодов PartyID по вариантам, для неотчитывающейся стороны. Если в анкете отсутствует одно или оба поля идентификационных кодов (тэгов PartyID) - отказ	NRD161
2.23	Проверить, что в блоке, описывающем Сторону 1/2 присутствуют два тэга partyid. Если отсутствует один или оба тэга PartyID выдавать отказ	NRD161
2.24	В случае указания кода LEI/SNILS в блоке Party (описывающего Сторону), в анкете одной из Сторон, и отсутствие кода LEI/SNILS в соответствующем блоке Party в анкете другой стороны, проводится проверка Стороны (по которой в одной из анкет не указан код LEI/SNILS) на обязанность/не обязанность отчитываться в Репозиторий По результатам проверки: если сторона не обязана отчитываться в Репозиторий – проверка пройдена, и в реестр заносится непустое значение поля partyID (Код LEI) Если сторона обязана отчитываться в Репозиторий – отказ	NRD161
2.25	Для блока UTIGenetatingParty (код UTI), проверить наличие UTIGenetatingParty в блоке <Party>, а также в блоке <Party> проверить наличие тэга tradeId для UTIGenetatingParty (код UTI)	NRD026
2.26	Для тэгов tradeId для UTIGeneratingParty, проверить количество символов. В случае, если количество символов > 52 - отказ	NRD179
2.27	Для тэга tradeId для UTIGeneratingParty, (UTI код) проверить указанный код, на уникальность, отсутствие ранее зарегистрированных анкет с данным кодом. Эта проверка не производится, в случае если подаваемая анкета является анкетой на изменение, и изменяемая анкета уже имеет такой же код	NRD179
2.28	В случае подачи анкеты на изменение, проверить значение кода tradeId для UTIGeneratingParty, если код отличается от исходной анкеты (за исключением случая отсутствия анкеты) – отказ	NRD179
2.29	Проверить, что не заполнен тэг <fpml:trade/fpml:tradeHeader/fpml:partyTradeIdentifier/fpml: originatingTradeId> Если тэг заполнен – отказ	NRD001
2.30	Проверить, что не заполнен тэг <fpml:trade/fpml:tradeHeader/fpml:partyTradeIdentifier/fpml: linkId> Если тэг заполнен – отказ	NRD001
2.31	Только для сообщений, в которых tradeDate >= 01/07/16, Проверить наличие тэга tradeId для UTIGeneratingParty, в случае отсутствия тэга – отказ	NRD189
2.32	Проверить, что в качестве UTIGeneratingParty не указан LEI код НРД, за исключением случаев отчетности сделок в рамках сервиса СУО (Отправитель ИЛ-НРД = NSD000CBRBIL) Если код LEI = LEI_253400M18U5TB02TW421 – отказ	NRD194
2.33	В случае указания для клиента стороны в блоке Client Details дополнительного тэга ID (LEI/SNILS/INN код), проверить данный код LEI/SNILS/INN на соответствие маске {LEI_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX} {SNILS_XXX-XXX-XXX XX}, {INN_XXXXXXXXXX}	NRD087
2.34	Для CM011 проверить, что номер Генерального соглашения, указанный в тэге *\masterAgreementTermination\masterAgreementId существует в репозитории, и находится в одном из статусах: зарегистрировано/в ожидании	NRD016
2.35	Для CM011 проверить, что если ген соглашение закрывается по взаимному согласию клиентов (Причина закрытия 'Close' или 'Other' //*/nsdext:MasterAgreementTermination/nsdext:maTerminatingReason = 'Close'/'Other'), все связанные с ген соглашением договора закрыты	NRD053
2.36	Особенности изменения идентификационных кодов (partyId) Сторон, при внесении изменений в зарегистрированное Генеральное соглашение/договор. 1. Изменение Дополнительного кода Идентификаторы сторон (partyId), указанные Репозитарным кодом (отличным от NONREF), не могут меняться при изменении Генерального соглашения Допускается изменение Дополнительного кода, в случае наличия в зарегистрированном Генеральном соглашении/договоре Репозитарного кода, при	NRD178

	<p>этом осуществляется проверка нового Дополнительного кода на соответствие «справочнику участников» по имеющемуся Репозитарному коду. В случае отсутствия в справочнике нового Дополнительного кода – отказ</p> <p>2. Добавление Репозитарного кода (в случае его отсутствия/значения NONREF)</p> <p>В случае, отсутствия в ранее зарегистрированном Генеральном соглашении/договоре Репозитарного кода, либо значения NONREF, (Сторона по сделке – не клиент репозитария), при подаче изменения в Генеральное соглашение, допускается добавление/изменение (с NONREF) идентификатора Репозитарного кода в случае наличия в данном изменении Дополнительного кода</p> <p>При этом проверяется по данному участнику соответствие кодов: Репозитарного кода, старого Дополнительного кода, нового Дополнительного кода (в случае изменения в анкете ГС/договоре Дополнительного кода) в «справочнике участников»</p> <p>В случае отсутствия/несоответствия в справочнике указанных кодов – отказ</p>	
3.	Проверка полей анкеты договора	
3.1	<p>Дата сообщения [Дата_формирования_сообщения] не может быть больше текущей календарной даты и меньше [текущая дата – 3 дня].</p> <p>В противном случае считается, что дата сообщения указана не верно</p>	NRD014
3.2	<p>Соответствие Отправителя Анкеты [Код отправителя сообщения] и отправителя сообщения, указанного транспортной системой. Сверяется [Код отправителя сообщения] и значение ID_Sender в журнале учета сообщений.</p> <p>В случае, если поля совпадают, проверка считается пройденной успешно.</p>	NRD015
3.3	<p>Проверяется наличие скана договора. Если с договором передан файл со сканом, в XML сообщении должно быть заполнено поле [Имя_файла_со_сканом], и наоборот, если заполнено поле [Имя_файла_со_сканом], должен присутствовать файл с XML</p>	NRD003 NRD004
3.4	<p>Проверить, что в сообщении заполнен тэг correlationId, и он уникален для анкет договоров</p>	NRD034
3.5	<p>Проверить, что в сообщении есть блоки party с идентификаторами ‘TradeRepository’, ‘Party1’, ‘Party2’, ‘Sender’</p>	NRD026
3.6	<p>В случае отсутствия тэга <nonStandardTerms> проверить, что заполнен регистрационный номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием, и соответствующее ген соглашение действительно зарегистрировано в журнале учёта Генеральных соглашений</p>	NRD017
3.7	<p>В случае регистрации отчета договора в рамках ГС, проверить, что соответствующее Генеральное соглашение на дату обработки сообщения обслуживается в репозитарии. Для этого необходимо обратиться к журналу учёта Генеральных соглашений и проверить поле, “Статус Генерального соглашения”. Проверка считается пройденной, если Генеральное соглашение не deregистровано, не отменено и не deregистрован соответствующий договор</p>	NRD016
3.8	<p>Проверить, что сообщение представлено активным ИЛом стороны, по которому имеются действующие на данный момент полномочия в справочнике полномочий ИЛ, для подачи соответствующей анкеты, включая соответствия дополнительным ограничениям, при их наличии (по номеру ГС/Контрагенту).</p> <p>Не осуществлять данную проверку, в случае если Отправитель ИЛ-НРД = NSD000CBRBIL</p>	NRD032
3.9	<p>Проверить, что указанные в анкете стороны договора соответствуют сторонам зарегистрированного ген соглашения (в случае анкеты в рамках ГС), и не нарушен порядок их указания</p>	NRD017
3.10	<p>В случае если в анкете на изменение договора вне ГС, одна из сторон не клиент/бывший клиент репозитария, и в качестве идентификатора <partyId1> данной стороны указан:</p> <p>Репозитарный код, то данный код должен соответствовать коду в ранее зарегистрированной анкете договора</p> <p>NONREF, соответствие с ранее зарегистрированной анкетой не проверяется.</p> <p>Если указанный Репозитарный код не сходится ранее зарегистрированной анкетой – отказ</p>	NRD164
3.11	<p>Проверить, что стороны договора являются действующими клиентами репозитария.</p> <p>В случае одностороннего репортинга одна из сторон может не быть клиентом.</p> <p>Необходимо проверить по Справочнику участников репозитарной деятельности, что</p>	NRD021

	<p>стороны договора входят в Справочник и у каждого есть действующий договор с репозитарием на обслуживание.</p> <p>Договор считается действующим, если текущий открытый опередень больше или равен дате заключения договора и меньше либо равен дате закрытия</p>	
3.12	<p>Проверить, что указанный присвоенный репозитарием номер договора на дату обработки сообщения обслуживается в репозитарии. Для этого необходимо обратиться к журналу учёта договоров и проверить поле “Статус договора”.</p> <p>Проверка считается пройденной, если договор не deregистрирован и не отменен</p>	NRD033
3.13	<p>В случае указания стороной/отправителем в блоке Party тэга partyID (LEI-код участника или СНИЛС или иной допустимый дополнительный код), проверить данный код на соответствие маске</p>	NRD087
3.14	<p>В случае указания стороной/отправителя в блоке Party тэга partyID (LEI/SNILS код), проверить данный код LEI/SNILS на соответствие указанному репозитарному коду в Справочнике участников репозитарной деятельности</p> <p>В случае наличия кода LEI/SNILS в Справочнике участников репозитарной деятельности и не соответствие кодов данного участника указанному в анкете – отказ</p>	NRD149
3.15	<p>Проверить, что со стороной, от имени которой направлена анкета, не расторгнуто репозитарное соглашение</p> <p>В случае одностороннего репортинга, при котором, с одной из сторон расторгнуто репозитарное соглашение:</p> <p>Дата расторжения репозитарного договора <= текущей даты</p> <p>Либо сторона отказалась от репортинга (признак NOT_REPORTING = ‘Y’)</p> <p>Необходимо проверить по Справочнику участников репозитарной деятельности, что сторона ген соглашения входит в Справочник и не имеет соответствующих признаков, определяющих ее как участника, с которым расторгнуто репозитарное соглашение/отказавшегося от репортинга</p>	NRD021
3.16	<p>В случае регистрации договора в рамках ГС, проверить наличие в ГС идентификационных кодов (PartyId) для блоков, описывающих Стороны, в рамках которого регистрируется анкета договора</p> <p>В случае если, в зарегистрированном ГС у Стороны1/Стороны2 присутствует LEI-код участника или СНИЛС или иной допустимый дополнительный код, проверить его наличие в анкете договора</p> <p>Если кода нет – отказ</p> <p>Если код указанный в анкете договора не совпадает с кодом, указанным в зарегистрированном ГС – отказ</p>	NRD164
3.17	<p>В случае одностороннего репортинга (если сторона, отказавшаяся от репортинга не являлась клиентом рпозитария либо расторгла соглашение по CM014): дата расторжения репозитарного договора <= текущей даты.</p> <p>Сторона не являлась клиентом: нет репозитарного кода</p> <p>Для случая если клиент отказался от репортинга, но остался клиентом репозитария по CM012: признак NOT_REPORTING равен «Y».</p> <p>дата расторжения репозитарного договора отсутствует либо ее значение> текущей даты.</p> <p>Данная проверка не проводится</p>	NRD136
3.18	<p>В случае, если регистрируемая анкета является договором РЕПО (CM041 - repo) проверить, в блоке <fpml:spotLeg> отсутствие тэга <settlementCurrency>. Если тэг отсутствует, проверка пройдена.</p> <p>Если тэг присутствует – ошибка (с параметром #s = <settlementCurrency>).</p> <p>XPATH тэга:</p> <p>fpml:nonpublicExecutionReport/fpml:trade/fpml:repo/fpml:spotLeg/fpml:settlementCurrency</p>	NRD001
3.19	<p>В случае, если регистрируемая анкета является договором СВОП (CM021 - fxSwap) проверить, что значение тэга <dealtCurrency> блока <nearLeg> равно значению тэга <dealtCurrency> блока <farLeg>.</p> <p>Если значения равны, то проверка пройдена.</p> <p>Если значения не равны - ошибка (с параметром #s = <dealtCurrency>).</p> <p>XPATH тэгов:</p> <p>fpml:nonpublicExecutionReport/fpml:trade/fpml:fxSwap/fpml:nearLeg/fpml:dealtCurrency</p> <p>у</p> <p>fpml:nonpublicExecutionReport/fpml:trade/fpml:fxSwap/fpml:farLeg/fpml:dealtCurrency</p>	NRD001
3.20	<p>Проверить, что Сторона, направившая анкету, указана в одном из полей</p>	NRD001

	servicingParty блока ClientDetails, и выбрано одно из следующих значений: 1) ownTrade – в собственных интересах 2) type, id, name, country - в интересах клиента Не производить данную проверку для сообщений CM015.	
3.21	В случае одностороннего репортинга (Сторона1/2 в таблице MEMBERS.NOT_REPORTING = 'Y' или Сторона1/2 не активный клиент репозитория), либо если ИЛ1=ИЛ2, проверить, что блок ClientDetails, указан 2-а раза, и выбраны соответствующие значения из допустимых для данного блока: 1) ownTrade – в собственных интересах. 2) type, id, name, country - в интересах клиента 3) noInformation – неизвестно в чьих интересах заключен договор. Не производить данную проверку для сообщений	NRD001
3.22	Для Стороны1/2 проверять значение нового тэга (noInformation) в блоке ClientDetails (признак sfr) Если тэг отсутствует – проверка пройдена В случае, если тэг присутствует (имеет значение «true»), то необходимо проверить по справочнику участников (MEMBERS), что для данной Стороны признак NOT_REPORTING = 'Y', либо данная Сторона не является активным клиентом репозитория Иначе – отказ Не производить данную проверку для сообщений CM015	NRD001
3.23	Проверка для блока, описывающего Сторону1/2, заполнение поля <Country>, а также соответствие его значения справочнику «cs\iso3166» и значению, указанному в ГС В случае отсутствия данного поля – отказ В случае некорректного заполнения (значение, отсутствующее в справочнике) – отказ В случае, несоответствия значения указанного в договоре (если договор в рамках ГС), значению в ГС – отказ	NRD001/NRD007
3.24	Проверка для блока, описывающего Сторону1/2 заполнение поля <Classification>, а также соответствие его значения справочнику «cs\north-american-industry-classification-system(nsd)» и значению указанного в ГС В случае отсутствия данного поля – отказ В случае некорректного заполнения (значение, отсутствующее в справочнике) – отказ В случае, если значение поля, указанное в ГС = «Other», а значение поля, указанное в анкете договора (если договор в рамках ГС) отлично от «Other» - отказ В других случаях проверка считается пройдена	NRD001/NRD007
3.25	Проверка для блока, описывающего Сторону1/2, заполнение поля <organizationType>, а также соответствие его значения справочнику «cs\organization-type(nsd)», и значению указанного в ГС В случае отсутствия данного поля – отказ В случае некорректного заполнения (значение, отсутствующее в справочнике) – отказ В случае, несоответствия значения указанного в договоре (если договор в рамках ГС), значению в ГС – отказ	NRD001/NRD007
3.26	Проверить, что тэг <fpml:trade/fpml:tradeHeader/fpml:partyTradeIdentifier/fpml:linkId> (Для TradeRepository) заполнен номером ГС, зарегистрированным в Репозитории (если договор в рамках ГС)	NRD039
3.27	Если для TradeRepository заполнен тэг <fpml:trade/fpml:tradeHeader/fpml:partyTradeIdentifier/fpml:originatingTradeId>, проверить имеется ли анкета CM015 с таким же tradeId (TradeRepository) в состоянии ожидания\ подтверждения или в реестре (зарегистрирована или deregistririrovana) В случае если помимо tradeId за TradeRepository, указаны tradeId (отличны от NONREF) за Party1/Party2 их также необходимо проверить в указанной CM015 Если не найдена анкета с указанным tradeId для 'TradeRepository' – отказ Если указанные tradeId за Party1/Party2 не сходятся с зарегистрированной анкетой CM015 – отказ	NRD185
3.28	Если для одной из сторон (Party1/Party2) заполнен тэг<fpml:trade/fpml:tradeHeader/fpml:partyTradeIdentifier/fpml:originatingTradeId>, наличие этого тэга для второй стороны обязательно, при этом допускается значение	NRD001

	NONREF Отсутствие тэга за вторую сторону - отказ	
3.29	Если при регистрации нового договора в рамках ГС в нем отсутствует ссылка на репозитарный номер ГС ('TradeRepository' linkId = 'NONREF') - отказ	NRD102
3.30	Если при регистрации договора присутствует ссылка на репозитарный номер ГС ('TradeRepository' linkId не равен NONREF), и ссылка на номер CM015 ('TradeRepository' originatingTradeId не равен NONREF), проверить, что анкета CM015 зарегистрирована в рамках того же ГС, что и подаваемая анкета договора	NRD102
3.31	Если для сообщения CM015 заполнен тэг <fpml:trade/fpml:tradeHeader/fpml:partyTradeIdentifier/fpml: originatingTradeId> - отказ	NRD001
3.32	Для tradeId по UTIGenetatingParty (код UTI), проверить наличие UTIGenetatingParty в блоке <Party>, а также в блоке <Party> проверить наличие тэга tradeId для UTIGenetatingParty (код UTI) Проверка действует с 01/07/2016	NRD026
3.33	Если linkId/originatingTradeId для UTIGenetatingParty присутствует - отказ	NRD001
3.34	Для тэгов tradeId для UTIGeneratingParty, и его значение не равно NONREF, проверить количество символов Если количество символов > 52 – отказ	NRD179
3.35	Для тэга tradeId для UTIGeneratingParty, (UTI код) проверить указанный код, на уникальность, отсутствие ранее зарегистрированных анкет с данным кодом. Эта проверка не производится, в случае если подаваемая анкета является анкетой на изменение, и изменяемая анкета уже имеет такой же код	NRD179
3.36	В случае подачи анкеты на изменение, проверить значение кода tradeId для UTIGeneratingParty, если код отличается от исходной анкеты – отказ	NRD179
3.37	Если linkId для Party1/Party2 присутствует – отказ	NRD001
3.38	В случае указания тэга <automaticExecution> проверить наличие тэгов <startAgreementDate> и <endAgreementDate>	NRD187
3.39	Проверить наличие тэга <nonStandardTerms>, если тэг отсутствует и присутствует тэг <linkId> для 'TradeRepository', проверка пройдена Если одновременно присутствуют оба тэга и <nonStandardTerms> и <linkId>	NRD188
3.40	В случае если договор заключен вне ГС (наличие тэга <nonStandardTerms>), проверить наличие клиентского идентификатора для стороны за которую направляется отчет (Party1/Party2), и то, что это значение не равно NONREF, иначе – отказ	NRD120
3.41	Только для сообщений с tradeDate >= 01/07/16, Проверить наличие тэга tradeId для UTIGeneratingParty, в случае отсутствия тэга – отказ	NRD007
3.42	Проверить что тэг <nonStandartTerm> указан 1 раз, иначе отказ	NRD001
3.43	В случае наличия тэга <partiesAreAffiliated>, проверить значение тэга <nonStandartTerm> В случае, если <nonStandartTerm> = true, проверка пройдена В случае, если <nonStandartTerm> = false, либо тэг отсутствует – отказ	NRD239
3.44	Проверить, что в случае присутствия в анкетах CM051-CM054 блока //<commodity>, тип данного элемента должен быть type="nsdext:CommodityBasket" Иначе в текст ошибки выводить тэг <nsdext:commodity xsi:type="nsdext:CommodityBasket" id="">	NRD001
3.45	В случае двухстороннего репортига - ИЛ1<>ИЛ2, проверить, что признак автозакрыва договора не установлен (<automaticExecution>!=true). Если заполнен – отказ	NRD221
3.46	Для анкет договоров, направленных не ИЛом – НРД (отправитель не NSD000CVRBIL) проверить в анкете поле «Статус СУО» при изменении договора/статуса договора. Если текущий Статус СУО = “Active” – отказ	NRD225
3.47	В случае указания для клиента стороны в блоке Client Details дополнительного тэга ID (например, LEI/SNILS/INN код), проверить данный код LEI/SNILS/INN на соответствие маске {LEI_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX} {SNILS_XXX-XXX-XXX XX}, {INN_XXXXXXXXXX}	NRD087
4.	Особенности проверки полей анкеты CM092 (Отчет об уплате маржевых сумм - TransfersAndExecution)	
4.1	Проверить что элемент transfersAndExecution/ reportIdentifier/linkId (Идентификатор ГС, в рамках которого направляется отчет), указан для partyReference = 'Trade repository' и его значение равно номеру ГС,	NRD089

	зарегистрированному в реестре	
4.2	Проверить, что отчет направляется в рамках одного ГС <code>*\transfersAndExecution\reportIdentifier\linkId</code> (одно значение для блока <code>reportIdentifier</code> с <code>partyReference = 'Trade repository'</code>)	NRD165
4.3	Проверить, что сообщение представлено активным ИЛом стороны, указанной в <code>*\transfersAndExecution\reportParty</code> , (<code>Party1/Party2/All</code>) по ГС указанному в <code>*\transfersAndExecution\reportIdentifier\linkid</code> , по которому имеются действующие на данный момент полномочия в справочнике полномочий ИЛ, для подачи соответствующей анкеты, включая соответствия дополнительным ограничениям, при их наличии (по номеру ГС/Контрагенту) Не осуществлять данную проверку, в случае если Отправитель равен ИЛ-НРД (NSD000CBRBIL)	NRD032
4.4	Проверить, что <code>Party1</code> (в CM092) равен <code>Party1</code> (в Генеральном соглашении на которое ссылается CM092) <code>Party2</code> (в CM092) равен <code>Party2</code> (в Генеральном соглашении на которое ссылается CM092) Генеральное соглашение, указанное в поле «Регистрационный номер Генерального соглашения»	NRD026
4.5	Проверить, что для ГС, указанного в <code>*\transfersAndExecution\reportIdentifier\linkid</code> Сторонами по договорам являются стороны, указанные в блоках <code>Party id= Party1;</code> <code>id=Party2</code>	NRD017
4.6	Проверить наличие в Анкете ГС/договоров Репозитарных кодов, для блоков, описывающих Стороны, в рамках которого регистрируется анкета CM092 В случае если Репозитарный код присутствует, проверить его соответствие с Репозитарным кодом, указанным в анкете CM092 Если Репозитарные коды не сходятся – отказ В случае если, в Анкете ГС/договоров у Стороны1/Стороны2 присутствует только Дополнительный код (Репозитарный код = NONREF, Дополнительный код = значение из допустимых кодов), проверить его наличие и соответствие коду, указанному в анкете CM092 Если код указанный в анкете не совпадает с кодом, указанным в зарегистрированном договоре – отказ В случае если, в зарегистрированном Договоре у Стороны1/Стороны2 отсутствует код LEI, наличие этого кода в анкете CM092 определяется в соответствии с процедурой В случае если анкета CM092 подается по ранее зарегистрированной анкеты договора/договоров, которые в настоящий момент не поддерживаются репозитарием, данная проверка по таким договорам не проводится	NRD164
4.7	В случае если, сообщение было подано на изменение ранее зарегистрированной анкеты, проверить соответствие номера ГС в анкете изменения номеру ГС <code>*\transfersAndExecution\reportIdentifier\linkid</code> в ранее зарегистрированной анкете. В случае расхождения – отказ В случае если, сообщение на изменение было подано по анкете CM092, зарегистрированной до 01.10.2015, не проверять наличие и соответствие Генерального соглашения в ранее зарегистрированной анкете	NRD166
4.8	Проверить, что год и месяц в значении поля <code>asOfDate</code> равны году и месяцу в значениях полей <code>valuationDate</code> (для всех блоков <code>creditSupportInformation</code>)	NRD169
4.9	Если присутствует ссылка на репозитарный номер ГС ('TradeRepository' <code>linkId</code> не равен NONREF), и ссылка на номер CM015 ('TradeRepository' <code>originatingTradeId</code> не равен NONREF), проверить, что анкета CM015 зарегистрирована в рамках того же ГС, что и подаваемая анкета является CM092	NRD102
4.10	Проверить, что в полномочиях ИЛа, представившего отчет, значение признака <code><transfersAndExecution></code>): Если признак = 'false' проверить присутствует ли в перечне полномочий тип документа = <code><transfersAndExecution></code> , не учитывая ALLD Если тип документа присутствует – проверка пройдена, иначе – отказ Если признак = 'true' - проверка пройдена	NRD080
4.11	Особенность указания <code>tradeId</code> при регистрации отчета (в целях избежания дублирования сообщений) Для поиска дубликата проверяем список сообщений на соответствие полей <code>tradeId</code> тем, что указаны в новом сообщении. Допускается указание любого значения <code>tradeId</code> за <code>Party1/Party2</code> , если ранее не было зарегистрировано отчета с таким же	NRD176

	значением tradeId за сторону, указанную в поле reportParty (в случае 'All' – за обе стороны) и таким же значением поля valuationDate в любом из блоков creditSupportInformation (CM092)/markToMarketValuation (CM094), иначе – отказ	
5.	Особенности проверки полей анкеты CM094 (Отчет о расчете справедливой (оценочной) стоимости - markToMarketValuation)	
5.1	Проверить, что сообщение представлено активным ИЛом стороны, указанной в *\markToMarketValuation\reportParty, (Party1/Party2/All) по ГС в рамках которого, указан договор/договоры *\markToMarketValuation\MarkToMarketDetails\MarkToMarketInformation\tradeId (При этом договора могут еще не быть зарегистрированы в реестре, но могут быть зарегистрированы в журнале входящих сообщений, это не должно влиять на регистрацию отчета), по которому имеются действующие на данный момент полномочия в справочнике полномочий ИЛ, для подачи соответствующей анкеты, включая соответствия дополнительным ограничениям, при их наличии (по номеру ГС/Контрагенту) Не осуществлять данную проверку, в случае если Отправитель = ИЛ-НРД (NSD000CBRBIL)	NRD032
5.2	Проверить, что Party1(в CM094) равно Party1(в ген соглашении, на которое ссылается CM094 (через договоры markToMarketValuation\MarkToMarketDetails\MarkToMarketInformation\tradeId)) Party2(в CM094) равно Party2(в ген соглашении на которое ссылается CM094 (через договоры markToMarketValuation\MarkToMarketDetails\MarkToMarketInformation\tradeId))	NRD026
5.3	Проверить, что для всех договоров, указанных в markToMarketValuation\MarkToMarketDetails\MarkToMarketInformation\tradeId Сторонами по договорам являются стороны, указанные в блоках Party с id= Party1 и id=Party2	NRD017
5.4	Проверить, что не заполнен тэг <originatingTradeId> и <linkId> Если тэг заполнен – отказ	NRD001
5.5	Проверить наличие в Анкете договора/договоров Репозитарных кодов, для блоков, описывающих Стороны, в рамках которого регистрируется анкета CM094. В случае если Репозитарный код присутствует, проверить его соответствие с Репозитарным кодом указанному в анкете CM094 Если Репозитарный.код не сходится – отказ В случае если, в Анкете договора/договоров у Стороны1/Стороны2 присутствует только Дополнительный код (Репозитарный код = NONREF, Дополнительный код = 1 из допустимых кодов), проверить его наличие и соответствие коду, указанному в анкете CM094. Если код указанный в анкете не совпадает с кодом, указанным в зарегистрированном договоре – отказ В случае если, в зарегистрированном Договоре у Стороны1/Стороны2 отсутствует код LEI, наличие этого кода в анкете определяется в соответствии с процедурой В случае, если анкета CM094 подается по ранее зарегистрированной анкеты договора/договоров, которые в настоящий момент не поддерживаются репозитарием, данная проверка по таким договорам не проводится	NRD164
5.6	В случае указания нескольких договоров в *\markToMarketValuation\MarkToMarketDetails\MarkToMarketInformation\tradeId проверить, что все они зарегистрированы в рамках одного ГС	NRD164
5.7	В случае если, сообщение было подано на изменение ранее зарегистрированной анкеты, проверить соответствие номера ГС в анкете изменения номеру ГС для договоров, указанных в *\transfersAndExecution\reportReferences ранее зарегистрированной Анкете. В случае расхождения - отказ	NRD166
5.8	Проверить, что год и месяц в значении поля asOfDate равны году и месяцу в значениях полей valuationDate (для всех блоков MarkToMarketDetails)	NRD169
5.9	Проверить, что в полномочиях ИЛа, представившего отчет, значение признака <markToMarketValuation> Если признак = 'false': Проверить присутствует ли в перечне полномочий тип документа = <markToMarketValuation>, не учитывая ALLD Если тип документа присутствует – проверка пройдена, иначе – отказ Если признак = 'true':	NRD080

	Проверить тип сделки в перечне договоров, по которым направляется данный отчет. Если хотя бы по одному договору тип сделки не соответствует указанному в перечне полномочий данного ИЛ – отказ	
5.10	Особенность указания tradeId при регистрации отчета (в целях избежания дублирования сообщений) Для поиска дубликата проверяем список сообщений на соответствие полей tradeId тем, что указаны в новом сообщении. Допускается указание любого значения tradeId за Party1/Party2, если ранее не было зарегистрировано отчета с таким же значением tradeId за сторону указанную в поле reportParty (в случае 'All' – за обе стороны) и таким же значением поля valuationDate в любом из блоков creditSupportInformation (CM092)/markToMarketValuation (CM094), иначе – отказ	NRD176
6.	Особенности проверки полей анкеты CM093 (Анкета о состоянии обязательств по договорам - executionStatus)	
6.1	Проверить, что все Генеральные соглашения, репозитарные номера которых указаны в блоках *\tradesWithStatus\reportReferences\masterAgreementId существуют, не закрыты и обслуживаются на момент обработки в репозитории В случае, если анкета не содержит ни одной ссылки на ген соглашение, проверка пропускается	NRD016
6.2	Проверить, что все договора, репозитарные номера которых указаны в блоках *\tradesWithStatus\reportReferences\tradeId существуют, не закрыты и обслуживаются на момент обработки в репозитории В случае, если анкета не содержит ни одной ссылки на договор, проверка пройдена	NRD033
6.3	Проверить, что отправитель сообщения входит в число ИЛов по каждой из сделок, указанных в блоках *\tradesWithStatus\reportReferences При этом необходимо учитывать, что если в reportReferences содержится тэг masterAgreementId, то должны быть учтены все активные сделки в рамках указанного Генерального соглашения При этом: не производить проверку полей PartyID по маске. проверять поля PartyID на соответствие значениям, указанным в зарегистрированном ГС	NRD046
6.4	Проверить, что по всем сделкам, указанным в блоках *\tradesWithStatus\reportReferences, общее число ИЛов не больше 2-х. При этом необходимо учитывать, что если в reportReferences содержится тэг masterAgreementId, то должны быть учтены все активные сделки в рамках указанного Генерального соглашения	NRD047
6.5	В случае если в анкете CM093 присутствует договора вне ГС, одна из сторон которого не клиент/бывший клиент репозитария, и в качестве идентификатора <partyId1> данной стороны указан: Репозитарный код, то данный код должен соответствовать коду в зарегистрированной анкете договора NONREF, соответствие с зарегистрированной анкетой не проверяется Если указанный Репозитарный код не сходится с зарегистрированной анкетой – отказ	NRD164
6.6	Проверить, что не заполнен тэг <fpml:trade/fpml:tradeHeader/fpml:partyTradeIdentifier/fpml:originatingTradeId> Если тэг заполнен – отказ	NRD001
7.	Этапы обработки сообщения, присланного на замену ранее предоставленной анкеты	
7.1	Осуществляется поиск заменяемого документа Если заменяемый документ найден: происходит проверка, что заменяемый документ находится в статусе ожидания Если заменяемый документ не в статусе ожидания – отказ в обработке текущего сообщения	NRD036
7.2	Если заменяемый документ находится в статусе ожидания, документ переводится в статус – ожидание замены Происходит проверка текущего документа в соответствии с процедурой обработки анкеты, предоставленной клиентом Если в текущем документе найдены ошибки, отказываем, по текущему сообщению, и возвращаем заменяемый документ в статус ожидания Формируется отказ по заменяемому сообщению с ошибкой	NRD038

7.3	В случае, если к моменту отмены, контрагенту по процессу регистрации уже был отправлен запрос на согласование параметров анкеты, необходимо сформировать сообщение об отмене запроса. Сообщение об отмене запроса полностью идентично извещению об отказе в регистрации отменяемого сообщения, кроме следующих элементов: Сообщение направляется получателю запроса на согласование header/inReplayTo содержит номер запроса на согласование	NRD062
7.4	Если заменяемый документ не найден – отказ в обработке текущего сообщения с ошибкой	NRD037
7.5	Если в списке сообщений, находящихся в состоянии ожидания, найдено сообщение, которое нужно заменить на полученное. Для этого оформляется отказ по найденному в списке (формируется извещение об отказе в регистрации данных с ошибкой) и продолжается обработка полученного сообщения	NRD025
8.	Особенности проверки полей анкет Bulk -отчетов CM083 - Отчет по сделкам репо repoBulkReport; CM084 - Отчет по сделкам валютный своп fxSwapBulkReport; CM085 - Отчет по конверсионным сделкам fxSingleLegBulkReport	
8.1	Проверить, что длина идентификатора договора/сделки, присвоенного участником не должна превышать 35 символов В случае превышения – отказ	NRD093
8.2	Проверка на уникальность идентификатор каждой сделки, присвоенный клиентом, в блоке nsdext:repoBulkReport/clientRepos/repoDetails nsdext:fxSwapBulkReport/clientSwaps/swapDetails nsdext:fxSingleLegBulkReport/clientsingleLeg/singleLegDetails В случае, если в блоке присутствуют сделки с одинаковым ID – отказ	NRD172
8.3	Проверка, что клиентский идентификатор анкеты и перечня сделок nsdext:repoBulkReport/clientRepos/repoDetails nsdext:fxSwapBulkReport/clientSwaps/swapDetails nsdext:fxSingleLegBulkReport/clientsingleLeg/singleLegDetails не является пустым, и не имеет значение – NONREF	NRD171
8.4	Проверить признак, определяющий deregistration анкеты (TradeObligationStatus = T; SO; D) В случае его отсутствия, либо отличия значения от “T”, “SO” или “D” – отказ	NRD001
8.5	Проверить наличие UTIGenetatingParty в блоке <Party>, а также проверить наличие тэга tradeId с атрибутом ‘u’ для UTIGenetatingParty (код UTI) Проверка начинает действовать с 01/07/2016	NRD026
8.6	Если linkId/originatingTradeId для UTIGenetatingParty присутствует - отказ	NRD001
8.7	Для tradeId – атрибут ‘u’, и его значение не равно NONREF, проверить количество символов Если количество символов > 52 – отказ	NRD179
8.8	Для тэга tradeId - атрибут ‘u’, (UTI код) проверить указанный код, на уникальность, в рамках всех сделок, указанных в сообщении, и в ранее зарегистрированных анкет с данным кодом в реестре Эта проверка не производится, в случае если подаваемая анкета является анкетой на изменение, и изменяемая анкета уже имеет такой же код	NRD179
8.9	Проверить наличие тэга tradeId с атрибутом ‘u’ для UTIGeneratingParty по всем сделкам в отчете, в случае отсутствия тэга – отказ	NRD007
8.10	Проверить указание <PartyId> для блока описывающего контрагента \\<counterparty> Если Party1 не равно Counterparty и первый <PartyId> = NONREF, второй <PartyId> = допустимый Дополнительный код (в том числе PASS) – проверка пройдена Если Party1 не равен Counterparty, и в качестве любого <PartyId> указан Репозитарный код – отказ Если Party1 равен Counterparty, поля <PartyId>, <PartyId>, <partyName> должны быть заполнены одинаково, иначе отказ	NRD145
8.11	Проверить, что Sender = ИЛИ Party1 с типом отчетности в CM016 ALLD	NRD042
8.12	В случае, если <nonStandardTerms> отсутствует проверить, что <Party2> равен <counterparty> и в анкете указан только один блок <counterparty>	NRD237
8.13	В случае, если <nonStandardTerms> присутствует со значением = true, проверить, что поля блока <Party2> - описывающего контрагента (отчет вне рамок ГС) присутствует, partyId1/ partyId2 со значением NONREF (classification, country,	NRD026

	organizationType не заполняются)	
8.14	В случае подачи анкеты с блоком <corrective>, проверить, совпадает ли количество сделок в новой анкете с количеством сделок в ранее зарегистрированной анкете. Если нет - отказ	NRD215
8.15	В случае подачи анкеты с блоком <corrective>, проверить, имеются ли в новой анкете значения атрибутов: г,и поля tradeId, в записях повторяющегося блока, которых нет в ранее зарегистрированной анкете. Если имеются – отказ	NRD217
8.16	В случае указания для клиента стороны в блоке Client Details дополнительного тэга ID (LEI/SNILS/INN код), проверить данный код LEI/SNILS/INN/PASS на соответствие маске {LEI_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX}, {SNILS_XXX-XXX-XXX XX}, {INN_XXXXXXXXXX} {PASS_X...X}	NRD087
9.	Удаление просроченных сообщений, находящихся в статусе ожидания	
9.1	Процедура удаления сообщений, находящихся в статусе ожидания (ожидания регистрации связной анкеты Генерального соглашения) и в ожидание реакции контрагента длительное время. Входящим параметром процедуры является закрытый операционный день, за который производится обработка. Процедура для каждого из сообщений, находящихся в статусе ожидания, определяет операционный день, в который сообщение было принято. Если дата этого операционного дня меньше либо равна дате, заданной в параметре процедуры (для ожидания регистрации связного Генерального соглашения – 1 опердень; для остальных – 30 календарных дней), по сообщению должен быть сформирован отказ	NRD039
9.2	Если с момента регистрации сообщения в журнале входящих сообщений (рассматривается опердень входящего сообщения) до текущего времени прошло количество календарных дней большее, чем указано в справочнике (текущее значение – 30 календарных дней), сообщение считается просроченным – отказ	NRD040
10.	Особенности проверки полей анкеты Заявления о назначении Информировующих лиц (CM016 - designationRA)	
10.1	Дата сообщения [Дата_формирования_сообщения] не может быть больше текущей календарной даты и меньше [текущая дата – 3 дня]. В противном случае считается, что дата сообщения указана не верно	NRD014
10.2	Соответствие Отправителя Анкеты [Код отправителя сообщения] и отправителя сообщения, указанного транспортной системой. Сверяется [Код отправителя сообщения] и значение ID_Sender в журнале входящих сообщений. В случае, если поля совпадают, проверка считается пройденной успешно	NRD015
10.3	Проверить, что <Sender> равен <AgreementParty>	NRD042
10.4	Проверить, что в сообщении есть блоки party с идентификаторами 'TradeRepository', 'agreementParty', 'Sender' И имеют структуру, в соответствии с блоком <Party>	NRD026
10.5	Проверить, что указанные в полях <reportingAgent> ИЛ, не повторяются	NRD180
10.6	Проверить, что все указанные в анкете <reportingAgent>, указаны идентификаторами <partyId> (Репозитарный код), <partyId> (LEI код) В случае отсутствия – отказ	NRD161
10.7	В случае указания в блоке <Party>/<reportingAgent> тэга partyID (LEI-код участника или СНИЛС или иной допустимый дополнительный код), проверить данный код на соответствие маске	NRD087
10.8	В случае указания в блоке <Party>/<reportingAgent> тэга partyID (LEI/SNILS код), проверить данный код LEI/SNILS на соответствие указанному репозитарному коду в Справочнике участников репозитарной деятельности. В случае наличия кода LEI/SNILS в Справочнике участников репозитарной деятельности и не соответствие кодов данного участника, указанному в анкете – отказ	NRD149
10.9	Проверить, что ни с одним из участников, указанных в блоках <Party>/<reportingAgent> не расторгнуто репозитарное соглашение	NRD021
10.10	Проверить наличие в Анкете Заявления идентификационных кодов (PartyId) для блока описывающих Клиента (Party) В случае если, в справочнике участников репозитарной деятельности присутствует LEI-код участника или СНИЛС или иной допустимый дополнительный код, проверить его наличие в анкете Если кода нет – отказ	NRD161
10.11	Для каждого блока <reportingAgent> проверить наличие и соответствие справочнику	NRD164

	тэгов <partyName>, <PartyId> (Репозитарный код), <PartyId> (LEI код)	
10.12	В случае указания тэга <link ID> (номер Генерального соглашения) проверить наличие зарегистрированного в репозитории ГС. В случае если ГС отсутствует – Отказ	NRD089
10.13	В случае, если по одному из ИЛ <reportingAgent> указан тэг <linkId>, то тэг <counterParty>, должен отсутствовать, иначе – отказ	NRD007
10.14	В случае если в сообщении по нескольким ИЛам <reportingAgent>, указано одинаковое значение тэга <DocumentType>, проверить значения тэгов: <linkId>/<counterParty> В случае наличия одинаковых значений (включая отсутствие) для всех тэгов: Пример - ошибка: ИЛ1: Тип документа = РЕПО, ГС = ГС1 ИЛ2: Тип документа = РЕПО, ГС = ГС1	NRD070
10.15	По всем ИЛ, проверить значение тэгов <TransfersAndExecution> блока <ReportingType>, в случае значений «True» проверить для данного ИЛ наличие в списке документов <DocumentType> типов документов CM010 или CM015, или ALLD Если документы отсутствуют – отказ	NRD182
11.	Особенности обработки анкет на изменение и переоткрытие закрытых анкет (Все анкеты договоров, генсоглашений, отчеты CM092, CM094)	
11.1	Для сообщений CM093 и CM011, подаваемых для переоткрытия или изменения статуса анкет договоров/ГС в статусе deregistrated/закрыто или договоров в статусе ошибка после подачи клиентом CM093 с кодом состояния договора 'R', проверить что: Дата последней deregistrations каждой из анкет+ 3 рабочих дня >= даты регистрации входящего сообщения в ЖУВС Если условие не выполняется – отказ	NRD218
11.2	Если в сообщениях присутствует блок <amendment>/<reportAmendment> с/без элемента <correctRegisteredInfo>, проверить что: отправителем данной анкеты является: либо действующий ИЛ стороны, от имени которой направляется анкета изменения, либо сторона <Party1>/<Party2>. Иначе – отказ	NRD042
11.3	Если в сообщениях присутствует элемент <correctRegisteredInfo> в конце блока <amendment>/<reportAmendment> и договор/ГС находятся в закрытом статусе или в статусе ошибка после подачи клиентом CM093 с кодом состояния договора 'R', проверить что: Дата последней deregistrations + 3 рабочих дня >= даты регистрации входящего сообщения в ЖУВС Иначе – отказ.	NRD214
11.4	В случае переоткрытия договора в рамках ГС (CM093), проверить, что соответствующее Генеральное соглашение на дату обработки сообщения обслуживается в репозитории. Для этого необходимо обратиться к журналу учёта Генеральных соглашений и проверить поле, «Статус Генерального соглашения». Проверка считается пройденной, если Генеральное соглашение не deregistrated, не отменено и не расторгнут соответствующий договор	NRD055
11.5	Для сообщений CM093 проверить, что изменение в указанный статус возможно для данного типа договора: В сообщениях Bulk-формата можно менять только один закрытый статус на другой закрытый и обратно В не Bulk-форматах возможны любые изменения Иначе – отказ	NRD219
11.6	Если в сообщениях CM092/CM094 присутствует элемент <correctRegisteredInfo> в конце блока <reportAmendment> - отказ	NRD222
11.7	Если в сообщениях на изменение, т.е. без элемента <correctRegisteredInfo> в конце блока <reportAmendment> присутствует тэг <amendment xsi:type="nsdext:TradeAmendmentContent"> - отказ	NRD223

XVI. Основные поля Разделов 1, 2 и 3 Реестра договоров

1. В рамках репозитарной деятельности Репозитарий осуществляет ведение Реестра договоров в соответствии с нормативными актами Банка России и Правилами осуществления репозитарной деятельности НКО АО НРД.

Репозитарий предоставляет в Банк России реестр договоров в составе записей, каждый рабочий день месяца по состоянию на конец операционного дня, предшествующего дню предоставления реестра договоров, в электронной форме в формате XML (eXtensible Markup Language) и FpML (Financial products Markup Language), а также путем бесперебойного защищенного доступа Банка России к таблицам базы данных репозитария (Витрина данных).

Состав записей разбит на три журнала по количеству разделов реестра договоров Репозитария, в которых регистрируется информация.

2. Состав записей в журнале Раздела 1 Реестра договоров в формате xml содержит поля:

№	Название элемента в формате xml	Описание элемента	Тип элемента	Детальный путь (xpath) к элементу в указанной xsd-схеме
1	inMessagesJournal (1-38)	Журнал записей в разделе 1 реестра договоров	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:element[@name='inMessagesJournal' and @type='InMessagesJournal']
2	senderMessages (2-38)	Сообщения, относящиеся к участнику	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='InMessagesJournal']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='senderMessages' and @type='SenderMessages']
3	@partyId (3-3)	Репозитарный код стороны договора, обязанной предоставлять информацию в Репозитарий, или Информирующего лица	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='SenderMessages']/xsd:attribute[@name='partyId' and @use='required']
4	@partyName (4-4)	Наименование стороны договора, обязанной предоставлять информацию в Репозитарий, или Информирующего лица	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='SenderMessages']/xsd:attribute[@name='partyName' and @use='required']
5	@lei (5-5)	Международный код идентификации юридического лица (код LEI) – стороны договора, обязанной предоставлять информацию в Репозитарий, или Информирующего лица	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='SenderMessages']/xsd:attribute[@name='lei' and @use='required']
6	messagesOfType (6-38)	Блок с группировкой по Номеру формы сообщения	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='SenderMessages']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='messagesOfType' and @type='MessagesOfType']
7	@type (7-8)	Номер формы сообщения	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='MessagesOfType']/xsd:attribute[@name='type' and @type='xsd:string' and @use='required']

8	@typeDescription (8-8)	Наименование формы сообщения	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='MessagesOfType']/xsd:attribute[@name='typeDescription' and @type='xsd:string' and @use='required']
9	reject (9-18)	Состояние обработки сообщений в статусе "Отказано"	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='MessagesOfType']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='reject' and @type='MessagesGroup']
10	message (10-18)	Блок с составом информации о сообщении	Заполняемый элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='MessagesGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='message' and @type='Message']
11	@outMsgId (11-11)	Исходящий номер сообщения Отправителя	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='outMsgId' and @type='xsd:string' and @use='optional']
12	@outMsgDate (12-12)	Дата/время создания сообщения Отправителем	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='outMsgDate' and @type='xsd:date' and @use='optional']
13	@inMsgId (13-13)	Порядковый номер сообщения, присваиваемый ему последовательно по времени регистрации (входящий номер)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='inMsgId' and @type='xsd:string' and @use='required']
14	@regTime (14-14)	Дата и время внесения в раздел 1 реестра договоров записи о сообщении	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='regTime' and @type='xsd:dateTime' and @use='required']
15	@operday (15-15)	Дата операционного дня регистрации входящего сообщения в Репозитории	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='operday' and @type='xsd:date' and @use='required']
16	@replyMsgId (16-16)	Исходящий номер ответа Репозитория на полученное сообщение	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='replyMsgId' and @type='xsd:string']
17	@replyMsgTime (17-17)	Дата ответа Репозитория на полученное сообщение	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='replyMsgTime' and @type='xsd:dateTime']
18	@rft (18-18)	Признак "true" (да)/"false" (нет) - предоставление информации о финансовых сделках в Регистратор финансовых транзакций (РФТ)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='rft' and @type='xsd:boolean' and @default='false']
19	pending (19-28)	Состояние обработки сообщений в статусе "Ожидание"	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='MessagesOfType']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='pending' and @type='MessagesGroup']

20	message (20-28)	Блок с составом информации о сообщении	Заполняемый элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='MessagesGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='message' and @type='Message']
21	@outMsgId (21-21)	Исходящий номер сообщения Отправителя	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='outMsgId' and @type='xsd:string' and @use='optional']
22	@outMsgDate (22-22)	Дата/время создания сообщения Отправителем	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='outMsgDate' and @type='xsd:date' and @use='optional']
23	@inMsgId (23-23)	Порядковый номер сообщения, присваиваемый ему последовательно по времени регистрации (входящий номер)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='inMsgId' and @type='xsd:string' and @use='required']
24	@regTime (24-24)	Дата и время внесения в раздел 1 реестра договоров записи о сообщении	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='regTime' and @type='xsd:dateTime' and @use='required']
25	@operday (25-25)	Дата операционного дня регистрации входящего сообщения в Репозитории	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='operday' and @type='xsd:date' and @use='required']
26	@replyMsgId (26-26)	Исходящий номер ответа Репозитория на полученное сообщение	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='replyMsgId' and @type='xsd:string']
27	@replyMsgTime (27-27)	Дата ответа Репозитория на полученное сообщение	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='replyMsgTime' and @type='xsd:dateTime']
28	@rft (28-28)	Признак "true" (да)/"false" (нет) - предоставление информации о финансовых сделках в Регистратор финансовых транзакций (РФТ)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='rft' and @type='xsd:boolean' and @default='false']
29	registered (29-38)	Состояние обработки сообщений в статусе "Зарегистрировано"	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='MessagesOfType']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='registered' and @type='MessagesGroup']
30	message (30-38)	Блок с составом информации о сообщении	Заполняемый элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='MessagesGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='message' and @type='Message']
31	@outMsgId (31-31)	Исходящий номер сообщения Отправителя	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='outMsgId' and @type='xsd:string' and @use='optional']
32	@outMsgDate (32-32)	Дата/время создания сообщения Отправителем	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='outMsgDate' and @type='xsd:date' and @use='optional']

33	@inMsgId (33-33)	Порядковый номер сообщения, присваиваемый ему последовательно по времени регистрации (входящий номер)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='inMsgId' and @type='xsd:string' and @use='required']
34	@regTime (34-34)	Дата и время внесения в раздел 1 реестра договоров записи о сообщении	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='regTime' and @type='xsd:dateTime' and @use='required']
35	@operday (35-35)	Дата операционного дня регистрации входящего сообщения в Репозитории	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='operday' and @type='xsd:date' and @use='required']
36	@replyMsgId (36-36)	Исходящий номер ответа Репозитория на полученное сообщение	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='replyMsgId' and @type='xsd:string']
37	@replyMsgTime (37-37)	Дата ответа Репозитория на полученное сообщение	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='replyMsgTime' and @type='xsd:dateTime']
38	@rft (38-38)	Признак "true" (да)/"false" (нет) - предоставление информации о финансовых сделках в Регистратор финансовых транзакций (РФТ)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Message']/xsd:attribute[@name='rft' and @type='xsd:boolean' and @default='false']

3. Состав записей в журнале Раздела 2 Реестра договоров содержит поля, поименованные в Инструкции по заполнению форм Торгового репозитория в разделах I -XIII и заполненные Клиентом в соответствии с форматом Репозитория.

4. Состав записей в журнале Раздела 3 Реестра договоров содержит поля:

№	Название элемента в формате xml	Описание элемента	Тип элемента	Детальный путь (xpath) к элементу в указанной xsd-схеме
1	regJournal (1-170)	Журнал записей в разделе 3 реестра договоров	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:element[@name='regJournal' and @type='RegJournal']
2	senderRecords (2-170)	Записи, относящиеся к участнику	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RegJournal']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='senderRecords' and @type='SenderContracts']
3	@partyId (3-3)	Репозитарный код стороны договора, обязанной предоставлять информацию в Репозиторий, или Информирующего лица	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='SenderContracts']/xsd:attribute[@name='partyId' and @use='required']
4	@partyName (4-4)	Наименование стороны договора, обязанной предоставлять информацию в Репозиторий, или Информирующего лица	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='SenderContracts']/xsd:attribute[@name='partyName' and @use='required']
5	@lei (5-5)	Международный код идентификации юридического лица (код LEI) – стороны договора, обязанной предоставлять информацию в Репозиторий, или Информирующего лица	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='SenderContracts']/xsd:attribute[@name='lei' and @use='required']

6	contracts (6-38)	Записи об информации о договорах/финансовых сделках	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='SenderContracts']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='contracts' and @type='RecordsBusinessGroup']
7	registration (7-22)	Внесение записи в разделе 2 реестра договоров	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordsBusinessGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='registration' and @type='RecordsGroup']
8	record (8-22)	Запись в реестре	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordsGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='record' and @type='RecordWithUtilList']
9	@recordType (9-9)	Вид записи в Разделе 2 Реестра договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='recordType' and @type='xsd:string']
10	@messageId (10-10)	Порядковый номер сообщения, присваиваемый ему последовательно по времени регистрации (входящий номер)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='messageId' and @use='required' and @type='xsd:string']
11	@senderMessageId (11-11)	Порядковый номер (исходящий номер) сообщения	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='senderMessageId' and @use='optional' and @type='xsd:string']
12	@messageRegTime (12-12)	Дата и время внесения в Раздел 1 Реестра договоров записи о сообщении	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='messageRegTime' and @type='xsd:dateTime']
13	@registryRecordId (13-13)	Номер записи, внесенной в Раздел 2 Реестра договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='registryRecordId' and @use='optional' and @type='xsd:string']
14	@registryRegTime (14-14)	Дата и время записи, внесенной в Раздел 2 Реестра договоров, или дата уведомления об отказе во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='registryRegTime' and @type='xsd:dateTime']
15	@result (15-15)	Результат обработки	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='result' and @type='xsd:string']
16	@uti (16-16)	Уникальный код идентификации договора (код UTI)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='uti' and @use='optional' and @type='xsd:string']
17	@dataType (17-17)	Сведения для внесения в реестр	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='dataType' and @type='xsd:string']
18	@rejectCode (18-18)	Код основания для отказа во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rejectCode' and @use='optional' and @type='xsd:string']
19	@rejectDescription (19-19)	Основание для отказа во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rejectDescription' and @use='optional' and @type='xsd:string']

20	@rft (20-20)	Признак "true" (да)/"false" (нет) - предоставление информации о финансовых сделках в Регистратор финансовых транзакций (РФТ)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rft' and @type='xsd:boolean']
21	utiList (21-22)	Список уникальных кодов идентификации договора (код UTI)	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordWithUtiList']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='Record']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='utiList' and @type='UtiList']
22	uti (22-22)	Уникальный код идентификации договора (код UTI)	Заполняемый элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='UtiList']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='uti' and @type='xsd:string']
23	amendment (23-38)	Внесение изменение ранее внесенной записи в разделе 2 реестра договоров	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordsBusinessGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='amendment' and @type='RecordsGroup']
24	record (24-38)	Запись в реестре	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordsGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='record' and @type='RecordWithUtiList']
25	@recordType (25-25)	Вид записи в Разделе 2 Реестра договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='recordType' and @type='xsd:string']
26	@messageId (26-26)	Порядковый номер сообщения, присваиваемый ему последовательно по времени регистрации (входящий номер)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='messageId' and @use='required' and @type='xsd:string']
27	@senderMessageId (27-27)	Порядковый номер (исходящий номер) сообщения	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='senderMessageId' and @use='optional' and @type='xsd:string']
28	@messageRegTime (28-28)	Дата и время внесения в Раздел 1 Реестра договоров записи о сообщении	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='messageRegTime' and @type='xsd:dateTime']
29	@registryRecordId (29-29)	Номер записи, внесенной в Раздел 2 Реестра договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='registryRecordId' and @use='optional' and @type='xsd:string']
30	@registryRegTime (30-30)	Дата и время записи, внесенной в Раздел 2 Реестра договоров, или дата уведомления об отказе во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='registryRegTime' and @type='xsd:dateTime']
31	@result (31-31)	Результат обработки	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='result' and @type='xsd:string']
32	@uti (32-32)	Уникальный код идентификации договора (код UTI)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='uti' and @use='optional' and @type='xsd:string']
33	@dataType (33-33)	Сведения для внесения в реестр	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='dataType' and @type='xsd:string']

34	@rejectCode (34-34)	Код основания для отказа во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rejectCode' and @use='optional' and @type='xsd:string']
35	@rejectDescription (35-35)	Основание для отказа во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rejectDescription' and @use='optional' and @type='xsd:string']
36	@rft (36-36)	Признак "true" (да)/"false" (нет) - предоставление информации о финансовых сделках в Регистратор финансовых транзакций (РФТ)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rft' and @type='xsd:boolean']
37	utiList (37-38)	Список уникальных кодов идентификации договора (код UTI)	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordWithUtiList']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='Record']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='utiList' and @type='UtiList']
38	uti (38-38)	Уникальный код идентификации договора (код UTI)	Заполняемый элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='UtiList']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='uti' and @type='xsd:string']
39	masterAgreements (39-71)	Записи об информации о Генеральных соглашениях	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='SenderContracts']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='masterAgreements' and @type='RecordsBusinessGroup']
40	registration (40-55)	Внесение записи в разделе 2 реестра договоров	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordsBusinessGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='registration' and @type='RecordsGroup']
41	record (41-55)	Запись в реестре	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordsGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='record' and @type='RecordWithUtiList']
42	@recordType (42-42)	Вид записи в Разделе 2 Реестра договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='recordType' and @type='xsd:string']
43	@messageId (43-43)	Порядковый номер сообщения, присваиваемый ему последовательно по времени регистрации (входящий номер)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='messageId' and @use='required' and @type='xsd:string']
44	@senderMessageId (44-44)	Порядковый номер (исходящий номер) сообщения	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='senderMessageId' and @use='optional' and @type='xsd:string']
45	@messageRegTime (45-45)	Дата и время внесения в Раздел 1 Реестра договоров записи о сообщении	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='messageRegTime' and @type='xsd:dateTime']
46	@registryRecordId (46-46)	Номер записи, внесенной в Раздел 2 Реестра договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='registryRecordId' and @use='optional' and @type='xsd:string']

47	@registryRegTime (47-47)	Дата и время записи, внесенной в Раздел 2 Реестра договоров, или дата уведомления об отказе во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='registryRegTime' and @type='xsd:dateTime']
48	@result (48-48)	Результат обработки	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='result' and @type='xsd:string']
49	@uti (49-49)	Уникальный код идентификации договора (код UTI)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='uti' and @use='optional' and @type='xsd:string']
50	@dataType (50-50)	Сведения для внесения в реестр	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='dataType' and @type='xsd:string']
51	@rejectCode (51-51)	Код основания для отказа во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rejectCode' and @use='optional' and @type='xsd:string']
52	@rejectDescription (52-52)	Основание для отказа во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rejectDescription' and @use='optional' and @type='xsd:string']
53	@rft (53-53)	Признак "true" (да)/"false" (нет) - предоставление информации о финансовых сделках в Регистратор финансовых транзакций (РФТ)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rft' and @type='xsd:boolean']
54	utiList (54-55)	Список уникальных кодов идентификации договора (код UTI)	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordWithUtiList']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='Record']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='utiList' and @type='UtiList']
55	uti (55-55)	Уникальный код идентификации договора (код UTI)	Заполняемый элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='UtiList']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='uti' and @type='xsd:string']
56	amendment (56-71)	Внесение изменение ранее внесенной записи в разделе 2 реестра договоров	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordsBusinessGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='amendment' and @type='RecordsGroup']
57	record (57-71)	Запись в реестре	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordsGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='record' and @type='RecordWithUtiList']
58	@recordType (58-58)	Вид записи в Разделе 2 Реестра договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='recordType' and @type='xsd:string']
59	@messageId (59-59)	Порядковый номер сообщения, присваиваемый ему последовательно по времени регистрации (входящий номер)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='messageId' and @use='required' and @type='xsd:string']
60	@senderMessageId (60-60)	Порядковый номер (исходящий номер) сообщения	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='senderMessageId' and @use='optional' and @type='xsd:string']
61	@messageRegTime (61-61)	Дата и время внесения в Раздел 1 Реестра договоров записи о сообщении	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='messageRegTime' and @type='xsd:dateTime']

62	@registryRecordId (62-62)	Номер записи, внесенной в Раздел 2 Реестра договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='registryRecordId' and @use='optional' and @type='xsd:string']
63	@registryRegTime (63-63)	Дата и время записи, внесенной в Раздел 2 Реестра договоров, или дата уведомления об отказе во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='registryRegTime' and @type='xsd:dateTime']
64	@result (64-64)	Результат обработки	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='result' and @type='xsd:string']
65	@uti (65-65)	Уникальный код идентификации договора (код UTI)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='uti' and @use='optional' and @type='xsd:string']
66	@dataType (66-66)	Сведения для внесения в реестр	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='dataType' and @type='xsd:string']
67	@rejectCode (67-67)	Код основания для отказа во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rejectCode' and @use='optional' and @type='xsd:string']
68	@rejectDescription (68-68)	Основание для отказа во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rejectDescription' and @use='optional' and @type='xsd:string']
69	@rft (69-69)	Признак "true" (да)/"false" (нет) - предоставление информации о финансовых сделках в Регистратор финансовых транзакций (РФТ)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rft' and @type='xsd:boolean']
70	utiList (70-71)	Список уникальных кодов идентификации договора (код UTI)	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordWithUtiList']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='Record']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='utiList' and @type='UtiList']
71	uti (71-71)	Уникальный код идентификации договора (код UTI)	Заполняемый элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='UtiList']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='uti' and @type='xsd:string']
72	transfersAndExecutions (72-104)	Записи об информации об уплате маржевых сумм	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='SenderContracts']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='transfersAndExecutions' and @type='RecordsBusinessGroup']
73	registration (73-88)	Внесение записи в разделе 2 реестра договоров	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordsBusinessGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='registration' and @type='RecordsGroup']
74	record (74-88)	Запись в реестре	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordsGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='record' and @type='RecordWithUtiList']
75	@recordType (75-75)	Вид записи в Разделе 2 Реестра договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='recordType' and @type='xsd:string']

76	@messageId (76-76)	Порядковый номер сообщения, присваиваемый ему последовательно по времени регистрации (входящий номер)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='messageId' and @use='required' and @type='xsd:string']
77	@senderMessageId (77-77)	Порядковый номер (исходящий номер) сообщения	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='senderMessageId' and @use='optional' and @type='xsd:string']
78	@messageRegTime (78-78)	Дата и время внесения в Раздел 1 Реестра договоров записи о сообщении	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='messageRegTime' and @type='xsd:dateTime']
79	@registryRecordId (79-79)	Номер записи, внесенной в Раздел 2 Реестра договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='registryRecordId' and @use='optional' and @type='xsd:string']
80	@registryRegTime (80-80)	Дата и время записи, внесенной в Раздел 2 Реестра договоров, или дата уведомления об отказе во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='registryRegTime' and @type='xsd:dateTime']
81	@result (81-81)	Результат обработки	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='result' and @type='xsd:string']
82	@uti (82-82)	Уникальный код идентификации договора (код UTI)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='uti' and @use='optional' and @type='xsd:string']
83	@dataType (83-83)	Сведения для внесения в реестр	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='dataType' and @type='xsd:string']
84	@rejectCode (84-84)	Код основания для отказа во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rejectCode' and @use='optional' and @type='xsd:string']
85	@rejectDescription (85-85)	Основание для отказа во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rejectDescription' and @use='optional' and @type='xsd:string']
86	@rft (86-86)	Признак "true" (да)/"false" (нет) - предоставление информации о финансовых сделках в Регистратор финансовых транзакций (РФТ)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rft' and @type='xsd:boolean']
87	utiList (87-88)	Список уникальных кодов идентификации договора (код UTI)	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordWithUtiList']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='Record']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='utiList' and @type='UtiList']
88	uti (88-88)	Уникальный код идентификации договора (код UTI)	Заполняемый элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='UtiList']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='uti' and @type='xsd:string']
89	amendment (89-104)	Внесение изменение ранее внесенной записи в разделе 2 реестра договоров	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordsBusinessGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='amendment' and @type='RecordsGroup']

90	record (90-104)	Запись в реестре	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordsGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='record' and @type='RecordWithUtiList']
91	@recordType (91-91)	Вид записи в Разделе 2 Реестра договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='recordType' and @type='xsd:string']
92	@messageId (92-92)	Порядковый номер сообщения, присваиваемый ему последовательно по времени регистрации (входящий номер)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='messageId' and @use='required' and @type='xsd:string']
93	@senderMessageId (93-93)	Порядковый номер (исходящий номер) сообщения	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='senderMessageId' and @use='optional' and @type='xsd:string']
94	@messageRegTime (94-94)	Дата и время внесения в Раздел 1 Реестра договоров записи о сообщении	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='messageRegTime' and @type='xsd:dateTime']
95	@registryRecordId (95-95)	Номер записи, внесенной в Раздел 2 Реестра договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='registryRecordId' and @use='optional' and @type='xsd:string']
96	@registryRegTime (96-96)	Дата и время записи, внесенной в Раздел 2 Реестра договоров, или дата уведомления об отказе во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='registryRegTime' and @type='xsd:dateTime']
97	@result (97-97)	Результат обработки	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='result' and @type='xsd:string']
98	@uti (98-98)	Уникальный код идентификации договора (код UTI)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='uti' and @use='optional' and @type='xsd:string']
99	@dataType (99-99)	Сведения для внесения в реестр	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='dataType' and @type='xsd:string']
100	@rejectCode (100-100)	Код основания для отказа во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rejectCode' and @use='optional' and @type='xsd:string']
101	@rejectDescription (101-101)	Основание для отказа во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rejectDescription' and @use='optional' and @type='xsd:string']
102	@rft (102-102)	Признак "true" (да)/"false" (нет) - предоставление информации о финансовых сделках в Регистратор финансовых транзакций (РФТ)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rft' and @type='xsd:boolean']
103	utiList (103-104)	Список уникальных кодов идентификации договора (код UTI)	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordWithUtiList']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='Record']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='utiList' and @type='UtiList']
104	uti (104-104)	Уникальный код идентификации договора (код UTI)	Заполняемый элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='UtiList']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='uti' and @type='xsd:string']

105	markToMarkets (105-137)	Записи об информации о справедливой (оценочной) стоимости	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='SenderContracts']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='markToMarkets' and @type='RecordsBusinessGroup']
106	registration (106-121)	Внесение записи в разделе 2 реестра договоров	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordsBusinessGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='registration' and @type='RecordsGroup']
107	record (107-121)	Запись в реестре	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordsGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='record' and @type='RecordWithUtilList']
108	@recordType (108-108)	Вид записи в Разделе 2 Реестра договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='recordType' and @type='xsd:string']
109	@messageId (109-109)	Порядковый номер сообщения, присваиваемый ему последовательно по времени регистрации (входящий номер)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='messageId' and @use='required' and @type='xsd:string']
110	@senderMessageId (110-110)	Порядковый номер (исходящий номер) сообщения	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='senderMessageId' and @use='optional' and @type='xsd:string']
111	@messageRegTime (111-111)	Дата и время внесения в Раздел 1 Реестра договоров записи о сообщении	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='messageRegTime' and @type='xsd:dateTime']
112	@registryRecordId (112-112)	Номер записи, внесенной в Раздел 2 Реестра договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='registryRecordId' and @use='optional' and @type='xsd:string']
113	@registryRegTime (113-113)	Дата и время записи, внесенной в Раздел 2 Реестра договоров, или дата уведомления об отказе во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='registryRegTime' and @type='xsd:dateTime']
114	@result (114-114)	Результат обработки	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='result' and @type='xsd:string']
115	@uti (115-115)	Уникальный код идентификации договора (код UTI)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='uti' and @use='optional' and @type='xsd:string']
116	@dataType (116-116)	Сведения для внесения в реестр	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='dataType' and @type='xsd:string']
117	@rejectCode (117-117)	Код основания для отказа во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rejectCode' and @use='optional' and @type='xsd:string']
118	@rejectDescription (118-118)	Основание для отказа во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rejectDescription' and @use='optional' and @type='xsd:string']

119	@rft (119-119)	Признак "true" (да)/"false" (нет) - предоставление информации о финансовых сделках в Регистратор финансовых транзакций (РФТ)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rft' and @type='xsd:boolean']
120	utiList (120-121)	Список уникальных кодов идентификации договора (код UTI)	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordWithUtiList']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='Record']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='utiList' and @type='UtiList']
121	uti (121-121)	Уникальный код идентификации договора (код UTI)	Заполняемый элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='UtiList']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='uti' and @type='xsd:string']
122	amendment (122-137)	Внесение изменение ранее внесенной записи в разделе 2 реестра договоров	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordsBusinessGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='amendment' and @type='RecordsGroup']
123	record (123-137)	Запись в реестре	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordsGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='record' and @type='RecordWithUtiList']
124	@recordType (124-124)	Вид записи в Разделе 2 Реестра договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='recordType' and @type='xsd:string']
125	@messageId (125-125)	Порядковый номер сообщения, присваиваемый ему последовательно по времени регистрации (входящий номер)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='messageId' and @use='required' and @type='xsd:string']
126	@senderMessageId (126-126)	Порядковый номер (исходящий номер) сообщения	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='senderMessageId' and @use='optional' and @type='xsd:string']
127	@messageRegTime (127-127)	Дата и время внесения в Раздел 1 Реестра договоров записи о сообщении	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='messageRegTime' and @type='xsd:dateTime']
128	@registryRecordId (128-128)	Номер записи, внесенной в Раздел 2 Реестра договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='registryRecordId' and @use='optional' and @type='xsd:string']
129	@registryRegTime (129-129)	Дата и время записи, внесенной в Раздел 2 Реестра договоров, или дата уведомления об отказе во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='registryRegTime' and @type='xsd:dateTime']
130	@result (130-130)	Результат обработки	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='result' and @type='xsd:string']
131	@uti (131-131)	Уникальный код идентификации договора (код UTI)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='uti' and @use='optional' and @type='xsd:string']
132	@dataType (132-132)	Сведения для внесения в реестр	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='dataType' and @type='xsd:string']
133	@rejectCode (133-133)	Код основания для отказа во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rejectCode' and @use='optional' and @type='xsd:string']

134	@rejectDescription (134-134)	Основание для отказа во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rejectDescription' and @use='optional' and @type='xsd:string']
135	@rft (135-135)	Признак "true" (да)/"false" (нет) - предоставление информации о финансовых сделках в Регистратор финансовых транзакций (РФТ)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rft' and @type='xsd:boolean']
136	utiList (136-137)	Список уникальных кодов идентификации договора (код UTI)	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordWithUtiList']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='Record']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='utiList' and @type='UtiList']
137	uti (137-137)	Уникальный код идентификации договора (код UTI)	Заполняемый элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='UtiList']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='uti' and @type='xsd:string']
138	executionStatuses (138-170)	Записи об информации о состоянии обязательств по договорам/финансовым сделкам	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='SenderContracts']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='executionStatuses' and @type='RecordsBusinessGroup']
139	registration (139-154)	Внесение записи в разделе 2 реестра договоров	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordsBusinessGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='registration' and @type='RecordsGroup']
140	record (140-154)	Запись в реестре	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordsGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='record' and @type='RecordWithUtiList']
141	@recordType (141-141)	Вид записи в Разделе 2 Реестра договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='recordType' and @type='xsd:string']
142	@messageId (142-142)	Порядковый номер сообщения, присваиваемый ему последовательно по времени регистрации (входящий номер)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='messageId' and @use='required' and @type='xsd:string']
143	@senderMessageId (143-143)	Порядковый номер (исходящий номер) сообщения	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='senderMessageId' and @use='optional' and @type='xsd:string']
144	@messageRegTime (144-144)	Дата и время внесения в Раздел 1 Реестра договоров записи о сообщении	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='messageRegTime' and @type='xsd:dateTime']
145	@registryRecordId (145-145)	Номер записи, внесенной в Раздел 2 Реестра договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='registryRecordId' and @use='optional' and @type='xsd:string']
146	@registryRegTime (146-146)	Дата и время записи, внесенной в Раздел 2 Реестра договоров, или дата уведомления об отказе во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='registryRegTime' and @type='xsd:dateTime']
147	@result (147-147)	Результат обработки	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='result' and @type='xsd:string']

148	@uti (148-148)	Уникальный код идентификации договора (код UTI)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='uti' and @use='optional' and @type='xsd:string']
149	@dataType (149-149)	Сведения для внесения в реестр	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='dataType' and @type='xsd:string']
150	@rejectCode (150-150)	Код основания для отказа во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rejectCode' and @use='optional' and @type='xsd:string']
151	@rejectDescription (151-151)	Основание для отказа во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rejectDescription' and @use='optional' and @type='xsd:string']
152	@rft (152-152)	Признак "true" (да)/"false" (нет) - предоставление информации о финансовых сделках в Регистратор финансовых транзакций (РФТ)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rft' and @type='xsd:boolean']
153	utiList (153-154)	Список уникальных кодов идентификации договора (код UTI)	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordWithUtiList']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='Record']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='utiList' and @type='UtiList']
154	uti (154-154)	Уникальный код идентификации договора (код UTI)	Заполняемый элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='UtiList']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='uti' and @type='xsd:string']
155	amendment (155-170)	Внесение изменение ранее внесенной записи в разделе 2 реестра договоров	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordsBusinessGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='amendment' and @type='RecordsGroup']
156	record (156-170)	Запись в реестре	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordsGroup']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='record' and @type='RecordWithUtiList']
157	@recordType (157-157)	Вид записи в Разделе 2 Реестра договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='recordType' and @type='xsd:string']
158	@messageId (158-158)	Порядковый номер сообщения, присваиваемый ему последовательно по времени регистрации (входящий номер)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='messageId' and @use='required' and @type='xsd:string']
159	@senderMessageId (159-159)	Порядковый номер (исходящий номер) сообщения	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='senderMessageId' and @use='optional' and @type='xsd:string']
160	@messageRegTime (160-160)	Дата и время внесения в Раздел 1 Реестра договоров записи о сообщении	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='messageRegTime' and @type='xsd:dateTime']
161	@registryRecordId (161-161)	Номер записи, внесенной в Раздел 2 Реестра договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='registryRecordId' and @use='optional' and @type='xsd:string']

162	@registryRegTime (162-162)	Дата и время записи, внесенной в Раздел 2 Реестра договоров, или дата уведомления об отказе во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='registryRegTime' and @type='xsd:dateTime']
163	@result (163-163)	Результат обработки	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='result' and @type='xsd:string']
164	@uti (164-164)	Уникальный код идентификации договора (код UTI)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='uti' and @use='optional' and @type='xsd:string']
165	@dataType (165-165)	Сведения для внесения в реестр	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='dataType' and @type='xsd:string']
166	@rejectCode (166-166)	Код основания для отказа во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rejectCode' and @use='optional' and @type='xsd:string']
167	@rejectDescription (167-167)	Основание для отказа во внесении записи в Реестр договоров	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rejectDescription' and @use='optional' and @type='xsd:string']
168	@rft (168-168)	Признак "true" (да)/"false" (нет) - предоставление информации о финансовых сделках в Регистратор финансовых транзакций (РФТ)	Атрибут (технический признак) элемента	xsd:schema/xsd:complexType[@name='Record']/xsd:attribute[@name='rft' and @type='xsd:boolean']
169	utiList (169-170)	Список уникальных кодов идентификации договора (код UTI)	Групповой элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='RecordWithUtiList']/xsd:complexContent/xsd:extension[@base='Record']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='utiList' and @type='UtiList']
170	uti (170-170)	Уникальный код идентификации договора (код UTI)	Заполняемый элемент	xsd:schema/xsd:complexType[@name='UtiList']/xsd:sequence[1]/xsd:element[@name='uti' and @type='xsd:string']

**Справочники кодов, используемых для формирования
извещений и уведомлений репозитария (RM002/CM002)**

Код типа отказа	Описание причины	Примечание
NEXS	Сообщение содержит сведения о договоре, заключенном на условиях Генерального соглашения, которое не внесено в реестр договоров и не представлено одновременно с сообщением о договоре	В соответствии с Указанием Банка России от 16 августа 2016 г. N 4104-У
BSGN	Сообщение подписано не уполномоченным лицом	
AEXS	Сведения о договоре, содержащиеся в сообщении, уже внесены в реестр договоров	
BINF	Сообщение получено от лица, которое в соответствии с Генеральным соглашением не определено в качестве информирующего	
BFMT	Сообщение составлено с нарушением установленных требований	
RCDP	Отказ контрагента в подтверждении договора	В соответствии с правилами обмена сообщениями с Репозитарием
ICAG	Неверно указан контрагент: Идентификатор контрагента не распознан/отсутствует/ или Неверно указаны реквизиты контрагента	
AEXS	Сведения о договоре, содержащиеся в сообщении, уже внесены в реестр договоров	
NARR	Иная причина	

**Справочник «Коды причин», для направления
Извещения об отказе в исполнении/регистрации (RM002)**

Описание ошибки может быть параметрическим – т.е. в описание могут встречаться параметры, на место которых должны быть подставлены значения, специфичные для места возникновения ошибки.

В качестве параметров в текстовку ошибки подставляются символы ‘#s’. Описание подставляемых параметров даётся в месте документа, описывающем возникновение ошибки.

Код причины (внешний)	Код причины (внутренний)	Описание причины (рус.)	Описание причины (анг.)	Тип причины
NRD001	INVALID_TAG	В сообщении клиента отсутствует или неверно заполнен ключевой элемент #s. Сообщение не может быть обработано в Репозитории	The core element #s is missing in the message or has the invalid value. The message can not be processed	BFMT
NRD002	IN_MSG_SENDER_NOTFOUND	Отправитель сообщения не зарегистрирован в Репозитории	Sender of the message is not registered in the repository	NARR
NRD003	FILE_ID_IS_NOT_SET	К сообщению не приложен файл со сканом документа	The file with a scanned document is not attached	NARR
NRD004	XML_FILE_NOT_FOUND	В сообщении не указано имя файла - приложения	The message does not contain the name of the attached file	NARR
NRD005	CONTRACT_FORM_ID_NOT_FOUND	Анкета договора с идентификационным номером #s не существует	The form with ID #s is not found	NARR
NRD006	CONTRACT_NOT_REGISTERED_YET	Анкета договора еще не зарегистрирована	The form has not been registered	NARR
NRD007	XSD_ERROR_VALIDATION	Ошибка валидации входящего сообщения: #s	Message validation error: #s	BFMT
NRD008	XML_SIGNER_NOT_FOUND	Сообщение не содержит подписанта	The message does not contain any signer	NARR
NRD009	CONTRACT_NOT_FOUND	Исходный документ не найден	The original document is not found	NARR
NRD010	CONTRACT_TYPE_NOT_EQUALS	Тип договора #s, указанный в сообщении не совпадает с типом договора #s для Генерального соглашения с номером #s	The contract type #s indicated in the message does not coincide with the contract type #s indicated in the Master Agreement № #s	NARR
NRD011	CONTRACT_ALREADY_REGISTERED	Анкета договора уже зарегистрирована	The form is already registered	AEXS
NRD012	MA_ALREADY_REJECTED	По анкете Генерального соглашения контрагентом направлен отказ	The counterparty has declined the Master Agreement form	NARR

NRD013	XML_ANKET_WITH_STATU S_NOT_FOUN D	Не найдено первичной анкеты в статусе "ожидание реакции контрагента"	No initial message with the status "Pending" is found	NARR
NRD014	MSD_DATE_N OT_CORRECT ED	С момента значения указанного в поле "Время создания сообщения" прошло более #s дней	More than #s days has passed since the date set in "Message creation time" field	NARR
NRD015	IN_MSG_SEND ER_NEQUAL_ REAL	Указанный в сообщении отправитель не совпадает с реальным отправителем сообщения	The sender specified in the message does not coincide with the real sender of the message	BINF
NRD016	MA_NOT_SUP PORTED	Генеральное соглашение #s на текущую дату не обслуживается в Репозитории	There is no Master Agreement #s in the repository's register on a given date	NARR
NRD017	INVALID_MA_ OR_SIDES	Неверно указан регистрационный номер или стороны Генерального соглашения/договора	Master agreement registration number is not valid or Master agreement/contract parties are not correctly specified	NARR
NRD018	CONTRACT_A LREADY_REJE CTED	Анкета договора уже отменена	The form of contract has already been rejected	NARR
NRD021	REPCONT_IS_ NOT_REGISTR ED	У клиента #s с кодом #s не заключено репозитарное соглашение	The client #s with the code #s is not the repository's client	ICAG
NRD022	SIDE_HAS_NO T_INFORMAT OR	Сторона #s по Генеральному соглашению не имеет информирующих лиц и не сможет отчитаться по договорам, заключенным в рамках Генерального соглашения. Сообщение зарегистрировано в журнале входящих с номером №#s	The party #s of the Master Agreement does not have Reporting Agents and cannot report trades under the Master Agreement. The message is registered in the Log with the number N#s.	ICAG
NRD023	SIDE_RT_HAS _NOT_INFOR MATOR	У стороны #s присутствует ИЛ с типом договора #s, для стороны #s необходимо указать ИЛ с аналогичным типом договора	The party #s has a Reporting agent for contract type #s. For the party #s a Reporting agent with the same contract type should be indicated	BINF
NRD024	SIDE_HAS_TO O_MANY_INF ORM	Сторона по Генеральному соглашению имеет несколько информирующих лиц по типу договора, согласование договора с несколькими информирующими лицами невозможно	The party has more than one Reporting Agent for the specified contract type. It is impossible to reconcile the Contract with different Reporting Agents	BINF

NRD025	GETTING_NEW_DATA_DOCUMENT	В сообщении #s получена анкета с новыми данными	A form with new parameters is received in the message #s	NARR
NRD026	PARTY_NOT_CORRECT	Заполнение блоков Party сообщения не соответствует правилам заполнения сообщений Репозитория	The block "party" should be filled out according to the rules of message creation	BFMT
NRD027	WRONG_SENDER	Отправитель, указанный в заголовке сообщения (header/sentBy) не соответствует отправителю, указанному в блоке party/[@id="Sender"]	The Sender defined in the header of a message (header/sentBy) doesn't match the sender in the <party/[@id="Sender"]> block	BFMT
NRD028	MSG_RECEIVER_IS_NOT_REPOSITORY	Получатель сообщения не является Репозитарием	The receiver of a message is not a Repository	NARR
NRD029	MA_ALREADY_REGISTERED	Анкета генерального соглашения с указанными сторонами за указанную дату уже зарегистрирована #s	The form of Master Agreement with specified parties for the date is already registered #s	NARR
NRD030	XML_DIFF_IN_CONTRACTS	По результатам сверки с анкетой контрагента выявлены расхождения, препятствующие регистрации вашей анкеты	There are differences found when comparing the counterparty's messages. The form cannot be registered	NARR
NRD031	RF006_REASON	Отказ в регистрации анкеты №#s от клиента #s, поскольку #s отказал в согласовании анкеты, причина: #s	The form №#s sent on behalf of the client #s is not registered because the client #s has refused to confirm with the reason: #s	RCDP
NRD032	ANKET_SIDE_NOT_FOUND	Отправитель не является уполномоченным информирующим лицом для указанных(-ой) сторон(-ы)	The sender is not authorized a Reporting agent for the specified party(-ies)	NARR
NRD033	CONTRACT_NOT_SUPPORTED	В сообщении указан номер договора #s, не обслуживаемого в данный момент в Репозитории	There is no Contract #s in the repository's register on a given date	NARR
NRD034	Duplicate_Correlation_ID	В Репозитории уже существует входящее сообщение (in_msg_id = #s) с корреляционным идентификатором отправителя #s присланное от отправителя #s	The message (in_msg_id = #s) with <correlationId> from the sender #s has already been received by the Repository from the sender #s	NARR
NRD035	MSD_FUTURE_DATE	В сообщении указана будущая дата отправки	The message contains a future send date	NARR
NRD036	BAD_STATUS_CANCEL_REPLACE	Заменяемое/отменяемое сообщение находится в статусе #s. Замена/отмена невозможна	The message that should be replaced/cancelled has the status #s. It is impossible to	NARR

			make replacement/cancellation	
NRD037	RPLC_CANC_NOT_FOUND	Заменяемое/отменяемое сообщение не найдено. Замена/отмена невозможна	The message that should be replaced/cancelled is not found. It is impossible to make replacement/cancellation	NEXS
NRD038	RPLC_MESSAGE	В сообщении #s получено требование о замене сообщения	Message #s has got replace request	NARR
NRD039	CONTRACT_NOT_REGISTERED	Указанное в анкете договора Генеральное соглашение не зарегистрировано в Репозитории	The Master Agreement specified in the Contract registration form is not registered	NEXS
NRD040	EXPIRY_CANCELLATION	Истек срок исполнения документа	The report execution term has expired	NARR
NRD041	XML_MEMBER_NOT_REGISTERED	Участник с кодом #s типа #s не зарегистрирован в Репозитории	Party with code #s and code type #s is not the repository's client	ICAG
NRD042	CLIENT_IS_NOT_EQUAL_SENDER	Отправитель #s не имеет полномочий для подачи сообщения от имени клиента #s. Сообщение зарегистрировано в журнале входящих с номером №#s	Sender #s has no right to submit messages on behalf of the client #s. The message is registered in the Log with the number N#s	BINF
NRD043	REPORT_DATA_NOT_FOUND	По параметрам, указанным в запросе, не найдено данных в реестре договоров Репозитория	Messages with specified parameters are not found in the Contracts register	NARR
NRD044	XML_WRONG_SHORT_NAME	Полное наименование контрагента #s с кодом #s и типом идентификационного кода #s не совпадает с данными в Репозитории	Short name of the party #s with code #s and code type #s does not coincide with the code from the NSD's base of clients	NARR
NRD045	HREF_CONTAINS_SENDER	Аттрибут href не может содержать значение Sender	"href" attribute cannot have the value "Sender"	NARR
NRD046	SENDER_OF_CM092_IS_NOT_CORRECT	Отправитель сообщения не является информирующим лицом/базовым информирующим лицом по одному или нескольким указанным договорам/одному ГС в анкетах CM092/CM094. Невозможно согласовать анкету. Сообщение зарегистрировано в журнале входящих с номером №#s	The sender of the message is not a Reporting Agent/Principal reporting agent for one or multiple contracts/one Master agreement in the reporting forms CM092/CM094. Further processing is not possible.. The message is registered in the Log with the number N#s	NARR
NRD047	TWO_MANY_IDS	Невозможно однозначно определить информирующее лицо для стороны #s	It is impossible to identify the Reporting Agent of the party #s	BINF

NRD048	PARTY_NOT_COMPLETE	Список блоков «Party» (блоков, описывающих участников сообщения) не полон. Не хватает блока с id=#s	The block "Party" is incomplete. It has no id=#s	BFMT
NRD049	MA_NOT_REGISTERED_YET	Анкета генерального соглашения еще не зарегистрирована	The Master Agreement form is not registered	NARR
NRD050	CONTRACT_ALREADY_DEREGISTERED	Анкета договора уже deregistered	The contract form has been deregistered	NARR
NRD051	MA_ALREADY_DEREGISTERED	Анкета генерального соглашения уже deregistered	The Master Agreement form has been deregistered	NARR
NRD052	CANCEL_MESSAGE	В сообщении #s получено требование об отмене сообщения	Message #s has got cancel request	NARR
NRD053	MA_DEREGISTRATION_NOT_DEREGISTERED	Невозможно закрыть Генеральное соглашение, в рамках которого остаются открытые договоры	There is an attempt to terminate the Master agreement with open Contracts	NARR
NRD054	INCORRECT_SIDE_ORDER	Порядок сторон, указанный при регистрации анкеты договора, не соответствует порядку, указанному при изменении/deregistered анкеты договора	The order of the parties specified in the registered contract form does not match the order specified in the amendment/deregistration message	NARR
NRD055	MA_STATUS_DEREGISTERED	Генеральное соглашение #s, указанное в анкете договора, отменено	The Master Agreement #s specified in the contract form was cancelled	NARR
NRD056	MA_STATUS_TERMINATED	Расторгнуто репозитарное соглашение по обслуживанию Генерального соглашения #s, указанного в анкете договора	The Repository Services Agreement for the specified Master Agreement #s was terminated	NARR
NRD057	INFORMANT_OF_CM092_IS_NOT_CORRECT	Указанная в сообщении согласующая сторона не является ни стороной, ни БИЛом, ни ИЛом по договорам, указанным в отчете. Сообщение зарегистрировано в журнале входящих с номером №#s	The receiver of a message is neither a party, nor a Principle Reporting Agent/Reporting Agent for defined contracts. The message is registered in the Log with the number N#s	BINF
NRD058	CONTRACT_DOES_NOT_BELONG_TO_MASTER_AGREEMENT	Договор с номером #s не принадлежит Генеральному соглашению с номером #s	The Contract #s is not under the Master Agreement #s	NARR
NRD059	INVALID_BLOCK_HEADER	Заполнение блока «Header» сообщения не соответствует правилам	The block <header> does not comply with the rules of message creation	BFMT

		заполнения Репозитария	сообщений		
NRD060	RIGHT_TYPE_EMPTY	Поле "Тип отчетности информирующего лица" должно быть заполнено	The field "Reporting party role type" should be filled out	NARR	
NRD061	XML_NO_VERSION_FORMAT_DICT	Сообщение не соответствует ни одному формату сообщений Репозитария	The message does not match any repository message format	NARR	
NRD062	REQUEST_AGREEMENT_CANCEL	Запрос на согласование параметров анкеты с №s отменён, поскольку клиент #s отменил/заменял свою анкету	The request for approval of the Reporting form №s is cancelled because the Client #s has cancelled/replaced the Reporting form	NARR	
NRD063	CORRELATION_NOT_MATCH_MASK	Поле <correlationId> не соответствует маске ввода	The field <correlationId> does not comply with the mask	BFMT	
NRD064	RPLC_MSG_TYPES_IS_NOT_COMPATIBLE	Тип заменяемого сообщения #s с номером #s не соответствует типу сообщения замены #s с номером #s	The type #s of the message #s to be replaced does not correspond to the type #s of the replaceable message #s	NARR	
NRD065	CONTRACT_WITH_NUM_ALREADY_DEREGISTERED	Анкета договора #s уже зарегистрирована	The contract form #s has already been deregistered	NARR	
NRD066	RIGHT_TYPE_NOT_EXISTS	Тип договора #s не найден в справочнике типов договоров	The contract type #s is not found in the Product Type reference guide	NARR	
NRD067	BAD_CONSTANT_FOR_REPORTING	Неверная константа #s для идентификации стороны, не предоставляющей отчетность	The identifier of the party which does not report has invalid value #s	NARR	
NRD069	INVALID_TRADEREPOSITORY_PERSON	Сторона, указанная в блоке «Party» с атрибутом id = TradeRepository не является Репозитарием	The party with id = TradeRepository is not the Repository	NARR	
NRD070	TOO_MANY_RIGHT_TYPE_FOR_INFORMATION_SIDE	Для стороны #s указано несколько информирующих лиц с одинаковым типом прав #s	Several Reporting agents are indicated for the party #s with the same role type #s	NARR	
NRD071	XML_WRONG_ADD_INFO	Неверное указание сотрудников, осуществивших ввод и сверку	The specified employee is not authorized to submit and reconcile messages	NARR	
NRD072	MA_SIDES_MUST_DIFFERENT	Стороны по Генеральному соглашению не могут совпадать или должны быть указаны клиенты сторон	The Master Agreement should have two different parties or the clients of the parties should be specified	NARR	

NRD073	SIDE_HAS_NO T_PERMISSIO N	У стороны #s закончились полномочия на предоставление информации по договору #s. Сообщение зарегистрировано в журнале входящих с номером №#s	The party #s has no right to submit information on the Contract #s. The message is registered in the Log with the number N#s	NARR
NRD074	CANC_RPLC_ NOT_SET	Не указано сообщение для отмены/замены	The message for replacement/cancellation is not specified	NARR
NRD075	BAD_DATE_C ANC_RPLC	Дата, указанная для отменяемого сообщения, не совпадает с датой сообщения, найденного для отмены/замены	The date specified for the message to be cancelled does not coincide with the date of the message to cancel / replace	NARR
NRD076	BAD_MSG_AC TION_CANC_R PLC	Назначение, указанное для отменяемого сообщения, не совпадает с назначением сообщения, найденного для отмены/замены	The purpose of the message to be canceled does not coincide with the purpose of a message to cancel/replace	NARR
NRD077	CONTRACT_S TATUS_NOT_F IND	Статус с кодом #s не найден в справочнике состояний анкет договоров	The status #s is not found in the contract's forms status reference guide	NARR
NRD079	MATCH_MET HOD_EMPTY	Поле «Способ сверки информации по договорам» имеет некорректное значение	The field "Contract parameters reconciliation type" has invalid value	NARR
NRD080	INFORMATOR _NOT_FOUND	Не удалось определить информирующее лицо по договору с типом #s для стороны #s	Unable to identify Reporting agent with contract type #s for the party #s	NARR
NRD081	NOT_FOUND_ ACTIVE_CON TRACTS	По заданным параметрам не удалось найти ни одной анкеты активного договора	There is no active contract form with given parameters	NARR
NRD082	TWO_MANY_I LS_WITH_CO NTRACT_TYP E	Для информирующего лица с типом договора #s и стороной #s не допускается наличие других информирующих лиц по данному типу договора	No other Reporting agents are allowed when Reporting agent is appointed for contract type #s and party #s	NARR
NRD083	TRADEREF_L EN_LIMIT	Значение идентификатора Генерального соглашения/договора, присвоенного стороной #s, не может превышать длину 35 символов	The value of the field "Trade identifier" (tradeId) of the Master Agreement/contract assigned by the party #s should not be longer than 35 characters	NARR
NRD084	MEMBER_EQ UAL_REPOSIT ORY	Недопустимо указывать в качестве #s персону: #s #s	It is impossible to indicate as #s: #s #s	NARR

NRD085	XSD_ERROR_VALIDATION_PREV_VERS	Репозиторий перешёл на новую версию форматов. Содержание вашего сообщения не соответствует новой версии. Ошибка валидации входящего сообщения: #s	The repository has moved to the new messages specification format. The submitted message does not correspond to the new format. Validation error of incoming message: #s	NARR
NRD086	INCORRECT_HREF_VALUES	В сообщении неверно заполнены «ссылка на участника, в отношении которого запрашивается отчет» или «ссылка на участника – контрагента»	The incorrect values for the href attributes or the fields «Party1» and «Party2» doesn't filled	NARR
NRD087	INVALID_NOT_REPORTING_CODE	Значение кода #s не соответствует маске ввода	The specified partyID code #s doesn't match with a mask	NARR
NRD088	IN_MSG_SENDER_MUST_BE_REPOSITORY	Отправитель сообщения должен являться Репозитарием	Only the repository can be a sender of the message	NARR
NRD089	MA_FOR_ID_NOT_FOUND	Генеральное соглашение с регистрационным номером #s не существует	Master Agreement with the number #s does not exist	NARR
NRD090	XML_DIFFERENCES	В результате сравнения xml документов были выявлены расхождения	There are differences found when comparing xml documents	NARR
NRD091	MA_SIDES_AND_CLIENTS_MUST_DIFFER	Стороны по Генеральному соглашению и их клиенты не могут совпадать	Master Agreement parties cannot be the same as their clients	NARR
NRD092	MA_TRADE_REF_LEN_LIMIT	Значение идентификатора Генерального соглашения, присвоенного стороной #s, не может превышать длину 35 символов	The identifier of the Master Agreement (tradeId) assigned by the party #s can be no longer than 35 characters	NARR
NRD093	CONT_TRADE_REF_LEN_LIMIT	Значение идентификатора договора, присвоенного стороной #s, не может превышать длину 35 символов	The identifier of the contract (tradeId) assigned by the party #s can be no longer than 35 characters	NARR
NRD094	RECONCILIATION_TYPE_EMPTY	Поле «Условия согласования параметров договора» должно быть заполнено	"Trade reconciliation type" should be filled out	NARR
NRD095	MSG_CANNOT_REPLACE_ITSELF	Сообщение не может отменить/заменить само себя	The message cannot be cancelled/replaced by the same message	NARR
NRD096	CORRELATION_CODE_NOT_EQUAL_SENDER	Код клиента из поля «correlationId» #s не соответствует коду отправителя #s	The code specified in correlationId #s does not match the sender's code #s	NARR

NRD097	REPORTING_T YPE_MUST_B E_ALLD	Поле «Тип отчетности информирующего лица» для стороны #s должно быть #s	The field "Reporting party role type" for the party #s should have the value #s	NARR
NRD098	XML_ANKET_ SIDES_NOT_C OMP_WITH_S ENDER	Ни одна из сторон договора не связана с отправителем сообщения	Neither party is associated with the sender of the message	NARR
NRD099	XML_INFORM ATOR_IS_NOT _FOUND	Не удалось определить информирующее лицо стороны #s по коду #s	The Reporting agent of the party #s cannot be identified by the code #s	NARR
NRD100	AGREEMENT_ DATE_IS_NOT _COMMING	Для участника "#s" еще не наступила дата заключения Репозитарного соглашения. Сообщение зарегистрировано в журнале входящих с номером №#s	The repository service agreement with the participant #s has not been concluded yet. The message is registered in the Log with the number N#s	NARR
NRD101	AGREEMENT_ CANCEL_DAT E_IS_COMMIN G	Для участника "#s" наступила дата завершения репозитарного соглашения. Недопустимо указывать репозитарный код отличный от NONREF.	The repository service agreement with the participant #s has been terminated. It is incorrect to specify the repository's code other than NONREF.	NARR
NRD102	XML_CONTRA CT_NOT_FOU ND	Невозможно определить Генеральное соглашение, соответствующее присланной информации по договору	Unable to find the Master agreement corresponding to the received contract data	NARR
NRD103	BAD_CONTRA CT_LINK	Неверно указана ссылка на сообщение для регистрации Генерального соглашения	Wrong link to the corresponding Master Agreement form	NARR
NRD104	CONTRACT_LI NG_PROCESS_ DENIED	В анкете договора присутствует ссылка на сообщение с анкетой генерального соглашения, в обработке которого отказано	The contract form refers to the Master Agreement form which was rejected	NARR
NRD105	CONTRACT_D EREGISTRED	Договор deregистрирован. Внесение изменений невозможно	The contract is deregistered. The amendment is impossible	NARR
NRD106	DUBPLICATE_ MSG_ID	В Репозитории уже существует входящее сообщение (in_msg_id = #s) с идентификатором отправителя #s присланное от отправителя #s	The message (in_msg_id = #s) with the sender's #s ID received from the sender #s already exists	NARR
NRD107	FIELD_MUST_ NOT_BE_EMP TY	Поле #s должно быть заполнено	The field #s must be filled out	NARR
NRD108	TWO_MANY_I LS_FOR_CONT RACT	Невозможно однозначно определить информирующее лицо для типа договора #s	It is impossible to identify the Reporting Agent of the party #s	NARR

NRD109	NON_REPO_CODE_IS_NOT_EMPTY	Код клиента #s, не предоставляющего отчётность, не должен быть пустым	The code of the client #s which is not obliged to report should be specified	NARR
NRD110	INVALID_NON_REPORTING_VALUE	Некорректное значение поля «Сторона, не обязанная предоставлять информацию в Репозиторий» для клиента #s - #s	Invalid value for the field <Unwillingreportingparty> for the client #s - #s	NARR
NRD111	INVALID_NON_REPORTING_FOR_RESIDENT	Клиент #s - #s не может быть указан в поле «Сторона, не обязанная предоставлять информацию в Репозиторий», т.к. он является резидентом	Invalid value for the field <Unwillingreportingparty> because the client #s - #s is the Russian entity	NARR
NRD112	NON_REPORTING_CLIENT_NOT_EQUAL_IN	Для стороны #s, указанной в поле «Сторона, не обязанная предоставлять информацию в Репозиторий», БИЛ должен совпадать с данной стороной	The party #s which is indicated in the field <Unwillingreportingparty> should have the same Principle Reporting Agent	NARR
NRD113	NON_REPORTING_INF_EQUAL_NONREF	Для стороны #s, указанной в поле «Сторона, не обязанная предоставлять информацию в Репозиторий» код БИЛа должен быть равен NONREF	The Principle Reporting Agent of the party #s which is indicated in the field <Unwillingreportingparty> should be defined as NONREF	NARR
NRD114	INCORRECT_IILL_PARTY_SIDE	Некорректное значение поля «Сторона Генерального соглашения» = #s в блоке информирующих лицах, в случае если сторона #s отказалась предоставлять отчетность	Invalid value for the field <masterAgreementParty> #s if the party #s is not willing to report	NARR
NRD115	INCORRECT_IILL_CODE	Код информирующего лица, поданного от стороны #s должен быть #s	The code of the Reporting Agent of the party #s should be defined as #s	NARR
NRD116	CONTRAGENT_IL_NOT_FOUND	ИЛ #s - #s стороны #s, отказавшейся от предоставления отчетности, должен совпадать с ИЛом противоположной стороны (иметь тот же код и наименование)	The Reporting Agent #s - #s of the party #s which is not willing to report should coincide with the Reporting Agent of its counterparty (should have the same code and name)	NARR
NRD117	XML_NO_VERSION	Сообщение не содержит указания на версию формата	The version of the format is not defined in the message	NARR
NRD118	XML_NO_ACTION	Сообщение не содержит указания на действие	The message does not contain the action	NARR
NRD119	XML_NO_INCOMING	Сообщение такого типа не может быть входящим для Репозитария	Invalid type of incoming message	NARR

NRD120	XML_NARRATIVE_DENIED_FOR_ID	Для идентификатора с типом #s не допускается заполнение поля значением <NONREF>	In case of ID with type #s the field with <NONREF> value should not be filled	NARR
NRD121	XML_NARRATIVE_MANDATORY_FOR_ID	Для идентификатора с типом #s поле <narrative> должно быть заполнено	In case of ID with type #s the field <narrative> should be filled	NARR
NRD122	XML_MEMBER_TO_MANY_REGISTERED	Для участника с кодом #s типа #s существует несколько записей в Репозитории	There are several entries in the repository for the party with code #s and code type #s	NARR
NRD123	XML_MEMBER_NOT_FOUND	По указанным идентификаторам не удалось определить клиента Репозитория	No client found for given parameters	NARR
NRD124	ID_TYPE_NOT_FOUND	Тип кода #s отсутствует в справочнике типов кодов	Code type #s is not found in the reference guide	NARR
NRD125	XML_BAD_LINK_ON_OUT_MESSAGES	В сообщении указана ссылка на несуществующий связанный документ	The message contains a link to the nonexistent related document	NARR
NRD126	XML_NOT_FOUND_LINK_ON_OUT_MESSAGES	В сообщении не указана ссылка на связанный документ	The message should contain a link to the related document	NARR
NRD127	XML_BAD_LINK_DOCUMENT	Указан некорректный связанный документ	Invalid related document	NARR
NRD128	BAD_CONTRACT_NUMBER	В сообщении на регистрацию анкеты генерального соглашения/договора номер Генерального соглашения/договора должен быть указан как NONREF	The Master Agreement/contract ID must be defined as NONREF	NARR
NRD129	ABORTED_MSG_HAS_INVALID_ID_STATE	Отменяемое сообщение уже исполнено/отменено	It is impossible to cancel a message that has been executed/cancelled	NARR
NRD130	SAME_MASTER_ALREADY_REGISTERED	В регистрации анкеты генерального соглашения отказано, т.к. ранее, сообщением № #s, была зарегистрирована анкета генерального соглашения № #s, совпадающая с предоставленной по ключевым полям или клиентским номерам	The message cannot be registered because in previous message № #s the Master Agreement form № #s with the same parameters and client IDs has been registered	NARR
NRD131	SAME_CONTRACT_ALREADY_REGISTERED	В регистрации анкеты договора отказано, т.к. ранее сообщением № #s была зарегистрирована анкета договора № #s совпадающая с	The message cannot be registered because in previous message № #s the Contract № #s with the	NARR

		предоставленной по ключевым полям или клиентским номерам	same parameters and client IDs has been registered	
NRD132	COUNTRY_CODE_MUST_BE_FILLED	Поле "Код страны" должно быть заполнено	The field "Country code" should be filled out	NARR
NRD133	COUNTRY_CODE_INVALID_VALUE	Поле "Код страны" содержит некорректное значение #s	Invalid value of the field "Country code" #s	NARR
NRD134	INVALID_AGENT_FOR_NON_REPORTING_SIDE	При изменении Генерального соглашения: ИЛ не отчитывающейся стороны должен быть либо равен ИЛу отчитывающейся стороны, либо оставаться, как в зарегистрированном Генеральном соглашении, при условии, что данный ИЛ имеет действующее репозитарное соглашение	The Reporting Agent for Unwilling reporting party should be set as Reporting Agent for reporting party, or remain unchanged, if Reporting Agent still a repository's client, while changing Master Agreement	NARR
NRD135	FORBIDDEN_NON_REPORTING_FOR_CLIENT	Указанный для контрагента #s ИЛ #s не может являться стороной, отказавшейся от предоставления сведений в Репозитарий	The counterparty #s with the Reporting Agent #s couldn't be as Unwilling reporting party	NARR
NRD136	INCORRECT_PAYER_SIDE	Сторона #s #s, отказавшейся от предоставления сведений в Репозитарий, не может быть плательщиком, т.к. только сторона предоставляющая отчетность, может оплачивать услуги Репозитария в случае одностороннего репоринга	The Unwilling reporting party #s #s couldn't be specified as a payer. Only the reporting party could be as a payer	NARR
NRD137	ED_CONTRACT_FOR_COUNTERPARTY_NOT_FOUND	У ИЛа согласующей стороны #s нет анкеты ЭДО, сообщение #s, #s	The Principle Reporting Agent/Reporting Agent #s doesn't have EDT profile. The message #s, #s	NARR
NRD138	PERO_CODE_NEEDED_FOR_REPO_CLIENT	#s является клиентом Репозитария. Для идентификации стороны Генерального соглашения /договора требуется указание репозитарного кода #s	#s is a repository's client. To identify the side of the Master Agreement/Contracts required repository's code #s	NARR
NRD139	LEI_CLIENT_WITH_SEVERAL_REPO_CODES	Код LEI #s - #s является клиентом Репозитария и имеет несколько репозитарных кодов. Для идентификации участника также требуется указание репозитарного кода	The client with LEI code #s and short name #s has more than one repository's code. To identify the side required specified the repository's code too	NARR
NRD140	CODE_TYPE_NOT_FOUND_IN_XML_BLOCK	В XML блоке не найден код с типом #s, XML блок: #s	In the XML block cannot find a code with type #s, XML block: #s	NARR

NRD141	TOO_MANY_CODE_TYPE_IN_XML_BLOCK	В XML блоке содержится несколько кодов с типом #s, XML блок: #s	The XML block contains several codes with type #s, XML block: #s	NARR
NRD142	INVALID_CHECK_ADD_CODE	Код #s, указанный в тэге partyId не совпадает с типом кода #s у участника #s #s	The ID #s, specified in partyId tag, doesn't match with type of ID #s for party #s #s	NARR
NRD143	INVALID_ADD_CODE_FOR_MEMBER	Для участника/клиента стороны #s #s указан недопустимый код #s	For the party/party's client #s #s specified an invalid ID #s	NARR
NRD144	INVALID_ADD_CODE_FOR_PARTYID	В XML блоке указан недопустимый для идентификации участника код #s. XML блок #s	In the XML unit specified an invalid ID #s for Party identification. XML unit #s	NARR
NRD145	INVALID_PARTYID_VALUES	В XML блоке указаны некорректные значения элементов partyId. XML блок: #s	The incorrect partyId element's values specified in the XML unit. XML unit: #s	NARR
NRD146	MANDATORY_TYPE_CODE_NOT_SPECIFIED	В XML блоке, в элементе partyId отсутствует обязательный тип кода: #s. XML блок: #s	A required type of ID #s is missing in the element partyId of the XML unit. XML unit: #s	NARR
NRD147	INVALID_COUNTRY_CODE_AND_RESIDENT	Для клиента #s #s, являющегося #s указан некорректный код страны #s	For the Client #s #s, who specified as #s, found an incorrect country code #s	NARR
NRD148	INVALID_COUNTRY_CODE_AND_CLIENT_CODE	Для кода клиента #s указан некорректный код страны #s	For the client ID #s, specified an incorrect country code #s	NARR
NRD149	LEI_CODE_NOT_MATCH_WITH_REPO_CODE	Указанный в анкете код LEI/SNLS #s, не соответствует указанному репозитарному коду #s, для участника #s	The specified LEI code #s don't match with repository's code #s, for party #s	NARR
NRD150	NAME_SPACE_PREFIX_MUST_BE_IN_ROOT_TAG	Некорректный формат. Префикс пространства имен #s не содержится в корневом тэге	The wrong format. Root tag does not contain the prefix #s	NARR
NRD151	INVALID_BLOCK_TRADEHEADER	Заполнение блока TradeHeader сообщения не соответствует правилам заполнения сообщений репозитария	The block <TradeHeader> does not comply with the rules of message creation	NARR
NRD152	DOCUMENT_ALREADY_CONFIRMED	Документ уже подтвержден	The document has already been confirmed	NARR
NRD153	CONTRACT_SIDES_NOT_COMPARE_WITH_MASTER_SIDES	Стороны договора не соответствуют сторонам Генерального соглашения	Parties of the Contract don't correspond to the parties specified in the Master Agreement	NARR

NRD154	MEMBER_NOT_EQUAL_SIDES	Контрагент с кодом #s, указанный в анкете, не соответствует ни одной из сторон из списка указанных в сообщении сделок	The counterparty with code #s does not match any party of the contract	NARR
NRD155	PARTY_NAME_MUST_BE_EMPTY_FOR_NONREF	Поле #s должно быть пустым для кода со значением = NONREF	The #s field should be left blank, for the code value = NONREF	NARR
NRD156	MSG_TYPE_NOT_FOUND	Тип сообщения #s отсутствует в справочнике типов сообщений	The message type #s is missing in reference message types	NARR
NRD157	MSG_TYPE_NOT_DEFINE	Сообщение с корневым тэгом #s не поддерживается системой	A message with the root tag #s not supported	NARR
NRD158	CME_CSV_IS_NOT_SET	К сообщению не приложен файл с отчетом для CME ETR	The report file for CME ETR is not attached	NARR
NRD159	XML_CME_CSV_NOT_FOUND	В сообщении не указано имя файла – отчета для CME ETR	The message does not contain the name of the report file for CME ETR	NARR
NRD160	THE_RULE_SENDING_TO_CME_NOT_SET	В сообщении не установлено правило отправки сообщения в CME ETR	The message does not contain the rule of sending report for CME ETR	NARR
NRD161	LEI_CODE_MUST_NOT_BE_EMPTY	В анкете отсутствует один или оба элемента partyId для участника #s. Указание 2-х элементов partyId (Репозитарный код и код LEI), для участника обязанного предоставлять отчетность в Репозитарий является обязательным	One or both of the partyId elements for Party #s is missing (Repository's code and LEI code), but it should be mandatory specified for Party who are obligated to submit reports	ICAG
NRD162	DOC_TYPE_NOT_DEFINE	Тип документа #s не поддерживается системой	A document type #s not supported	NARR
NRD164	INCORRECT_PARTY_ID	Указанный идентификатор <partyId> для участника #s не соответствует идентификатору, указанному в ранее зарегистрированной Анкете договора/ГС	The identifier <partyId> for Party #s does not match the identifiers specified in the registered Trade/ Master agreement	BFMT
NRD165	INVALID_CONTRACTS	Неверный перечень договоров. Все указанные в Анкете договоры, должны быть зарегистрированы в рамках одного Генерального соглашения	An Incorrect contracts list. All specified contracts must be registered under same master agreement	BFMT
NRD166	INCORRECT_MASTER_FOR_AMENDMENT	Номер Генерального соглашения по договорам указанный в анкете на изменение отличается от номера Генерального соглашения	The Master Agreement number of contracts specified in the amendment form doesn't match with the Master Agreement number	BFMT

		указанного в ранее зарегистрированной анкете	of the previously registered form	
NRD167	INCORRECT_REPORT_PARTY	Сторона, указанная в блоке #s, не соответствует стороне, от имени которой было направлена сообщение	The reporting party specified in the block #s doesn't match with the Party's name from whose side the message was sent	BFMT
NRD168	DUBPLICATE_TRADEID	Указание нескольких договоров с одинаковым номером, недопустимо	It is unacceptable to specify the multiple contracts with the same number	BFMT
NRD169	INCERRECR_ASOFDATE_FOR_CM092_CM094	Указано некорректное значение для поля <asOfDate>/<valuationDate>. Регистрация/внесение изменений в анкету отчета CM092/CM094 допускается только в одном отчетном периоде	Specified an incorrect value for the field <asOfDate>/<valuationDate>. Registrations/Amendments for the form of report CM092/CM094 is only allowed in one reporting period	BFMT
NRD170	REACH_LIMIT_MSG	Размер сообщения превышает максимально допустимый размер (15 мегабайт). Пожалуйста, удалите из XML сообщения лишние символы между полями (пробелы, переводы строк, и т.п.) или разделите сообщение на несколько	A Message size reached the maximum allowed limit (15 mb). Please remove excess characters between fields (spaces, line breaks, etc.) from the XML file, or separate the message on several parts	BFMT
NRD171	INCORRECT_NONREF_FOR_TRADEID	Клиентский идентификатор сообщения/сделки отсутствует, или имеет значение NONREF	The client's identifier for the message/trades is missing or has an invalid value (NONREF)	BFMT
NRD172	DUBPLICATE_ROWS_FOR_CM082	В пакет сделок сообщения присутствуют один или несколько одинаковых идентификаторов сделок. Список сделок: #s	There are one or several duplicates of trade identifiers. List of duplicates: #s	BFMT
NRD173	INVALID_SENDER_CM082	Отправитель #s не имеет полномочий для подачи сообщений по форме #s	Sender #s has no right to submit messages with #s form	BFMT
NRD174	REPORT_MSG_DATA_NOT_FOUND	По параметрам, указанным в запросе, не найдено данных в журнале учета входящих сообщений Репозитория	Messages with specified parameters are not found in the Messages register	NARR
NRD175	INVALID_PERIOD	В запросе на выписку указан недопустимый период	An Invalid period for the statement request	BFMT
NRD176	SAME_REPORT_ALREADY_REGISTER	В регистрации анкеты отчета отказано, т.к. ранее сообщением № #s была зарегистрирована анкета отчета № #s совпадающая с	The message cannot be registered because in previous message № #s the form of report № #s with the same valuation dates	NARR

		предоставленной по дате событий и клиентским номерам	and client IDs has been registered	
NRD177	INCORRECT_VALUATIONDATE_FOR_CM092_CM094	Недопускается указание несколько одинаковых значений для полей <valuationDate> в одной анкете отчета CM092/CM094	Do not allow to specify multiple same values for the field <valuation Date> in the one form of report CM092 / CM094	BFMT
NRD178	INCORRECT_ADD_CODE_FOR_PARTYID	Дополнительный идентификатор участника #s, указанный в ранее зарегистрированной анкете, не соответствует идентификатору в базе репозитория #s, для участника с репозитарным кодом #s	Additional Identifier #s, specified in the previously registered form does not match with the ID in the database #s, for the member with repository's identifier #s	BFMT
NRD179	UTI_INCORRECT_VALUE	Указано некорректное значение кода UTI (#s) Возможные причины: превышен лимит символов (52), в репозитории уже имеется сообщение с таким кодом, по коду не найдена связанная анкета	Specified an incorrect UTI code (#s) Possible causes: exceeded the limit of 52 characters, in the Repository already exists a message with the code, not found a related document by the code	NARR
NRD180	RA_DUPLICATE	Указанные в анкете информирующие лица не могут повторяться	The specified Reporting Agents may not be duplicated	NARR
NRD181	FORM_CM016_DUPLICATE	Заявление о назначении информирующих лиц от участника #s уже зарегистрировано в Репозитории. Для внесения изменений по информирующим лицам необходимо подать изменение к имеющейся анкете	A form of Reporting Agents assignment for the Client #s already registered in the Repository. To make changes, please submit an amendment to an existing form	
NRD182	TRANSF_AND_EXECUTOR	Указано некорректное значение поля <TransfersAndExecution>, при определении функций ИЛ для участника - #s. Значение «true» может быть установлено, только если в полномочия ИЛ так же входит отчетность по типам документов CM010 или CM015	Specified an incorrect value of the field <Transfers And Execution>, during determination the functions of Reporting Agent - #s. The value «true» may be specified only if the reporting authority also cover document types like CM010 or CM015	NARR
NRD184	MARK_TO_MARKET_ERROR	Указано некорректное значение поля <MarkToMarketValuation>, при определении функций ИЛ для участника - #s. Значение «true» может быть установлено, только если в полномочия ИЛ не входит отчетность по типам документов CM010 или CM015	Specified an incorrect value of the field <MarkToMarketValuation>, during determination the functions of Reporting Agent - #s. The value «true» may be specified only if the reporting authority exclude	NARR

			document types like CM010 or CM015	
NRD185	XML_CSA_NOT_FOUND	По указанному идентификатору #s не удалось найти зарегистрированной в репозитории анкеты договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств	Registered CSA not found with specified repository's identifier	NARR
NRD186	INCORRECT_CSA_PARTY_TRADEID	Указанный в анкете договора клиентский идентификатор договора заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств #s, не соответствует идентификатору в зарегистрированной анкете договора заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств	The specified client's identifier in the contract form for the report #s does not match with the identifier in the registered CSA	NARR
NRD187	INVALID_AUTOEXECUTION	Для возможности автоматического закрытия договора необходимо указать значения для полей <startAgreementDate> и <endAgreementDate>	To enable the automatic execution report option of the contract, must specify values for the fields <startAgreementDate> and <endAgreementDate>	NARR
NRD188	SINGLE_CONTRACT_TAG_INCORRECT	Одновременное указание признака <nonStandardTerms> и ссылки на Генеральное соглашение не допускается	Simultaneous specify <nonStandardTerms> field and link for Master Agreement is not allowed	NARR
NRD189	UTI_MANDATORY	Указание кода UTI является обязательным для данного типа продукта	Specifying UTI code is required for this type of product	NARR
NRD190	AUTHORITY_DUPLICATES	Некорректно указаны полномочия для одного или нескольких информирующих лиц: #s	Specified an incorrect authority for one or several Reporting Agents: #s	NARR
NRD191	INCORRECT_INFORMER	Участник #s не является информирующим лицом для стороны #s	The member #s is not Reporting Agent for the Party #s	NARR
NRD192	INITIAL_MESSAGE_NOT_FOUND	По входящему сообщению с номером #s и типом #s не удалось найти данных об информирующем лице	Could not find any information about Reporting Agent, by an incoming message with the number #s and type #s	NARR
NRD193	REQUEST_ALREADY_REGISTERED	Подтверждение/отказ по запросу на согласование полномочий информирующего лица с кодом #s для клиента с кодом #s уже зарегистрировано	Confirmation / rejection of a request for approval of authority Reporting Agent with code #s for the client with code #s has already been registered	NARR

NRD194	INCORRECT_UTI_PARTY	Недопустимое значение LEI кода для стороны формирующей код UTI	Invalid LEI for UTI generating party	NARR
NRD195	NOT_REPORTING_PARTY_ERROR	Указанные в анкете стороны, обе отказались представлять отчетность в Репозиторий. Информация не может быть зарегистрирована	Specified in the form Parties, both not willing to report in the Repository. Information can not be registered	NARR
NRD196	INCORRECT_PERMISSION_FOR_SENDER	Отправитель не является уполномоченным информирующим лицом по договору #s	The sender is not authorized a Reporting agent for the contract #s	NARR
NRD197	CONFIRMATION_INFORMATION_NOT_FOUND	По договору #s, не удалось определить согласующее информирующее лицо	Could not find authorized confirmation Reporting agent for the contract #s	NARR
NRD198	CONFIRMATION_INFORMATION_MORE_THAN_ONE	Не удалось однозначно определить согласующее информирующее лицо	Could not uniquely identify authorized confirmation Reporting agent	NARR
NRD199	FLC_WRONG_RELATIONS_VALUES_2	ФЛК. Неверная хронологическая последовательность дат. Корректные значения должны соответствовать правилу: #s <= #s	FLC. Invalid chronological dates sequence. Valid values must conform to the rule: #s <= #s	BFMT
NRD200	FLC_WRONG_RELATIONS_VALUES_3	ФЛК. Неверная хронологическая последовательность дат. Корректные значения должны соответствовать правилу: #s <= #s <= #s	FLC. Invalid chronological dates sequence. Valid values must conform to the rule: #s <= #s <= #s	BFMT
NRD201	FLC_WRONG_RELATIONS_VALUES_4	ФЛК. Неверная хронологическая последовательность дат. Корректные значения должны соответствовать правилу: #s <= #s <= #s <= #s	FLC. Invalid chronological dates sequence. Valid values must conform to the rule: #s <= #s <= #s <= #s	BFMT
NRD202	FLC_WRONG_CURRENCY	ФЛК. Некорректный тип валюты, либо последовательность её указания для первой или второй части сделки	FLC. Incorrect currency types or their specific sequence for the first or second part of the deal	BFMT
NRD203	FLC_POSITIVE_VALUE	ФЛК. Значение поля #s должно быть положительным	FLC. The value for the field #s should be positive	BFMT
NRD204	INVALID_PARTYNAME	ФЛК. Не допускается указание NONREF для поля <partyName>	FLC. It is not allowed to specify NONREF for the <partyName>	BFMT

NRD205	FLC_ALREADY_CONNECTED	Для участника – #s - #s, сервис ФЛК уже подключен	The FLC service already has been connected for the party - #s - #s	BFMT
NRD206	FLC_ALREADY_DISCONNECTED	Для участника – #s - #s, отсутствует подключенный сервис ФЛК	There's not connected FLC service for the party – #s - #s,	BFMT
NRD207	FLC_RATE_DELTA	ФЛК. Указанная ставка #s, не соответствует ставке, рассчитанной по суммам валют платежей	FLC. The specified rate #s does not match with the calculated rate by payment currency amounts	BFMT
NRD208	FLC_INVALID_PRODUCT_TYPE	ФЛК. Указан недопустимый тип продукта #s для данного типа сообщения	FLC. Specified an invalid product type #s for that message type	BFMT
NRD209	FLC_INCORRECT_BUYERSELLER_	ФЛК. Ошибка в указании покупателя/продавца либо плательщика/получателя платежа	FLC. There is an error in the specification of buyer/seller, or payer/reciever	BFMT
NRD210	FLC_INVALID_ELEMENT	ФЛК. Указанный элемент: #s не используется в формате сообщений Репозитория	FLC. The specified element: #s is not used in the Repository's message format	BFMT
NRD211	UTI_INVALID_SYMBOLS	При указании кода UTI -#s, были использованы недопустимые символы	An invalid symbols was specified in UTI code – #s	BFMT
NRD212	CORRECTION_NOT_CLOSED_FORM	Указанный в анкете тип изменения «коррекция» возможен только для закрытых анкет	Specified «correction» type is possible only for closed report forms	BFMT
NRD213	AMENDMENT_NOT_OPEN_FORM	Указанный в анкете тип изменения «редактирование» возможен только для открытых анкет	Specified «amendment» type is possible only for open report forms	BFMT
NRD214	INVALID_DATE_FOR_CORR	Превышен допустимый период (#s дня с даты закрытия), для внесения корректировок по закрытым анкетам	Exceeded the permissible period (#s days from deregistration date), for making corrections to deregistered forms	BFMT
NRD215	INVALID_CORRECTION	В анкете Bulk-форматов были изменены общие для всех сделок поля:#s. При внесении таких изменений, перечень сделок должен соответствовать тому, что был зарегистрирован ранее	The bulk-report form contain changes in main fields: #s. it is only possible if the list of deals is the same like in previously registered form	BFMT
NRD216	CONT_ADDCODE_LENGTH_LIMIT	Значение дополнительного кода стороны #s, не может превышать длину #s символов	The value of additional code specified for the party #s can be no longer than #s characters	NARR

NRD217	BULK_TRADE_NOT_FOUND	Сделка с UTI кодом #s не найдена в изменяемом сообщении. При изменении Bulk-формата перечень сделок должен соответствовать тому, что был зарегистрирован ранее	The deal with UTI = #s has not been found in the original bulk-report. It's only possible to correct bulk-report if the list of deals is the same as in the previously registered form	BFMT
NRD218	INVALID_DATE_FOR_STATUSES	Превышен допустимый период (#s дня с даты закрытия), для изменения статуса по закрытым анкетам	Exceeded the permissible period (#s days from deregistration date), for status change in deregistered forms	BFMT
NRD219	BAD_STATUS_CHANGE	Указан некорректный статус #s для данного сообщения. Изменение на указанный статус невозможно	The status #s is incorrect for the current message. It is impossible to set the status	BFMT
NRD220	STATMNT_REQUEST_BAD_PARAMETERS	Для выписки указан некорректный набор параметров в statementDetails	The parameters in StatementDetails section are not correct for the statement request	BFMT
NRD221	AUTO_EXECUTION_REJECT	Не допускается указание элемента для автоматической регистрации договора (automaticExecution = Y) при двухстороннем согласовании сообщения	Not permitted to indicate the element for the automatic deregistration of the contract (automaticExecution = Y) in case of two-side matching process	BFMT
NRD222	CORR_NOT_ALLOWED	Внесение корректирующей записи для анкеты CM092/CM094 не предусмотрено	Specified «correction» type is not allowed for CM092/CM094	BFMT
NRD223	INVALID_TAG_FOR_AMENDMENT	В сообщении на изменение анкеты запрещено указывать атрибут xsi:type="TradeAmendmentContent" в тэге amendment	Not permitted to use xsi:type="TradeAmendmentContent" element in the amendment tag	BFMT
NRD224	STATMNT_REQUEST_INVALID_TYPE	Для выписки указан некорректный statement type	The statement type is invalid for the statement request	BFMT
NRD225	CONTRACT_IN_SUO_RJCT	Договор находится на учете в СУО. Изменение возможно только через web-кабинет СУО	The contract is registered in SUO It's only possible to update it through SUO web-cabinet	NARR
NRD226	FLC_WRONG_ENDDATE_VALUES_2	ФЛК. Неверная хронологическая последовательность дат. Корректные значения должны соответствовать правилу: #s <= #s при заполненном automaticExecution = Y	FLC. Invalid chronological dates sequence. Valid values must conform to the rule: #s <= #s when automaticExecution = Y	BFMT

NRD227	FLC_WRONG_PRODUCT_TYPE	ФЛК. Договор не может быть классифицирован как #s	FLC. It's not correct to classify this type of contract as #s	BFMT
NRD228	FLC_WRONG_PFI	ФЛК. Неверно заполнен Код классификации ПФИ	FLC. PFI classification code is incorrect	BFMT
NRD229	FLC_WRONG_PFI	ФЛК. Значение премии опциона не может превышать номинальную сумму договора	FLC. Option's premium value exceeds the trade amount	BFMT
NRD230	FLC_WRONG_EQUITIES_QUANTITY	ФЛК. Неверно указано количество акций #s	FLC. The quantity of equities is incorrect	BFMT
NRD231	FLC_WRONG_NOMINAL_QUANTITY	ФЛК. Указанная номинальная сумма не соответствует рассчитанному значению #s	FLC. Nominal quantity does not match with the calculated value #s	BFMT
NRD232	FLC_WRONG_VALUE_CB	ФЛК. "Значение не соответствует условию #s	FLC. The equation is incorrect #s	BFMT
NRD233	FLC_ZERO_VALUE	ФЛК. В поле #s ожидается положительное значение, отличное от 0	FLC. A value higher than 0 is expected in #s field	BFMT
NRD234	FLC_WRONG_PERCENTAGE_RATE	ФЛК. Указано некорректное значение в поле #s : требуется указать значение в виде десятичной дроби, например 10% = 0.1, или значение превышает - 3 (300%)	FLC. Not correct value in #s field: a decimal rate not higher than 3 (300%) is expected, e.g. 0,1 for 10%	BFMT
NRD235	FLC_WRONG_DECIMAL_RATE	ФЛК. Указано некорректное значение в поле #s : требуется указать значение в процентном выражении, например, 100% = 100	FLC. The value is not correct in #s field: a percentage is expected, for example 100% =100	BFMT
NRD236	MSG_VS_CONTRACT_DIFF	В сообщении не совпадают параметры #s с параметрами в зарегистрированной анкете ГС	The elements #s do not correspond with the same element in the registered Master Agreement	BFMT

NRD237	BULK_UNIQUE_ELEMENTS_CHK	В сообщениях CM083-CM085 для договоров в рамках Генеральных соглашений значение для #s заполняется один раз	In the messages CM083-CM085 the element #s for the contracts under MA should be populated only once	BFMT
NRD238	CONTRACTS_UNIQUE_ELEMENTS_CHK	В сообщении заполнение элемента #s допускается один раз	The element #s should be populated in the message only once	BFMT
NRD239	AFFILIATED_PARTIES_TAG_INCORRECT	В сообщении с признаком nonStandartTerm = false или null не должен быть заполнен элемент partiesAreAffiliated	The element partiesAreAffiliated should not be populated in a message with nonStandartTerm flag = false or empty	BFMT
NRD240	CONTRACT_MA_REFERENCE_INCORRECT	Анкета генсоглашения с указанным референсом в #s не найдена в реестре	MA with the indicated reference in #s was not found in the register	BFMT
NRD278	INVALID_CENTRAL_COUNTERPARTY	Одна из сторон должна быть Центральным контрагентом со значением поля <Classification> равным CCP	One of the parties should be the Central Counterparty with <Classification> field value equal to CCP	NARR
NRD279	SENDER_IS_NOT_CENTRAL_COUNTERPARTY	Только Центральный контрагент может отчитывать данное сообщение	Only the Central Counterparty has the right to submit this message	NARR
NRD280	INVALID_CORRECTION_FROM_PARTY	Коррекция от стороны может менять только признак хеджирования этой стороны	A correction from a party can only change a hedge attribute of that party	NARR

**Перечень информации (блоков информации),
однозначно определяющий уникальность анкеты**

СМ010. Анкета генерального соглашения

1. Дата заключения генерального соглашения
2. Дата совершения отчитываемого события
3. Тип Генерального соглашения
4. Версия Генерального соглашения
5. Стороны Генерального соглашения (коды сторон)

СМ021. Анкета договора валютного свопа

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета конверсионной сделки (валютного форварда)

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета договора валютного опциона

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета договора валютного бинарного опциона

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета соглашения о будущей процентной ставке

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета договора процентного свопа

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета договора свопциона

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета договора репо

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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 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. Анкета договора купли-продажи облигации

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета форварда на облигацию или индекс

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета опциона на облигацию

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета опциона на индекс и корзину облигаций

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.

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. Анкета договора купли-продажи акции

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета форварда на акцию

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета опциона на акцию

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета товарного форварда

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета товарного опциона

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета товарного свопа

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета товарного свопциона

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета свопа дохода на облигации

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета свопа дохода на акции

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета кредитного дефолтного свопа

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.

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. Анкета кредитного свопциона

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Анкета иной сделки

1. Номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с Генеральным соглашением или указания признака отсутствия Генерального соглашения в анкете договора.
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. Отчет об уплате маржевых сумм

1. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора)
2. Дата совершения отчитываемого события
3. Идентификационный номер Генерального соглашения при его наличии
4. Дата расчета маржевой суммы

СМ094. 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)
4. Дата оценки
5. Тип оценки стоимости

СМ093. Анкета о состоянии обязательств по договорам

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