

Аналитическая записка по сопоставлению действующих и создаваемых форматов

Общие сведения о новых форматах

В таблице ниже приведены наименования использованных в качестве исходных схем, в которых описаны наборы специфичных сообщений.

Наименование схемы	Описание процессов
fpml-recordkeeping-processes.xsd	Набор сообщений для процесса предоставления отчётности в репозиторий.
fpml-confirmation-processes.xsd	Набор сообщений для процесса подтверждения параметров сделки.

Recordkeeping

Из [fpml-recordkeeping-process.xsd](#) в новом формате заимствуются следующие сообщения.

Сообщение	Описание
nonpublicExecutionReport	Сообщение используется для первичной отправки анкет на регистрацию, а также для отправки запросов на внесение изменений в отправленные ранее анкеты.
nonpublicExecutionReportAcknowledgement	Сообщение используется для оповещения участников репозитарием об успешной регистрации данных.
nonpublicExecutionReportRetracted	Сообщение используется для отзыва ранее отправленных, но ещё не зарегистрированных анкет.
nonpublicExecutionReportException	Сообщение используется для отправки репозитарием участникам информации о неудачной валидации анкет или неудачном мэтчинге, в том числе сообщение содержит детальную информацию о том, где именно в сообщении найдены несогласующиеся данные.

Confirmation

Из [fpml-confirmation-process.xsd](#) заимствуются следующие сообщения.

Сообщение	Описание
requestConfirmation	Это сообщение направляется репозитарием участнику с целью запросить подтверждение содержащейся в сообщении информации.
confirmationDisputed	Участник направляет репозитарию данное сообщение в случае, если он не согласен с информацией, присланной ему на подтверждение.
confirmationAgreed	Участник направляет репозитарию данное сообщение в случае, если он согласен с информацией, присланной ему на подтверждение.
eventStatusResponse	Сообщение используется репозитарием для оповещения участников о состоянии их анкет (например, сообщение участнику о том, что его анкета отправлена на согласование контрагенту).

Сопоставление старых и новых сообщений

Каждое сообщение содержит набор сущностной информации, которую непосредственно нужно обработать, а также набор признаков, из которых делается вывод о том, что именно нужно сделать с сущностной информацией.

Признаки, определяющие назначение сообщения

Три критерия, по которым обработчик понимает назначение сообщения.

Корневой тэг

Первое, из чего можно судить о назначении сообщения является его корневой тэг. Далее будем называть его **именем сообщения**. Так, например, корневой тэг `<nonpublicExecutionReport>` говорит о том, что в сообщении содержится информация одного из перечисленных ниже назначений:

- анкета договора или генерального соглашения на первичную регистрацию;
- информация о части договора или генерального соглашения для внесения изменений в ранее зарегистрированную информацию.

Тэг `<nonpublicExecutionReportException>` говорит о том, что в сообщении содержится информация об ошибке при первичной (до квитовки и мэтчинга) обработке анкеты либо в процессе мэтчинга.

Много сообщений имеют корневые тэги `<requestConfirmation>` и `<confirmationAgreed>`; это сообщения запроса подтверждения какой-либо информации и положительного ответа (согласия с предоставленной информацией).

Признак isCorrection

Если значение этого поля равно `False`, то сущностная информация сообщения направляется для первичной регистрации. Если же значение равно `True`, то сущностная информация сообщения направляется для внесения изменений в отправленные ранее данные.

Events.model

Набор узлов (элементов, тэгов), описывающих экономические условия сделки и post-trade события. Например, внутри тэга `<trade>` описывается конкретная сделка. Внутри тэга `<optionExpiry>` описывается экспирация опциона.

Отдельным пунктом в `<Events.model>` стоит элемент `<additionalEvent>`. Он является наследником абстрактного типа `<AdditionalEvent>`, что позволяет определять собственные типы бизнес-событий, унаследованные от `<AdditionalEvent>`.

Trade

Тип `<Trade>` используется для передачи информации об отдельной сделке. Одним из его узлов является элемент `<product>`, абстрактного типа `Product`. От этого типа унаследованы все типы, описывающие конкретные финансовые инструменты, например `<FxSwap>` или `<BondOption>`. Таким образом, внутри `<Trade>` на месте элемента `<product>` может быть один из предусмотренных тэгов:

```
<trade>
  <tradeHeader>
    ...
  </tradeHeader>
  <fxSwap>
    ...
  </fxSwap>
</trade>
<trade>
```

```

<tradeHeader>
...
</tradeHeader>
<bondOption>
...
</bondOption>
</trade>
<trade>
  <tradeHeader>
    ...
  </tradeHeader>
  <swaption>
    ...
  </swaption>
</trade>

```

Предварительный мэппинг старых и новых сообщений

Код форм ы	Корневой тэг старого формата	Action	Корневой тэг нового формата	Events.mode l	Product	isCorrecti on
RF00 2	MA_REG_REQUEST	REGI	nonpublicExecutionReport	trade	MasterAgreement Ext	false
RF00 2	MA_REG_REQUEST	DERI	nonpublicExecutionReport	termination	MasterAgreement Ext	false
RF00 2	MA_REG_REQUEST	RERE	nonpublicExecutionReport	amendment	MasterAgreement Ext	false
RF00 21	MA_REG_REQUEST	RPLC	nonpublicExecutionReport	trade, amendment, termination	MasterAgreement Ext	true
RF00 21	MA_REG_REQUEST	CANC	nonpublicExecutionReportRetracte d	trade, amendment, termination	MasterAgreement Ext	-
RF00 2	MA_REG_REQUEST	TCRS	nonpublicExecutionReport	termination	MasterAgreement Ext В случае разрыва договора с репозитарием в MasterAgreementE xt появляется дополнительный аттрибут breakMasterAgree ment="true"	-
RS00 7	MA_REG_REQUEST	NEWM	requestConfirmation	trade, amendment, termination	MasterAgreement Ext	-
RF00 21	MA_REG_REQUEST	CONF	confirmationAgreed	trade, amendment, termination	MasterAgreement Ext	-
RF00 3	REPO_REG_REQUEST	REGI	nonpublicExecutionReport	trade	REPO	false
RF00 3	REPO_REG_REQUEST	CANC	nonpublicExecutionReportRetracte d	trade	REPO	-
RF00 3	REPO_REG_REQUEST	RPLC	nonpublicExecutionReport	trade	REPO	true
RS00 7	REPO_REG_REQUEST	NEWM	requestConfirmation	trade	REPO	-
RF00 31	REPO_REG_REQUEST	CONF	confirmationAgreed	trade	REPO	-

Код форм ы	Корневой тэг старого формата	Action	Корневой тэг нового формата	Events.mode l	Product	isCorrecti on
RF008	REPO_MOD_REQUEST	DERI	nonpublicExecutionReport	termination	REPO	false
RF008	REPO_MOD_REQUEST	CANC	nonpublicExecutionReportRetracted	termination	REPO	-
RF008	REPO_MOD_REQUEST	RPLC	nonpublicExecutionReport	termination	REPO	true
RF008	REPO_MOD_REQUEST	RERE	nonpublicExecutionReport	amendment	REPO	false
RF008	REPO_MOD_REQUEST	CANC	nonpublicExecutionReportRetracted	amendment	REPO	-
RF008	REPO_MOD_REQUEST	RPLC	nonpublicExecutionReport	amendment	REPO	true
RS007	REPO_MOD_REQUEST	NEWM	requestConfirmation	amendment, termination	REPO	-
RF0081	REPO_MOD_REQUEST	CONF	confirmationAgreed	amendment, termination	REPO	-
RF004	SWAPCURRENCY_REG_REQUEST	REGI	nonpublicExecutionReport	trade	FxSwap	false
RF004	SWAPCURRENCY_REG_REQUEST	CANC	nonpublicExecutionReportRetracted	trade	FxSwap	-
RF004	SWAPCURRENCY_REG_REQUEST	RPLC	nonpublicExecutionReport	trade	FxSwap	true
RS007	SWAPCURRENCY_REG_REQUEST	NEWM	requestConfirmation	trade	FxSwap	-
RF0041	SWAPCURRENCY_REG_REQUEST	CONF	confirmationAgreed	trade	FxSwap	-
RF009	SWAPCURRENCY_MOD_REQUEST	DERI	nonpublicExecutionReport	termination	FxSwap	false
RF009	SWAPCURRENCY_MOD_REQUEST	CANC	nonpublicExecutionReportRetracted	termination	FxSwap	-
RF009	SWAPCURRENCY_MOD_REQUEST	RPLC	nonpublicExecutionReport	termination	FxSwap	true
RF009	SWAPCURRENCY_MOD_REQUEST	RERE	nonpublicExecutionReport	amendment	FxSwap	false
RF009	SWAPCURRENCY_MOD_REQUEST	CANC	nonpublicExecutionReportRetracted	amendment	FxSwap	-
RF009	SWAPCURRENCY_MOD_REQUEST	RPLC	nonpublicExecutionReport	amendment	FxSwap	true
RS007	SWAPCURRENCY_MOD_REQUEST	NEWM	requestConfirmation	amendment, termination	FxSwap	-
RF0091	SWAPCURRENCY_MOD_REQUEST	CONF	confirmationAgreed	amendment, termination	FxSwap	-
RF006	CLT_MA_TRADE_STATUS_ADVICE	NEWM	confirmationDisputed	trade, amendment, termination	MasterAgreement Ext, FxSwap, REPO	-
RS011	TRADE_DIFFERENCE_REPO_RT	NEWM	nonpublicExecutionReportException	trade, amendment, termination	MasterAgreement Ext, FxSwap, REPO	-
RS003	STATUS_ADVICE	NEWM	nonpublicExecutionReportAcknowledgement	trade, amendment, termination	MasterAgreement Ext, FxSwap, REPO	-
RS004	STATUS_ADVICE	NEWM	nonpublicExecutionReportException	trade, amendment, termination	MasterAgreement Ext, FxSwap, REPO	-
RS005	STATUS_ADVICE	NEWM	eventStatusResponse	trade, amendment, termination	MasterAgreement Ext, FxSwap, REPO	-
RF010	CLEAR_OFF_MARKET	REGI	executionAdvice	additional	-	false
RF010	CLEAR_OFF_MARKET	CANC	executionAdviceRetracted	additional	-	-

Код форм ы	Корневой тэг старого формата	Action	Корневой тэг нового формата	Events.mode l	Product	isCorrecti on
RF01 0	CLEAR_OFF_MARKET	RPLC	executionAdvice	additional	-	true
RF01 0	CLEAR_OFF_MARKET	DERI	executionAdvice	additional	-	false
RF01 0	CLEAR_OFF_MARKET	CANC	executionAdviceRetracted	additional	-	-
RF01 0	CLEAR_OFF_MARKET	RPLC	executionAdvice	additional	-	true
RF01 0	CLEAR_OFF_MARKET	RERE	executionAdvice	additional	-	-
RF01 0	CLEAR_OFF_MARKET	CANC	executionAdviceRetracted	additional	-	-
RF01 0	CLEAR_OFF_MARKET	RPLC	executionAdvice	additional	-	true
RS00 7	CLEAR_OFF_MARKET	NEWM	requestConfirmation	additional	-	-
RF01 01	CLEAR_OFF_MARKET	CONF	confirmationAgreed	additional	-	-
RF00 7	MA_TRADE_STATEMENT_R EQUEST	NEWM	additional	-		-
RS00 6	MA_TRADE_STATEMENT	NEWM	partyReport	-		-
RS00 8	STATEMENT_OF_REJECTED	NEWM	nonpublicExecutionReportExcepti on	trade, amendment, termination	MasterAgreement Ext, FxSwap, REPO	-
RS01 2	PENDING_FORMS_REPORT	NEWM	eventStatusResponse	trade, amendment, termination	MasterAgreement Ext, FxSwap, REPO	-

Примеры существующих сообщений репозитария в старом и новом форматах.

Анкета генерального соглашения (печатная форма)	
Анкета генерального соглашения (xml old).....	
Анкета генерального соглашения (xml new)	
Анкета договора валютного свопа (печатная форма).....	
Анкета договора валютного свопа (xml old).....	
Анкета договора валютного свопа (xml new)	
Извещение о регистрации (печатная форма)	
Извещение о регистрации (xml old).....	
Извещение о регистрации (xml new)	
Извещение об отказе в регистрации (печатная форма)	
Извещение об отказе в регистрации (xml old)	
Извещение об отказе в регистрации (xml new)	

Анкета генерального соглашения (печатная форма)

Форма RF002 / Form RF002

АНКЕТА ГЕНЕРАЛЬНОГО СОГЛАШЕНИЯ / MASTER AGREEMENT REPORTING FORM

Параметры документа / Requisite details of the document

Отправитель / Sender:

R P 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 1
Репозитарный код / Repository code

Клиент репозитария 1

Краткое наименование / Shortened name

Получатель / Receiver:

N D C 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
Репозитарный код / Repository code

НКО ЗАО НРД

Краткое наименование / Shortened name

Исходящий номер Анкеты / Outgoing reference number of the form: MA0001-07-31

Дата подачи Анкеты / Form submission date: 06.12.2012

Связанный документ / Related document: № _____ Дата / Date: _____

Назначение / Purpose* Для внесения сведений в реестр договоров

Содержание Генерального соглашения / Contents of the master agreement

Репозитарный код соглашения / Agreement's repository code

Дата заключения Генерального соглашения / Master agreement conclusion date: 06.12.2012

Дата начала срока / Effective date: _____

Дата завершения Генерального соглашения / Master agreement termination date: _____

Дата актуальности сведений, предоставленных в Анкете / The date of the last update of the data contained in the form: _____

Способ согласования договоров / Contracts affirmation method¹:

Встречное / Counter-Affirmation



Комбинированное / Combined



Оплата услуг репозитария по генеральному соглашению / Payment for repository services under the master agreement

Сторона 1 / Party 1



Сторона 2 / Party 2



Обе стороны / Both Parties



Стороны Генерального соглашения / Parties to the master agreement

Первая сторона Генерального соглашения / Party 1 to the master agreement

R P 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 1
Репозитарный код / Repository code

Клиент репозитария 1

Краткое наименование / Shortened name

*

{ в зависимости от Назначения Анкеты / Depending on the purpose of the form }.

Базовое информирующее лицо первой стороны / Principal reporting agent of Party 1

¹ В случае назначения сторонами генерального соглашения одного информирующего лица по договорам, заключенным на условиях Генерального соглашения, в поле «способ согласования» необходимо указать «комбинированный». / If the parties to the master agreement appoint one reporting agent in respect of the contracts concluded on the terms and conditions of the master agreement, the "combined" option should be checked in the "contracts agreement method" field.

R P 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 1

Репозитарный код / Repository code

Клиент репозитария 1

Краткое наименование / Shortened name

Регистрационный номер соглашения, присвоенный первой стороной / The repository number assigned to the agreement by Party 1:

Клиент стороны 1 / Client of Party 1

Вторая сторона Генерального соглашения / Party 2 to the master agreement

R P 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 2

Репозитарный код / Repository code

Клиент репозитария 2

Краткое наименование / Shortened name

*

{ в зависимости от Назначения Анкеты / depending on the purpose of the form}.

Базовое информирующее лицо второй стороны / Principal reporting agent of Party 2

R P 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 2

Репозитарный код / Repository code

Клиент репозитария 2

Краткое наименование / Shortened name

Регистрационный номер соглашения, присвоенный второй стороной / Registration number assigned to the agreement by Party 2

Клиент стороны 2 / Client of Party 2

Форма Генерального соглашения / Master agreement form

Форма Генерального соглашения / Master agreement form: RISDA

Информирующие лица по договору / Reporting agents under the contract

Сторона соглашения / Party to the agreement	Информирующее лицо / Reporting agent		Тип сделки / Transaction type
	Код / Code	Краткое наименование / Shortened name	
Обе стороны	RP0000000001	Клиент репозитария 1	Все договора

Дополнительная информация / Additional information

Сканированные копии / Scanned copies:

(должность / title)

(Ф.И.О. / full name)

(подпись / signature)

М.П. / L.S.

Заполняется сотрудником Репозитария / To be filled out by the Repository's employee

Рег. номер документа / Document registration number

Дата приема документа / Document receipt date

Время приема документа / Document receipt time

Операционист / Processing clerk

Подпись / signature

Дата ввода документа / Document inclusion date:

Оператор / Operator

Подпись / signature

Извещение о регистрации/отказе № / Registration / rejection advice No. / Registration / rejection advice No.

Дата / Date: « »

Контролер / Controller:

Подпись / signature

Анкета генерального соглашения (xml old)

```
<?xml version="1.0" encoding="windows-1251"?>
<!--Sample XML file generated by XMLSpy v2010 (http://www.altova.com)-->
<!--Генеральное соглашение заключено между "Клиентом репозитария 1" и "Клиентом репозитария 2", дата
заключения 06.12.2012, генеральное соглашение заключено по правилам RISDA, базовыми
информирующими лицами являются сами клиенты репозитария, информирующим лицом по всем сделкам в
рамках генерального соглашения является "Клиент репозитария 1". Оплата услуг репозитария
осуществляется обеими сторонами. В дату заключения генеральное соглашение направлено для регистрации
в репозитарий.-->
<MA_REG_REQUEST n1:noNamespaceSchemaLocation="Спецификация электронных сообщений
репозитария xsd (версия 13.12.2012 с квартальным отчетом).xsd"
xmlns:n1="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance">
  <header>
    <Version>1.0</Version>
    <msgDate>2012-12-06</msgDate>
    <msgAction>REGI</msgAction>
    <msgSender>
      <id_2>
        <id>RP0000000001</id>
        <id_type>RPZR</id_type>
      </id_2>
      <name>Клиент репозитария 1</name>
    </msgSender>
    <msgReceiver>
      <id_2>
        <id>NDC0000000000</id>
        <id_type>RPZR</id_type>
      </id_2>
      <name>НКО ЗАО НРД</name>
    </msgReceiver>
    <msgId>MA0001-07-31</msgId>
  </header>
  <ma_general>
    <maId>NONREF</maId>
    <ma_info>
      <maDate>2012-12-06</maDate>
      <templateDetails>RISDA</templateDetails>
      <match_type>MATH</match_type>
    </ma_info>
    <PARTY1>
      <MACOUNTERPARTY>
        <id_2>
          <id>MC00099000777</id>
          <id_type>RPZR</id_type>
        </id_2>
        <name>Клиент репозитария 1</name>
      </MACOUNTERPARTY>
      <base_reporter1>
        <id_2>
          <id>RP0000000001</id>
          <id_type>RPZR</id_type>
        </id_2>
        <name>Клиент репозитария 1</name>
      </base_reporter1>
    </PARTY1>
    <PARTY2>
      <MACOUNTERPARTY>
        <id_2>
          <id>RP0000000002</id>
          <id_type>RPZR</id_type>
        </id_2>
      </MACOUNTERPARTY>
    </PARTY2>
  </ma_general>
</MA_REG_REQUEST>
```

```

        </id_2>
        <name>Клиент репозитария 2</name>
    </MACOUNTERPARTY>
    <base_reporter2>
        <id_2>
            <id>RP0000000002</id>
            <id_type>RPZR</id_type>
        </id_2>
        <name>Клиент репозитария 2</name>
    </base_reporter2>
</PARTY2>
<REPORTER>
    <id_2>
        <id>RP0000000001</id>
        <id_type>RPZR</id_type>
    </id_2>
    <name>Клиент репозитария 1</name>
    <rep_dfi_type>ALLD</rep_dfi_type>
    <rep_party>all</rep_party>
</REPORTER>
    <ma_payer>all</ma_payer>
</ma_general>
</MA_REG_REQUEST>
```

Анкета генерального соглашения (xml new)

Генеральное соглашение заключено между "Клиентом репозитория 1" и "Клиентом репозитория 2", дата заключения 06.12.2012, генеральное соглашение заключено по правилам RISDA, базовыми информирующими лицами являются сами клиенты репозитория, информирующим лицом по всем сделкам в рамках генерального соглашения является "Клиент репозитория 1". Оплата услуг репозитория осуществляется обеими сторонами. В дату заключения генеральное соглашение направлено для регистрации в репозитарий.

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
```

```
<nonpublicExecutionReport xmlns:fpml-annotation="http://www.fpml.org/annotation"
  xmlns:dsig="http://www.w3.org/2000/09/xmldsig#"
  xmlns="http://www.nsd.ru/repository/fpml-5.4"
  xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
  xsi:schemaLocation="http://www.nsd.ru/repository/fpml-5.4 file:../nsd-merged-schema.xsd"
  fpmlVersion="5-0" expectedBuild="50" actualBuild="4">
```

```
<!--
```

Структура данных, описывающая заголовок сообщения типа "запрос".

В данном примере: "Запрос на регистрацию ГС."

```
-->
```

```
<header>
```

```
<!-- Уникальный идентификатор отправляемого сообщения. -->
```

```
<messageId>MA0001-07-31</messageId>
```

```
<!-- Идентификатор отправителя сообщения. -->
```

```
<sentBy>Клиент репозитория 1</sentBy>
```

```
<!-- Идентификатор получателя сообщения. -->
```

```
<sendTo>НКО ЗАО НРД</sendTo>
```

```
<!-- Время формирования сообщения. -->
```

```
<creationTimestamp>2012-12-06T12:00:00.00</creationTimestamp>
```

```
</header>
```

```
<!--
```

Если значение данного элемента равно false, то сообщение nonpublicExecutionReport содержит в себе анкету для первичной регистрации. Если же значение поля равно true, то в данном сообщении содержится корректирующая информация для анкеты, присланной ранее для регистрации. Ссылка -->

```
<isCorrection>>false</isCorrection>
```

```
<!--
```

Данное поле используется для связывания последовательных сообщений между собой. Так, например, оно используется чтобы связать ответ с запросом, на который данный ответ направляется.

При отправке первого сообщения процесса указывается данное поле в соответствии с какой-либо схемой (для простоты схема может не указываться вовсе и в качестве значения может быть подставлена случайная строка). Все последующие сообщения, связанные с исходным сообщением (ответы на запрос,

ошибки,

отказы, корректировки, отзыв) должны также содержать поле correlationId с тем же значением.

Тип идентификатора определяется схемой, задаваемой в атрибуте correlationIdScheme.

```
-->
```

```
<correlationId>MAREG7</correlationId>
```

```
<!--
```

В этом поле задаётся последовательный номер данного сообщения в рамках цепочки сообщений с одним correlationId.

```
-->
```

```
<sequenceNumber>1</sequenceNumber>
```

```
<!--Информация о заключенном генеральном соглашении-->
```

```
<Trade>
```

```
<!-- Параметры генерального сообщения, направляемые на первичную регистрацию в реестр договоров.--
```

```
>
```

```
<masterAgreement>
```

```
<!-- Заголовок генерального соглашения, информация о взаимных ролях участников. -->
```

```
<masterAgreementHeader>
```

```
<!-- Информация о первой стороне генерального соглашения -->
```

```
<masterAgreementFirstPartyInformation>
```

```

    <!-- Ссылка на участника, являющегося первой стороной в данном ГС. Описание участника в конце
сообщения. -->
    <party href="Party1"/>
    <!-- Ссылка на участника, являющегося информирующим лицом для первой стороны ГС. -->
    <reportingParty href="Party1"/>
    <!-- Ссылка на участника, являющегося базовым информирующим лицом для первой стороны ГС. -->
    <baseReportingParty href="Party1"/>
</masterAgreementFirstPartyInformation>

<!-- Информация о второй стороне генерального соглашения -->
<masterAgreementSecondPartyInformation>
    <!-- Ссылка на участника, являющегося второй стороной в данном ГС. Описание участника в конце
сообщения. -->
    <party href="Party2"/>
    <!-- Ссылка на участника, являющегося информирующим лицом для второй стороны ГС. -->
    <reportingParty href="ReporterParty"/>
    <!-- Ссылка на участника, являющегося базовым информирующим лицом для второй стороны ГС. -->
    <baseReportingParty href="ReporterParty"/>
</masterAgreementSecondPartyInformation>
</masterAgreementHeader>
<!-- Технические параметры генерального соглашения -->
<masterAgreementInformation>
    <!-- Идентификатор генерального соглашения, присваиваемый ему репозитарием -->
    <masterAgreementId>NONREF</masterAgreementId>
    <!--
        Тип генерального соглашения, определяется схемой, задаваемой атрибутом
        masterAgreementTypeScheme,
        значение по умолчанию данного атрибута: http://www.nsd.ru/coding-scheme/master-agreement-type.
        Атрибут является необязательным.
    -->
    <masterAgreementType>RISDA</masterAgreementType>
    <!-- Дата заключения генерального соглашения -->
    <masterAgreementDate>2006-05-04</masterAgreementDate>
    <!-- Способ согласования анкет. -->
    <masterAgreementConfirmation>MATH</masterAgreementConfirmation>
    <!-- Информация о платильщике за услуги репозитария. Если указан только один участник, то он
оплачивает услуги за себя и за контрагента по данному ГС. Если указаны оба участника, то
каждый оплачивает услуги репозитария самостоятельно. -->
    <payerPartyReference href="Party1"/>
    <!-- Информация о платильщике. -->
    <payerPartyReference href="Party2"/>
</masterAgreementInformation>
</masterAgreement>
</Trade>
<!-- Первая сторона генерального соглашения. Атрибут id - уникальный в рамках данного сообщения
идентификатор участника, который используется для ссылок на него в других блоках сообщения. -->
<party id="Party1">
    <!-- Идентификатор участника. Тип идентификатора задаётся атрибутом partyIdScheme. Значение
атрибута по умолчанию http://www.nsd.ru/repository/fpml-5.4/coding-schemes/partyid -->
    <partyId>MC00099000777</partyId>
    <!-- Наименование (имя) участника. -->
    <partyName>Клиент репозитария 1</partyName>
    <!-- Ссылка на сторону, играющую по отношению к данному участнику определённую роль. -->
    <relatedParty>
        <!-- Ссылка на описание участника в данном документе. -->
        <partyReference href="ReporterParty"/>
        <!-- Роль relatedParty, по отношению к party. Набор ролей определяется схемой, задаваемой
в атрибуте partyRoleScheme. Значение атрибута по умолчанию: http://www.fpml.org/coding-
scheme/party-role -->
        <role>ReportingParty</role>
    <!--
        Дополнительный элемент, уточняющий роль relatedParty. Например, в этом узле передаётся
информация

```

о том, по договорам каких типов имеет право отчитываться информирующее лицо. Набор значений определяется схемой, задаваемой в атрибуте partyRoleTypeScheme. Значение атрибута по умолчанию: <http://www.fpml.org/coding-scheme/party-role-type>

```
-->
<type>ALL</type>
</relatedParty>
</party>
```

<!-- Вторая сторона генерального соглашения. Комментарии ко внутренним узлам аналогичны комментариям для Party1 -->

```
<party id="Party2">
  <!-- -->
  <partyId>RP0000000002</partyId>
  <!-- -->
  <partyName>Клиент репозитория 2</partyName>
  <!-- -->
  <relatedParty>
    <!-- -->
    <partyReference href="Party2"/>
    <!-- -->
    <role>ReportingParty</role>
  </relatedParty>
</party>
```

<!-- Информирующие лицо по договору -->

```
<party id="ReporterParty">
  <!-- -->
  <partyId>RP0000000001</partyId>
  <!-- -->
  <partyName>ReporterParty</partyName>
</party>
```

</nonpublicExecutionReport>

Анкета договора валютного свопа (печатная форма)

Форма RF004/Form RF004

АНКЕТА ДОГОВОРА ВАЛЮТНОГО СВОПА/ CURRENCY SWAP CONTRACT REGISTRATION REQUEST FORM

Параметры документа / Requisite details of the document

Отправитель / Sender:

R P 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 1
Репозитарный код / Repository code

Сторона 1

Краткое наименование / Shortened name

Получатель / Receiver:

N D C 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
Репозитарный код / Repository code

НКО ЗАО НРД

Краткое наименование / Shortened name

Исходящий номер Анкеты / Outgoing reference number of the form SWOP-1

Дата подачи Анкеты / Form submission date: 14.12.2012

Связанный документ / Related document: № _____ Дата / Date: _____

Назначение / Purpose * Для внесения сведений в реестр договоров

Содержание договора валютного свопа / Contents of the currency swap contract

Репозитарный код договора / Repository code of the contract

Дата, актуальности сведений, предоставленных в анкете / The date of the last update of the data contained in the form: _____

Регистрационный номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием / The registration number assigned by the repository to the master agreement: MA0000000001

Дата заключения договора / Contract conclusion date: 14.12.2012

Дата начала срока / Effective date: _____

Дата окончания срока действия договора / Contract expiry date: _____

Состояние договора / Contract status: _____

Состояние обязательств / Obligations status: текущие (промежуточные) обязательства исполнены частично

Код классификации ПФИ / DFI classification code SVFWNNNN

Код взаимосвязи М

Условия согласования договоров / Method of the contract data collation: Полная сверка / Complete collation

Сверка по основным полям ☒

Стороны договора / Parties to the contract

Сторона 1

R P 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 1
Репозитарный код / Repository code

Сторона 1

Краткое наименование / Shortened name

Регистрационный номер договора, присвоенный АС / Registration number assigned to the contract by AC: _____

Клиент стороны 1 / Client of Party 1

Код клиента стороны 1 / Code of the client of Party 1 : _____

Сторона 2

R P 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 2
Репозитарный код / Repository code

Сторона 2

Краткое наименование / Shortened name

Регистрационный номер договора, присвоенный АС / Registration number assigned to the contract by AC: _____

Клиент стороны 2 Client of Party 2

Код клиента стороны 2 / Code of the client of Party 2: _____

Предмет договора / Subject-matter of the contract

Валюта, подлежащая продаже по первой части договора / Currency to be sold under the first part of the contract

Сторона 1(Код валюты 1) / Party 1 (Code of currency 1) USDСторона 2(Код валюты 2 / Party 2 (Code of currency 2) EURКод валюты, подлежащей продаже (покупке) по первой части договора и выкупу (продаже) по второй части договора в одинаковом количестве (базовый актив) / Code of the currency to be sold (bought) under the first part of the contract and to be bought (sold) under the second part of the contract in equal quantity (basic asset) EUR**Расчеты по договору / Settlements under the contract****Расчеты по первой части договора / Settlements under the first part of the contract**Сумма первоначального платежа Стороны 1 / Amount of initial payment by Party 1 120Сумма первоначального платежа Стороны 2 / Amount of initial payment by Party 2 100Цена (курс конверсии) для первоначального платежа / Price (conversion rate) for initial payment 1.2Валюта, по отношению к которой выражен курс конверсии / Currency in respect of which the conversion rate is expressed
EURВалюта, в единицах которой выражен курс конверсии / Currency in which the conversion rate is expressed
USDПлатеж по первой части
договора / Payment under the first
part of the contract

В дату / date



В период / Period

Дата поставки / Delivery date: 14.12.2012 Период / Period: с (from) _____ no (to) _____**Расчеты по второй части договора / Settlement under the second part of the contract**Сумма окончательного платежа Стороны 1 / Amount of the final payment by Party 1 100Сумма окончательного платежа Стороны 2 / Amount of the final payment by Party 2 130Цена (курс конверсии) для окончательного платежа / Price (conversion rate) for the final payment 1.3Валюта, по отношению к которой выражен курс конверсии / Currency in respect of which the conversion rate is expressed
EURВалюта, в единицах которой выражен курс конверсии / Currency in which the conversion rate is expressed
USDПлатеж по второй части
договора / Payment under the
second part of the contract:

В дату / date



В период / Period

Дата поставки / Delivery date: 17.12.2012 Период / Period: с (from) _____ no (to) _____**Сведения о расчетах / Information on settlements**Код типа расчётов / Settlement type code: внеклиринговый расчетКод метода расчётов / Settlement method code: поставочный

Дата включения обязательств из договора в клиринговый пул / The date on which the contract obligations were included in the clearing pool: _____

Код клиринговой организации / Code of the clearing organization: _____

Код центрального контрагента / Code of the central counterparty: _____

Сведения о марже / Information on the margin

Начальная маржинальная сумма / Initial margin _____

Валюта суммы / Currency: _____

Код периодичности переоценке обеспечения / Security revaluation periodicity code _____

Способ определения цены / Pricing method: _____

Сведения о платежах / Information on payments

Код стороны по договору / Code of the party to the contract	Полное наименование юридического лица/ФИО физического лица / Full name of the legal entity / full name of the individual	Дата / Date	Выплата / Payment	
			Сумма / Amount	Валюта / Currency

Дополнительная информация / Additional information

Сканированные копии / Scanned copies:

(должность / title)

(Ф.И.О. / Full name)

М.П. / L.S.

(Подпись / signature)

Заполняется сотрудником Репозитария / To be filled out by the Repository's officer

Рег. номер документа /
Document registration
number

Дата приема документа /
Document receipt date

Время приема документа /
Document receipt time

Операционист / Processing
clerk

Подпись / signature

Дата ввода документа /
Document inclusion date: _____

Оператор / Operator

Подпись / signature

Извещение о регистрации/отказе № /
Registration / rejection advice No. _____

Дата /
Date: « _____ »

Контролер /
Controller: _____

Подпись /
signature

Анкета договора валютного свопа (xml old)

```
<?xml version="1.0" encoding="windows-1251"?>
```

```
<!--
```

Первая часть сделки

Сторона 1 (Идентификационный код RP0000000001) покупает 100 EUR за 120 USD у

Стороны 2 (Идентификационный код RP0000000002) по курсу 1.2 EUR/USD, дата валютирования 14.12.2012, дата заключения 14.12.2012

Вторая часть сделки

Клиент репозитория 1 продает 100 EUR за 130 USD Стороне 2 по курсу 1.3 EUR/USD, дата валютирования 17.12.12

Дата платежа совпадает с датой валютирования; используются внеклиринговые расчеты.

Сведения о проведенных платежах стороны не отчитывают. Выплата маржевых сумм не предусмотрена.-->

```
<!--Sample XML file generated by XMLSpy v2010 (http://www.altova.com)-->
```

```
<SWAPCURRENCY_REG_REQUEST n1:noNamespaceSchemaLocation="Спецификация электронных сообщений репозитория xsd (версия 13.12.2012 с квартальным отчетом).xsd"
```

```
xmlns:n1="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance">
```

```
<header>
```

```
<Version>1.0</Version>
```

```
<msgDate>2012-12-14</msgDate>
```

```
<msgAction>REGI</msgAction>
```

```
<!--Отправитель сообщения - Сторона 1-->
```

```
<msgSender>
```

```
<id_2>
```

```
<id>RP0000000001</id>
```

```
<id_type>RPZR</id_type>
```

```
</id_2>
```

```
<name>Сторона 1</name>
```

```
</msgSender>
```

```
<!--Получатель сообщения - Репозиторий НКО ЗАО НРД-->
```

```
<msgReceiver>
```

```
<id_2>
```

```
<id>NDC000000000</id>
```

```
<id_type>RPZR</id_type>
```

```
</id_2>
```

```
<name>НКО ЗАО НРД</name>
```

```
</msgReceiver>
```

```
<!--Номер сообщения, присвоенный Стороной 1-->
```

```
<msgId>SWOP-1</msgId>
```

```
</header>
```

```
<swapcurrency_general>
```

```
<!--Генеральное соглашение, в рамках которого заключен договор своп: номер, присвоенный репозитарием-->
```

```
<maId>MA0000000001</maId>
```

```
<!--Номер договора своп, присвоенный репозитарием-->
```

```
<dealUTI>NONREF</dealUTI>
```

```
<general_info>
```

```
<!--Дата заключения сделки-->
```

```
<dealDate>2012-12-14</dealDate>
```

```
<!--Состояние обязательств по договору - текущие (промежуточные) обязательства исполнены частично-->
```

```
<dealStatus>H</dealStatus>
```

```
<!--Согласование проводится только по основным полям-->
```

```
<reconciliation_type>GENF</reconciliation_type>
```

```
</general_info>
```

```
<cur_info>
```

```
<!--Код классификации ПФИ в соответствии с Приложение N 3 к Приказу ФСФР-->
```

```
<dfi_code>SVFWNNNNN</dfi_code>
```

```
<!--Код взаимосвязи в соответствии с Приложение N 6 к Приказу ФСФР-->
```

```

        <relation_code>M</relation_code>
        <!--валюта 1 - USD ("Первая валюта")-->
        <cur_first>USD</cur_first>
        <!--валюта 2 - EUR ("Вторая валюта")-->
        <cur_second>EUR</cur_second>
        <!--код валюты, подлежащей продаже (покупке) по первой части договора и выкупу
(продаже) по второй части договора в одинаковом количестве (базовый актив) EUR-->
        <cur_base>EUR</cur_base>
    </cur_info>
    <deal_party>
        <!--Сторона 1-->
        <party_first>
            <id_2>
                <id>RP0000000001</id>
                <id_type>RPZR</id_type>
            </id_2>
            <name>Сторона 1</name>
        </party_first>
        <!--Сторона 2-->
        <party_second>
            <id_2>
                <id>RP0000000002</id>
                <id_type>RPZR</id_type>
            </id_2>
            <name>Сторона 2</name>
        </party_second>
    </deal_party>
    <!--Расчеты по первой части договора-->
    <settlement_first>
        <!--Сумма платежа стороны 1-->
        <amount_party1>120</amount_party1>
        <!--Сумма платежа стороны 2-->
        <amount_party2>100</amount_party2>
        <!--Курс конверсии-->
        <conversion_price>1.2</conversion_price>
        <!--валюта, по отношению к которой выражен курс конверсии (базовая валюта)-->
        <conversion_cur>EUR</conversion_cur>
        <!--валюта, в единицах которой выражен курс конверсии-->
        <conversion_cur_unit>USD</conversion_cur_unit>
        <!--Дата оплаты-->
        <paymentDate>2012-12-14</paymentDate>
    </settlement_first>
    <!--Расчеты по второй части договора-->
    <settlement_second>
        <!--Сумма платежа стороны 1-->
        <amount_party1>100</amount_party1>
        <!--Сумма платежа стороны 2-->
        <amount_party2>130</amount_party2>
        <!--Курс конверсии-->
        <conversion_price>1.3</conversion_price>
        <!--валюта, по отношению к которой выражен курс конверсии (базовая валюта)-->
        <conversion_cur>EUR</conversion_cur>
        <!--валюта, в единицах которой выражен курс конверсии-->
        <conversion_cur_unit>USD</conversion_cur_unit>
        <!--Дата оплаты-->
        <paymentDate>2012-12-17</paymentDate>
    </settlement_second>
    <clearinfogroup>
        <!--Тип расчетов:внеклиринговый расчет-->
        <clearSettlType>OTC</clearSettlType>
        <!--Метод расчетов: поставочный-->
        <clearSettlMethod>D</clearSettlMethod>
    </clearinfogroup>

```

</swapcurrency_general>
</SWAPCURRENCY_REG_REQUEST>

Анкета договора валютного свопа (xml new)

Первая часть сделки

Сторона 1 (Идентификационный код RP0000000001) покупает 100 EUR за 120 USD у Стороны 2 (Идентификационный код RP0000000002) по курсу 1.2 EUR/USD, дата валютирования 14.12.2012, дата заключения 14.12.2012

Вторая часть сделки

Клиент репозитория 1 продает 100 EUR за 130 USD Стороне 2 по курсу 1.3 EUR/USD, дата валютирования 17.12.12.

Дата платежа совпадает с датой валютирования; используются внеклиринговые расчеты. Сведения о проведенных платежах стороны не отчитывают. Выплата маржевых сумм не предусмотрена.

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<nonpublicExecutionReport xmlns:dsig="http://www.w3.org/2000/09/xmldsig#"
  xmlns:fpml-annotation="http://www.fpml.org/annotation"
  xmlns="http://www.nsd.ru/repository/fpml-5.4"
  xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
  xsi:schemaLocation="http://www.nsd.ru/repository/fpml-5.4 file:../nsd-merged-schema.xsd" fpmlVersion="5-0">
  <!--
    Структура данных, описывающая заголовок сообщения типа "запрос".
    В данном примере: "Запрос на регистрацию Валютного свопа."
  -->
  <header>
    <!-- Уникальный идентификатор отправляемого сообщения. -->
    <messageId>SWOP-1</messageId>
    <!-- Идентификатор отправителя сообщения. -->
    <sentBy>RP0000000001</sentBy>
    <!-- Идентификатор получателя сообщения. -->
    <sendTo>NDC000000000</sendTo>
    <!-- Время формирования сообщения. -->
    <creationTimestamp>2012-12-14T18:13:51.000</creationTimestamp>
  </header>
  <!--
    Если значение данного элемента равно false, то сообщение nonpublicExecutionReport
    содержит в себе анкету для первичной регистрации нового договора. Если же значение поля равно true,
    то в данном сообщении содержится корректирующая информация для анкеты, присланной
    ранее для регистрации. -->
  <isCorrection>>false</isCorrection>
  <!--
    Данное поле используется для связывания последовательных сообщений между собой. Так, например,
    оно используется чтобы связать ответ с запросом, на который данный ответ направляется.
    При отправке первого сообщения процесса указывается данное поле в соответствии с какой-либо
    схемой (для простоты схема может не указываться вовсе и в качестве значения может быть подставлена
    случайная строка). Все последующие сообщения, связанные с исходным сообщением (ответы на запрос,
    ошибки,
    отказы, корректировки, отзыв) должны также содержать поле correlationId с тем же значением.
    Тип идентификатора определяется схемой, задаваемой в атрибуте correlationIdScheme.
  -->
  <correlationId>RCUSWAP17</correlationId>
  <!--
    В этом поле задаётся последовательный номер данного сообщения в рамках цепочки сообщений с
    одним correlationId.
  -->
  <sequenceNumber>1</sequenceNumber>

  <!-- Элементы onBehalfOf определяют стороны рапортуемой сделки: участников и их клиентов. -->
  <onBehalfOf>
```

```

<!-- Ссылка на участника - сторону сделки. -->
<partyReference href="first"/>
<!-- Ссылка на клиента участника задаётся элементом accountReference -->
<!-- <accountReference href="first"/> -->
</onBehalfOf>
<onBehalfOf>
  <partyReference href="second"/>
</onBehalfOf>

<!--
Поле задаёт причину совершения рапортуемой сделки. Значения определяются схемой
http://www.fpml.org/coding-scheme/originating-event. Возможные значения: Trade, Clearing, Exercise и др.,
см. схему.-->
<originatingEvent>Trade</originatingEvent>
<!-- Описание рапортуемого бизнес-события - сделки. -->
<trade xsi:type="TradeExt">

  <!-- Заголовок сделки, в котором описываются роли участников по отношению друг к другу. -->
  <tradeHeader>
    <!-- Идентификатор сделки, присвоенный ей во внутренней системе участника. -->
    <partyTradeIdentifier>
      <!-- Ссылка на участника, для которого определяется данная информация. -->
      <partyReference href="first"/>
      <!-- Идентификатор сделки. -->
      <tradeId>79</tradeId>
    </partyTradeIdentifier>
    <!-- Та же информация о второй стороне сделки - идентификатор сделки, присвоенные ей
    второй стороной -->
    <partyTradeIdentifier>
      <partyReference href="second"/>
      <tradeId>1475</tradeId>
    </partyTradeIdentifier>
    <!-- Дополнительная информация о сделке, которую хочет передать участник. Подробно о составе
    информации, которую можно передать в этом блоке см. в схеме. -->
    <partyTradeInformation>
      <!-- Ссылка на участника, относительно которого сообщается дополнительная информация. -->
      <partyReference href="first"/>
      <!-- Роль участника в данной сделке. Определяется схемой http://www.fpml.org/coding-
scheme/reporting-role -->
      <reportingRole>ReportingParty</reportingRole>
    </partyTradeInformation>
    <!-- Дата совершения сделки. -->
    <tradeDate>2012-12-14</tradeDate>
  </tradeHeader>

  <!-- Информация о деталях контракта "валютный своп" -->
  <fxSwap>
    <!-- Класс актива, с которым совершается сделка. Набор возможных значений определяется
    соответствующей схемой. -->
    <primaryAssetClass>ForeignExchange</primaryAssetClass>

    <!-- Ближайшая нога свопа. -->
    <nearLeg>
      <!-- Первая из двух обмениваемых валют по одной валютной транзакции в рамках договора
      валютного (конверсионного) свопа. -->
      <exchangedCurrency1>
        <!-- Ссылка на сторону, являющуюся плательщиком данной валюты. -->
        <payerPartyReference href="first"/>
        <!-- Ссылка на сторону, являющуюся получателем данной валюты. -->
        <receiverPartyReference href="second"/>
        <!-- Информация о платеже. -->
        <paymentAmount>
          <!-- Валюта платежа -->

```

```
<currency>USD</currency>
<!-- Сумма платежа -->
<amount>120</amount>
</paymentAmount>
</exchangedCurrency1>
```

<!-- Вторая из двух обмениваемых валют по одной валютной транзакции в рамках договора валютного (конверсионного) свопа. -->

```
<exchangedCurrency2>
  <!-- Ссылка на сторону, являющуюся плательщиком данной валюты. -->
  <payerPartyReference href="second"/>
  <!-- Ссылка на сторону, являющуюся получателем данной валюты. -->
  <receiverPartyReference href="first"/>
  <!-- Информация о платеже. -->
  <paymentAmount>
    <!-- Валюта платежа -->
    <currency>EUR</currency>
    <!-- Сумма платежа -->
    <amount>100</amount>
  </paymentAmount>
</exchangedCurrency2>
```

<!-- Валюта лота -->

```
<dealtCurrency>ExchangedCurrency2</dealtCurrency>
```

<!-- Срок, выраженный через тип периода и множитель (например, 1D, 1Y, т.п.). -->

```
<tenorPeriod>
```

<!-- Множитель к временному периоду, например: 1, 2, 3, т.п. Отрицательное значение может использоваться для указания на проведение зачета, относящегося к другой дате, например: -2 дня. -->

```
<periodMultiplier>0</periodMultiplier>
```

<!-- Временной период, например: день, неделя, месяц или год. Если значение periodMultiplier равно 0, то значение period должно быть D (день). -->

```
<period>D</period>
```

```
</tenorPeriod>
```

<!-- Дата валютирования -->

```
<valueDate>2012-12-14</valueDate>
```

<!-- Используется для описания конкретного типа валютной транзакции, расчеты по которому осуществляются в единой валюте (например, беспоставочный форвард - NDF). -->

```
<exchangeRate>
```

<!-- Определяет две валюты валютной транзакции и котировочное соотношение между этими двумя валютами. -->

```
<quotedCurrencyPair>
```

<!-- Первая валюта пары -->

```
<currency1>USD</currency1>
```

<!-- Вторая валюта пары -->

```
<currency2>EUR</currency2>
```

<!-- Тип котировки, сколько единиц одной валюты дают за единицу второй валюты. -->

```
<quoteBasis>Currency1PerCurrency2</quoteBasis>
```

```
</quotedCurrencyPair>
```

<!-- Кросс-курс -->

```
<rate>1.2</rate>
```

```
</exchangeRate>
```

```
</nearLeg>
```

<!-- Дальняя нога свопа -->

```
<farLeg>
```

```
<exchangedCurrency1>
```

```
<payerPartyReference href="second"/>
```

```
<receiverPartyReference href="first"/>
```

```
<paymentAmount>
```

```
<currency>USD</currency>
```

```
<amount>130</amount>
```

```
</paymentAmount>
```

```
</exchangedCurrency1>
```

```
<exchangedCurrency2>
```

```
<payerPartyReference href="first"/>
```

```

    <receiverPartyReference href="second"/>
    <paymentAmount>
      <currency>EUR</currency>
      <amount>100</amount>
    </paymentAmount>
  </exchangedCurrency2>
<dealtCurrency>ExchangedCurrency2</dealtCurrency>
<tenorPeriod>
  <periodMultiplier>3</periodMultiplier>
  <period>D</period>
</tenorPeriod>
<valueDate>2012-12-17</valueDate>
<exchangeRate>
  <quotedCurrencyPair>
    <currency1>USD</currency1>
    <currency2>EUR</currency2>
    <quoteBasis>Currency1PerCurrency2</quoteBasis>
  </quotedCurrencyPair>
  <rate>1.3</rate>
</exchangeRate>
</farLeg>
</fxSwap>
<!-- Структура данных определяющая в рамках каких документов происходит регулирование сделки. -->
<documentation>
  <!-- Структура данных определяющая генеральное соглашение, в рамках которого совершена данная сделка. -->
  <masterAgreement xsi:type="MasterAgreementExt">
    <!-- Тип генерального соглашения -->
    <masterAgreementType>NAUFOR</masterAgreementType>
    <!-- Версия генерального соглашения -->
    <masterAgreementVersion>2011</masterAgreementVersion>
    <!-- Дата, в которую было заключено генеральное соглашение. -->
    <masterAgreementDate>2012-05-04</masterAgreementDate>
    <!-- Уникальный идентификационный номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием. -->
    <masterAgreementId>NONREF</masterAgreementId>
  </masterAgreement>
</documentation>
<!-- Специфичные требования регулятора -->
<nsdSpecificTradeFields>
  <dealStatus>O</dealStatus>
  <dfiCode>SVFWNNNNN</dfiCode>
  <relationCode>M</relationCode>
  <clearSettlType>OTC</clearSettlType>
  <clearSettlMethod>D</clearSettlMethod>
</nsdSpecificTradeFields>
</trade>
<!-- Первая сторона сделки. Атрибут id - уникальный в рамках данного сообщения
идентификатор участника, который используется для ссылок на него в других блоках сообщения. -->
<party id="first">
  <!-- Идентификатор участника. Тип идентификатора задаётся атрибутом partyIdScheme. Значение
атрибута по умолчанию http://www.nsd.ru/repository/fpml-5.4/coding-schemes/partyid -->
  <partyId>RP0000000001</partyId>
  <!-- Наименование (имя) участника. -->
  <partyName>Сторона 1</partyName>
  <!-- Ссылка на сторону, играющую по отношению к данному участнику определённую роль. -->
</party>
<!-- Вторая сторона сделки. Комментарии ко внутренним узлам аналогичным комментариям для first -->
<party id="second">
  <!-- -->
  <partyId>RP0000000002</partyId>
  <!-- -->
  <partyName>Сторона 2</partyName>

```

```
<!-- -->  
</party>  
</nonpublicExecutionReport>
```


Извещение о регистрации (печатная форма)

Форма RS003 / Form RS003

ИЗВЕЩЕНИЕ О РЕГИСТРАЦИИ / REGISTRATION ADVICE

Параметры документа / Requisite details of the document

Отправитель/Receiver: **N D C 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0** НКО ЗАО НРД
Получатель / Sender: **R P 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 1** Клиент репозитария 1
Репозитарный код / Repository code Краткое наименование / Shortened name

Исходящий номер извещения / Outgoing reference number of the report: R0002

Дата регистрации / Registration date: 06.12.2012

Назначение / Purpose: Сообщение в/из Репозитария

Сведения, предоставленные в Анкете генерального соглашения / договора / The data contained in the submitted master agreement / contract registration request form*

Исходящий номер

Анкеты генерального соглашения/договора / Outgoing reference number of the master agreement / contract registration request form MA0001-07-31 от / dated 06.12.2012

успешно зарегистрированы в Репозитарии / have been successfully registered with the Repository.

Регистрационный номер,

Генерального соглашения / договора в системе Репозитария / Registration number of the master agreement / contract within the Repository's registration system : RPZT000000000001

Дата регистрации / Registration date: 06.12.2012

АНКЕТА ГЕНЕРАЛЬНОГО СОГЛАШЕНИЯ / MASTER AGREEMENT REPORTING FORM

Содержание Генерального соглашения / Contents of the master agreement

RPZT000000000001

Репозитарный код соглашения / Agreement's repository code

Дата заключения Генерального соглашения / Master agreement conclusion date: 06.12.2012

Дата начала срока / Effective date: _____

Дата завершения Генерального соглашения / Master agreement termination date: _____

Дата актуальности сведений, предоставленных в Анкете / The date of the last update of the data contained in the form: _____

Способ согласования договоров / Contracts affirmation method:

Встречное / Counter-Affirmation



Комбинированное / Combined



Оплата услуг репозитария по генеральному соглашению / Payment for repository services under the master agreement

Сторона 1 / Party 1



Сторона 2 / Party 2



Обе стороны / Both Parties



Стороны Генерального соглашения / Parties to the master agreement

Первая сторона Генерального соглашения / Party 1 to the master agreement

R	P	0	0	0	0	0	0
---	---	---	---	---	---	---	---

0	0	0	0	0	1
---	---	---	---	---	---

Репозитарный код / Repository code

Клиент репозитария 1

Краткое наименование / Shortened name

Базовое информирующее лицо первой стороны / Principal reporting agent of Party 1

R	P	0	0	0	0	0	0
---	---	---	---	---	---	---	---

0	0	0	0	0	1
---	---	---	---	---	---

Репозитарный код / Repository code

Клиент репозитария 1

Краткое наименование / Shortened name

Регистрационный номер соглашения, присвоенный первой стороной / The repository number assigned to the agreement by Party 1: _____

Клиент стороны 1 / Client of Party 1 _____

Вторая сторона Генерального соглашения / Party 2 to the master agreement

R	P	0	0	0	0	0	0
---	---	---	---	---	---	---	---

0	0	0	0	0	2
---	---	---	---	---	---

Репозитарный код / Repository code

Клиент репозитария 2

Краткое наименование / Shortened name

Базовое информирующее лицо второй стороны / Principal reporting agent of Party 2

R	P	0	0	0	0	0	0
---	---	---	---	---	---	---	---

0	0	0	0	0	2
---	---	---	---	---	---

Репозитарный код / Repository code

Клиент репозитария 2

Краткое наименование / Shortened name

Регистрационный номер соглашения, присвоенный второй стороной / Registration number assigned to the agreement by Party 2 _____

Клиент стороны 2 / Client of Party 2 _____

Форма Генерального соглашения / Master agreement form

Форма Генерального соглашения / Master agreement form: RISDA

Информирующие лица по договору / Reporting agents under the contract

Сторона соглашения / Party to the agreement	Информирующие лицо / Reporting agent		Тип сделки / Transaction type
	Код / Code	Краткое наименование / Shortened name	
Обе стороны	RP0000000001	Клиент репозитария 1	Все договора

Дополнительная информация / Additional information

Сканированные копии / Scanned copies:

(должность / title)

(Ф.И.О. / full name)

(подпись / signature)

М.П. / L.S.

Заполняется сотрудником Репозитария / To be filled out by the Repository's employee

Рег. номер документа /
Document registration
number

Дата приема документа /
Document receipt date

Время приема документа /
Document receipt time

Операционист / Processing
clerk

Подпись / signature

Дата ввода документа /
Document inclusion date:

Оператор / Operator

Подпись / signature

Извещение о регистрации/отказе № /
Registration / rejection advice No. /
Registration / rejection advice No.

Дата /
Date: « »

Контролер /
Controller:

Подпись /
signature

Извещение о регистрации (xml old)

```
<?xml version="1.0" encoding="windows-1251"?>
<!--Sample XML file generated by XMLSpy v2010 (http://www.altova.com)-->
<!--06.12.2012 Репозитарию для регистрации направлено генеральное соглашение со следующими
параметрами: Генеральное соглашение заключено между "Клиентом репозитория 1" и "Клиентом
репозитория 2", дата заключения 06.12.2012, генеральное соглашение заключено по правилам RISDA,
базовыми информирующими лицами являются сами клиенты репозитория, информирующим лицом по всем
сделкам в рамках генерального соглашения является "Клиент репозитория 1". Оплата услуг репозитория
осуществляется обеими сторонами. В дату заключения генеральное соглашение направлено для регистрации
в репозиторий. Исходящий номер у клиента "MA0001-07-31".
Репозиторий 06.12.2012 зарегистрировал указанное генеральное соглашение в реестре договоров и направил
"Клиенту репозитория 1" Извещение о регистрации за номером R0002 с указанием номера присвоенного
генеральному соглашению "RPZT000000000001".-->
<STATUS_ADVICE n1:noNamespaceSchemaLocation="Спецификация электронных сообщений репозитория
xsd (версия 13.12.2012 с квартальным отчетом).xsd" xmlns:n1="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-
instance">
  <header>
    <Version>1.0</Version>
    <msgDate>2012-12-06</msgDate>
    <msgAction>NEWM</msgAction>
  <!--Отправитель сообщения - Репозиторий НКО ЗАО НРД-->
    <msgSender>
      <id_2>
        <id>NDC000000000</id>
        <id_type>RPZR</id_type>
      </id_2>
      <name>НКО ЗАО НРД</name>
    </msgSender>
  <!--Получатель сообщения - Сторона 1-->
    <msgReceiver>
      <id_2>
        <id>RP0000000001</id>
        <id_type>RPZR</id_type>
      </id_2>
      <name>Сторона 1</name>
    </msgReceiver>
    <msgId>R0002</msgId>
    <ref_dtls>
      <ref_doc_num>MA0001-07-31</ref_doc_num>
      <ref_doc_date>2012-12-06</ref_doc_date>
    </ref_dtls>
  </header>
  <deal_statement>
    <maState>REGISTERED</maState>
    <reg_date>2012-12-06</reg_date>
  </deal_statement>
  <MA>
    <maId>RPZT000000000001</maId>
    <ma_info>
      <maDate>2012-12-06</maDate>
      <templateDetails>RISDA</templateDetails>
      <match_type>MATH</match_type>
    </ma_info>
    <PARTY1>
      <MACOUNTERPARTY>
        <id_2>
          <id>RP0000000001</id>
          <id_type>RPZR</id_type>
        </id_2>
```

```

        <name>Клиент репозитария 1</name>
        <MACOUNTERPARTY>
        <base_reporter1>
        <id_2>
        <id>RP0000000001</id>
        <id_type>RPZR</id_type>
    </id_2>
    <name>Клиент репозитария 1</name>
    </base_reporter1>
</PARTY1>
<PARTY2>
    <MACOUNTERPARTY>
    <id_2>
    <id>RP0000000002</id>
    <id_type>RPZR</id_type>
</id_2>
<name>Клиент репозитария 2</name>
    <MACOUNTERPARTY>
    <base_reporter2>
    <id_2>
    <id>RP0000000002</id>
    <id_type>RPZR</id_type>
</id_2>
<name>Клиент репозитария 2</name>
    </base_reporter2>
</PARTY2>
<REPORTER>
    <id_2>
    <id>RP0000000001</id>
    <id_type>RPZR</id_type>
    </id_2>
    <name>Клиент репозитария 1</name>
    <rep_dfi_type>ALLD</rep_dfi_type>
    <rep_party>all</rep_party>
</REPORTER>
    <ma_payer>all</ma_payer>
</MA>
</STATUS_ADVICE>
```

Извещение о регистрации (xml new)

06.12.2012 Репозитарию для регистрации направлено генеральное соглашение со следующими параметрами: Генеральное соглашение заключено между "Клиентом репозитория 1" и "Клиентом репозитория 2", дата заключения 06.12.2012, генеральное соглашение заключено по правилам RISDA, базовыми информирующими лицами являются сами клиенты репозитория, информирующим лицом по всем сделкам в рамках генерального соглашения является "Клиент репозитория 1". Оплата услуг репозитория осуществляется обеими сторонами. В дату заключения генеральное соглашение направлено для регистрации в репозиторий. Исходящий номер у клиента "MA0001-07-31". Репозитарий 06.12.2012 зарегистрировал указанное генеральное соглашение в реестре договоров и направил "Клиенту репозитория 1" Извещение о регистрации за номером R0002 с указанием номера присвоенного генеральному соглашению "RPZT000000000001".

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<nonpublicExecutionReportAcknowledgement xmlns:fpml-annotation="http://www.fpml.org/annotation"
xmlns:dsig="http://www.w3.org/2000/09/xmldsig#"
xmlns="http://www.nsd.ru/repository/fpml-5.4"
xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
xsi:schemaLocation="http://www.nsd.ru/repository/fpml-5.4 file:../nsd-merged-schema.xsd" fpmlVersion="5-0"
expectedBuild="50"
actualBuild="4">

  <!--
    Структура данных, описывающая заголовок сообщения типа "ответ".
    В данном примере: ответ о подтверждение регистрации ГС.
  -->
  <header>
    <!-- Уникальный идентификатор отправляемого сообщения. -->
    <messageId>R0002</messageId>
    <!-- Идентификатор сообщения, в ответ на которое отправляется текущее сообщение. -->
    <inReplyTo>MA0001-07-31</inReplyTo>
    <!-- Идентификатор отправителя сообщения. -->
    <sentBy>НКО ЗАО НРД</sentBy>
    <!-- Идентификатор получателя сообщения. -->
    <sendTo>Клиент репозитория 1</sendTo>
    <!-- Время формирования сообщения. -->
    <creationTimestamp>2012-12-06T12:00:00.00</creationTimestamp>
  </header>

  <!--
    Данное поле используется для связывания последовательных сообщений между собой. Так, например,
    оно используется чтобы связать ответ с запросом, на который данный ответ направляется.
    При отправке первого сообщения процесса указывается данное поле в соответствии с какой-либо
    схемой (для простоты схема может не указываться вовсе и в качестве значения может быть подставлена
    случайная строка). Все последующие сообщения, связанные с исходным сообщением (ответы на запрос,
    ошибки, отказы, корректировки, отзывы) должны также содержать поле correlationId с тем же значением.
  -->
  <correlationId>MAREG7</correlationId>

  <!--
    В этом поле задаётся последовательный номер данного сообщения в рамках цепочки сообщений с
    одним correlationId.
  -->
  <sequenceNumber>2</sequenceNumber>

  <!-- Структура содержит исходное сообщение, то есть, то сообщение в ответ на которое отправляется
  подтверждение. -->
  <originalMessage>
```

```

<!--Информация о заключенном генеральном соглашении-->
<Trade>
  <!-- Параметры генерального сообщения, направляемые на первичную регистрацию в реестр договоров.-->
  <masterAgreement>
    <!-- Заголовок генерального соглашения, информация о взаимных ролях участников. -->
    <masterAgreementHeader>
      <!-- Информация о первой стороне генерального соглашения -->
      <masterAgreementFirstPartyInformation>
        <!-- Ссылка на участника, являющегося первой стороной в данном ГС. Описание участника в конце сообщения. -->
        <party href="Party1"/>
        <!-- Ссылка на участника, являющегося информирующим лицом для первой стороны ГС. -->
        <reportingParty href="Party1"/>
        <!-- Ссылка на участника, являющегося базовым информирующим лицом для первой стороны ГС. -->
        <baseReportingParty href="Party1"/>
      </masterAgreementFirstPartyInformation>

      <!-- Информация о второй стороне генерального соглашения -->
      <masterAgreementSecondPartyInformation>
        <!-- Ссылка на участника, являющегося второй стороной в данном ГС. Описание участника в конце сообщения. -->
        <party href="Party2"/>
        <!-- Ссылка на участника, являющегося информирующим лицом для второй стороны ГС. -->
        <reportingParty href="ReporterParty"/>
        <!-- Ссылка на участника, являющегося базовым информирующим лицом для второй стороны ГС. -->
        <baseReportingParty href="ReporterParty"/>
      </masterAgreementSecondPartyInformation>
    </masterAgreementHeader>
    <!-- Технические параметры генерального соглашения -->
    <masterAgreementInformation>
      <!-- Идентификатор генерального соглашения, присваиваемый ему репозитарием -->
      <masterAgreementId>NONREF</masterAgreementId>
      <!--
        Тип генерального соглашения, определяется схемой, задаваемой атрибутом
        masterAgreementTypeScheme,
        значение по умолчанию данного атрибута: http://www.nsd.ru/coding-scheme/master-agreement-type.
        Атрибут является необязательным.
      -->
      <masterAgreementType>RISDA</masterAgreementType>
      <!-- Дата заключения генерального соглашения -->
      <masterAgreementDate>2006-05-04</masterAgreementDate>
      <!-- Способ согласования анкет. -->
      <masterAgreementConfirmation>MATH</masterAgreementConfirmation>
      <!-- Информация о платильщике за услуги репозитария. Если указан только один участник, то он
        оплачивает услуги за себя и за контрагента по данному ГС. Если указаны оба участника, то
        каждый оплачивает услуги репозитария самостоятельно. -->
      <payerPartyReference href="Party1"/>
      <!-- Информация о платильщике. -->
      <payerPartyReference href="Party2"/>
    </masterAgreementInformation>
  </masterAgreement>
</Trade>
</originalMessage>
</nonpublicExecutionReportAcknowledgement>

```

Извещение об отказе в регистрации (печатная форма)

Форма RS004 / Form RS004

ИЗВЕЩЕНИЕ ОБ ОТКАЗЕ В РЕГИСТРАЦИИ / REJECTION ADVICE

Параметры документа / Requisite details of the document

Отправитель/Receiver: **N D C 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0** НКО ЗАО НРД
Репозитарный код / Repository code Краткое наименование / Shortened name
Получатель / Sender: **R P 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 1** Сторона 1
Репозитарный код / Repository code Краткое наименование / Shortened name

Исходящий номер извещения / Outgoing reference number of the report: R0001

Дата регистрации / Registration date: 14.12.2012

Назначение / Purpose: Сообщение в/из Репозитария

Сведения, предоставленные в Анкете генерального соглашения /договора / The data contained in the submitted master agreement / contract registration request form

Исходящий номер

Анкеты генерального соглашения/договора / Outgoing reference number of the master agreement / contract registration request form SWOP-1 от / dated 14.12.2012

не могут быть зарегистрированы в Репозитарии / may not be registered with the Repository.

Причина отказа / Reason for rejection: В сообщении SWOP-2 получена анкета с новыми данными

Дата / Date: 14/12/2012

Извещение об отказе в регистрации (xml old)

```
<?xml version="1.0" encoding="windows-1251"?>
<!--Sample XML file generated by XMLSpy v2010 (http://www.altova.com)-->
<!--Репозитарий 14.12.2012 получил от "Стороны 1" анкету договора валютный своп для регистрации.
Договор валютный своп заключен в рамках генерального соглашения МА0000000001. Номер сообщения,
присвоенный клиентом: SWOP-1. 14.12.2012 репозитарием была получена анкета SWOP-2 с такими же
данными, как SWOP-1. Репозитарий по анкете с номером SWOP-1 направляет "Стороне 1" отказ в
регистрации.-->
<STATUS_ADVICE n1:noNamespaceSchemaLocation="Спецификация электронных сообщений репозитария
xsd (версия 13.12.2012 с квартальным отчетом).xsd" xmlns:n1="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-
instance">
  <header>
    <Version>1.0</Version>
    <msgDate>2012-12-14</msgDate>
    <msgAction>NEWM</msgAction>
  <!--Отправитель сообщения - Репозитарий НКО ЗАО НРД-->
    <msgSender>
      <id_2>
        <id>NDC000000000</id>
        <id_type>RPZR</id_type>
      </id_2>
      <name>НКО ЗАО НРД</name>
    </msgSender>
  <!--Получатель сообщения - Сторона 1-->
    <msgReceiver>
      <id_2>
        <id>RP0000000001</id>
        <id_type>RPZR</id_type>
      </id_2>
      <name>Сторона 1</name>
    </msgReceiver>
    <msgId>R0001</msgId>
    <ref_dtls>
      <ref_doc_num>SWOP-1</ref_doc_num>
      <ref_doc_date>2012-12-14</ref_doc_date>
    </ref_dtls>
  </header>
  <!--Информация о текущем состоянии договора в репозитарии - "отказ в регистрации"-->
  <deal_statement>
    <maId>MA0000000001</maId>
    <dealUTI>NONREF</dealUTI>
    <maState>RJCT</maState>
    <reg_date>2012-12-14</reg_date>
  </deal_statement>
  <!--Причина присвоения статуса: код причины "иная причина" с описанием-->
  <ma_trade_status>
    <type_reason>NARR</type_reason>
    <reason_narrative>В сообщении SWOP-2 получена анкета с новыми
данными</reason_narrative>
  </ma_trade_status>
</STATUS_ADVICE>
```


Извещение об отказе в регистрации (xml new)

Репозиторий 14.12.2012 получил от "Стороны 1" анкету договора валютный своп для регистрации. Договор валютный своп заключен в рамках генерального соглашения МА0000000001. Номер сообщения, присвоенный клиентом: SWOP-1. 14.12.2012 репозитарием была получена анкета SWOP-2 с такими же данными, как SWOP-1. Репозиторий по анкете с номером SWOP-1 направляет "Стороне 1" отказ в регистрации.

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<nonpublicExecutionReportException xmlns:fpml-annotation="http://www.fpml.org/annotation"
  xmlns:dsig="http://www.w3.org/2000/09/xmldsig#" xmlns="http://www.nsd.ru/repository/fpml-5.4"
  xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
  xsi:schemaLocation="http://www.nsd.ru/repository/fpml-5.4 file:../fpml-main.xsd"
  fpmlVersion="5-0" expectedBuild="50" actualBuild="4">
  <header>
    <messageId>R0001</messageId>
    <inReplyTo>SWOP-1</inReplyTo>
    <sentBy>NDC000000000</sentBy>
    <sendTo>RP0000000001</sendTo>
    <creationTimestamp>2012-12-14T19:13:51.000</creationTimestamp>
  </header>

  <correlationId>correlationIdFxSwap</correlationId>
  <sequenceNumber>1</sequenceNumber>

  <reason>
    <reasonCode>ErrorCode</reasonCode>
    <location>nonpublicExecutionReport/header/messageId</location>
    <description>В сообщении SWOP-2 получена анкета с новыми данными</description>
  </reason>

  <additionalData>
    <mimeType>text/plain</mimeType>
    <originalMessage>
      <nonpublicExecutionReport xmlns:dsig="http://www.w3.org/2000/09/xmldsig#"
        xmlns:fpml-annotation="http://www.fpml.org/annotation"
        xmlns="http://www.nsd.ru/repository/fpml-5.4"
        xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
        xsi:schemaLocation="http://www.nsd.ru/repository/fpml-5.4 file:../nsd-merged-schema.xsd" fpmlVersion="5-0">
        <!--
          Структура данных, описывающая заголовок сообщения типа "запрос".
          В данном примере: "Запрос на регистрацию Валютного свопа."
        -->
        <header>
          <!-- Уникальный идентификатор отправляемого сообщения. -->
          <messageId>SWOP-1</messageId>
          <!-- Идентификатор отправителя сообщения. -->
          <sentBy>RP0000000001</sentBy>
          <!-- Идентификатор получателя сообщения. -->
          <sendTo>NDC000000000</sendTo>
          <!-- Время формирования сообщения. -->
          <creationTimestamp>2012-12-14T18:13:51.000</creationTimestamp>
        </header>
        <!--
          Если значение данного элемента равно false, то сообщение nonpublicExecutionReport
          содержит в себе анкету для первичной регистрации нового договора. Если же значение поля равно true,
          то в данном сообщении содержится корректирующая информация для анкеты, присланной
          ранее для регистрации. -->
        <isCorrection>false</isCorrection>
        <!--
          Данное поле используется для связывания последовательных сообщений между собой. Так, например,
          оно используется чтобы связать ответ с запросом, на который данный ответ направляется.
```

При отправке первого сообщения процесса указывается данное поле в соответствии с какой-либо схемой (для простоты схема может не указываться вовсе и в качестве значения может быть подставлена случайная строка). Все последующие сообщения, связанные с исходным сообщением (ответы на запрос, ошибки,

отказы, корректировки, отзыв) должны также содержать поле correlationId с тем же значением.

Тип идентификатора определяется схемой, задаваемой в атрибуте correlationIdScheme.

```
-->
<correlationId>RCUSWAP17</correlationId>
<!--
```

В этом поле задаётся последовательный номер данного сообщения в рамках цепочки сообщений с одним correlationId.

```
-->
<sequenceNumber>1</sequenceNumber>
```

```
<!-- Элементы onBehalfOf определяют стороны рапортуемой сделки: участников и их клиентов. -->
```

```
<onBehalfOf>
```

```
  <!-- Ссылка на участника - сторону сделки. -->
```

```
  <partyReference href="first"/>
```

```
  <!-- Ссылка на клиента участника задаётся элементом accountReference -->
```

```
  <!-- <accountReference href="first"/> -->
```

```
</onBehalfOf>
```

```
<onBehalfOf>
```

```
  <partyReference href="second"/>
```

```
</onBehalfOf>
```

```
<!--
```

Поле задаёт причину совершения рапортуемой сделки. Значения определяются схемой <http://www.fpml.org/coding-scheme/originating-event>. Возможные значения: Trade, Clearing, Exercise и др., см. схему.-->

```
<originatingEvent>Trade</originatingEvent>
```

```
<!-- Описание рапортуемого бизнес-события - сделки. -->
```

```
<trade xsi:type="TradeExt">
```

```
  <!-- Заголовок сделки, в котором описываются роли участников по отношению друг к другу. -->
```

```
  <tradeHeader>
```

```
    <!-- Идентификатор сделки, присвоенный ей во внутренней системе участника. -->
```

```
    <partyTradeIdentifier>
```

```
      <!-- Ссылка на участника, для которого определяется данная информация. -->
```

```
      <partyReference href="first"/>
```

```
      <!-- Идентификатор сделки. -->
```

```
      <tradeId>79</tradeId>
```

```
    </partyTradeIdentifier>
```

```
    <!-- Та же информация о второй стороне сделки - идентификатор сделки, присвоенные ей второй стороной -->
```

```
    <partyTradeIdentifier>
```

```
      <partyReference href="second"/>
```

```
      <tradeId>1475</tradeId>
```

```
    </partyTradeIdentifier>
```

```
    <!-- Дополнительная информация о сделке, которую хочет передать участник. Подробно о составе информации, которую можно передать в этом блоке см. в схеме. -->
```

```
    <partyTradeInformation>
```

```
      <!-- Ссылка на участника, относительно которого сообщается дополнительная информация. -->
```

```
      <partyReference href="first"/>
```

<!-- Роль участника в данной сделке. Определяется схемой <http://www.fpml.org/coding-scheme/reporting-role> -->

```
      <reportingRole>ReportingParty</reportingRole>
```

```
    </partyTradeInformation>
```

```
    <!-- Дата совершения сделки. -->
```

```
    <tradeDate>2012-12-14</tradeDate>
```

```
  </tradeHeader>
```

```
  <!-- Информация о деталях контракта "валютный своп" -->
```

```
  <fxSwap>
```

```

<!-- Класс актива, с которым совершается сделка. Набор возможных значений определяется
соответствующей схемой. -->
<primaryAssetClass>ForeignExchange</primaryAssetClass>

<!-- Ближайшая нога свопа. -->
<nearLeg>
  <!-- Первая из двух обмениваемых валют по одной валютной транзакции в рамках договора
валютного (конверсионного) свопа. -->
  <exchangedCurrency1>
    <!-- Ссылка на сторону, являющуюся плательщиком данной валюты. -->
    <payerPartyReference href="first"/>
    <!-- Ссылка на сторону, являющуюся получателем данной валюты. -->
    <receiverPartyReference href="second"/>
    <!-- Информация о платеже. -->
    <paymentAmount>
      <!-- Валюта платежа -->
      <currency>USD</currency>
      <!-- Сумма платежа -->
      <amount>120</amount>
    </paymentAmount>
  </exchangedCurrency1>

  <!-- Вторая из двух обмениваемых валют по одной валютной транзакции в рамках договора
валютного (конверсионного) свопа. -->
  <exchangedCurrency2>
    <!-- Ссылка на сторону, являющуюся плательщиком данной валюты. -->
    <payerPartyReference href="second"/>
    <!-- Ссылка на сторону, являющуюся получателем данной валюты. -->
    <receiverPartyReference href="first"/>
    <!-- Информация о платеже. -->
    <paymentAmount>
      <!-- Валюта платежа -->
      <currency>EUR</currency>
      <!-- Сумма платежа -->
      <amount>100</amount>
    </paymentAmount>
  </exchangedCurrency2>
  <!-- Валюта лота -->
  <dealtCurrency>ExchangedCurrency2</dealtCurrency>
  <!-- Срок, выраженный через тип периода и множитель (например, 1D, 1Y, т.п.). -->
  <tenorPeriod>
    <!-- Множитель к временному периоду, например: 1, 2, 3, т.п. Отрицательное значение может
использоваться для указания на проведение зачета, относящегося к другой дате, например: -2 дня. -->
    <periodMultiplier>0</periodMultiplier>
    <!-- Временной период, например: день, неделя, месяц или год. Если значение periodMultiplier
равно 0, то значение period должно быть D (день). -->
    <period>D</period>
  </tenorPeriod>
  <!-- Дата валютирования -->
  <valueDate>2012-12-14</valueDate>
  <!-- Используется для описания конкретного типа валютной транзакции, расчеты по которому
осуществляются в единой валюте (например, беспоставочный форвард - NDF). -->
  <exchangeRate>
    <!-- Определяет две валюты валютной транзакции и котировочное соотношение между этими
двумя валютами. -->
    <quotedCurrencyPair>
      <!-- Первая валюта пары -->
      <currency1>USD</currency1>
      <!-- Вторая валюта пары -->
      <currency2>EUR</currency2>
      <!-- Тип котировки, сколько единиц одной валюты дают за единицу второй валюты. -->
      <quoteBasis>Currency1PerCurrency2</quoteBasis>
    </quotedCurrencyPair>
  </exchangeRate>

```

```

        <!-- Кросс-курс -->
        <rate>1.2</rate>
    </exchangeRate>
</nearLeg>
<!-- Дальняя нога свопа -->
<farLeg>
    <exchangedCurrency1>
        <payerPartyReference href="second"/>
        <receiverPartyReference href="first"/>
        <paymentAmount>
            <currency>USD</currency>
            <amount>130</amount>
        </paymentAmount>
    </exchangedCurrency1>
    <exchangedCurrency2>
        <payerPartyReference href="first"/>
        <receiverPartyReference href="second"/>
        <paymentAmount>
            <currency>EUR</currency>
            <amount>100</amount>
        </paymentAmount>
    </exchangedCurrency2>
    <dealtCurrency>ExchangedCurrency2</dealtCurrency>
    <tenorPeriod>
        <periodMultiplier>3</periodMultiplier>
        <period>D</period>
    </tenorPeriod>
    <valueDate>2012-12-17</valueDate>
    <exchangeRate>
        <quotedCurrencyPair>
            <currency1>USD</currency1>
            <currency2>EUR</currency2>
            <quoteBasis>Currency1PerCurrency2</quoteBasis>
        </quotedCurrencyPair>
        <rate>1.3</rate>
    </exchangeRate>
</farLeg>
</fxSwap>
<!-- Структура данных определяющая в рамках каких документов происходит регулирование сделки. -->
<documentation>
    <!-- Структура данных определяющая генеральное соглашение, в рамках которого совершена данная
сделка. -->
    <masterAgreement xsi:type="MasterAgreementExt">
        <!-- Тип генерального соглашения -->
        <masterAgreementType>NAUFOR</masterAgreementType>
        <!-- Версия генерального соглашения -->
        <masterAgreementVersion>2011</masterAgreementVersion>
        <!-- Дата, в которую было заключено генеральное соглашение. -->
        <masterAgreementDate>2012-05-04</masterAgreementDate>
        <!-- Уникальный идентификационный номер Генерального соглашения, присвоенный репозитарием.
-->
        <masterAgreementId>NONREF</masterAgreementId>
    </masterAgreement>
</documentation>
<!-- Специфичные требования регулятора -->
<nsdSpecificTradeFields>
    <dealStatus>O</dealStatus>
    <dfiCode>SVFWNNNNN</dfiCode>
    <relationCode>M</relationCode>
    <clearSettlType>OTC</clearSettlType>
    <clearSettlMethod>D</clearSettlMethod>
</nsdSpecificTradeFields>
</trade>

```

```
<!-- Первая сторона сделки. Атрибут id - уникальный в рамках данного сообщения
идентификатор участника, который используется для ссылок на него в других блоках сообщения. -->
<party id="first">
  <!-- Идентификатор участника. Тип идентификатора задаётся атрибутом partyIdScheme. Значение
  атрибута по умолчанию http://www.nsd.ru/repository/fpml-5.4/coding-schemes/partyid -->
  <partyId>RP0000000001</partyId>
  <!-- Наименование (имя) участника. -->
  <partyName>Сторона 1</partyName>
  <!-- Ссылка на сторону, играющую по отношению к данному участнику определённую роль. -->
</party>
<!-- Вторая сторона сделки. Комментарии ко внутренним узлам аналогичным комментариям для first -->
<party id="second">
  <!-- -->
  <partyId>RP0000000002</partyId>
  <!-- -->
  <partyName>Сторона 2</partyName>
  <!-- -->
</party>
</nonpublicExecutionReport>
  </originalMessage>
  </additionalData>
</nonpublicExecutionReportException>
```