

ПОРЯДОК РАСЧЕТА ОБОБЩЕННЫХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ НКО АО НРД

Оглавление

1. Термины и определения	2
2. Общие положения.....	2
3. Принципы расчета Обобщенных показателей.....	3
4. Особенности расчета обобщенных показателей по видам договоров	4
4.1. Валютный своп (fxSwap).....	4
4.2. Конверсионная сделка / валютный форвард (fxSingleLeg)	5
4.3. Валютный опцион (fxOption)	6
4.4. Валютный бинарный опцион (fxDigitalOption)	6
4.5. Соглашение о будущей процентной ставке (fra)	6
4.6. Процентный своп (swap)	7
4.7. Договор фиксации максимальной/минимальной процентной ставки (capFloor).....	8
4.8. Процентный свопцион (swaption)	8
4.9. Договор РЕПО (repo).....	9
4.10. Форвард на облигации (bondForward).....	10
4.11. Опцион на облигации (bondOption)	10
4.12. Опцион на корзину облигаций (basketBondOption)	10
4.13. Форвард на акции (equityForward)	11
4.14. Опцион на акции (equityOption).....	12
4.15. Товарный форвард (commodityForward)	13
4.16. Товарный опцион (commodityOption)	13
4.17. Товарный своп (commoditySwap).....	14
4.18. Товарный свопцион (commoditySwaption).....	16
4.19. Своп дохода на облигации (bondSwap).....	17
4.20. Своп дохода на акции (equitySwap)	18
4.21. Кредитный дефолтный своп (creditDefaultSwap).....	18
4.22. Кредитный свопцион (creditDefaultSwaption).....	18
4.23. Иные договоры (generalProduct).....	19
Приложение 1.....	20

1. Термины и определения

- 1.1. **Банк России** – Центральный банк Российской Федерации (Банк России).
- 1.2. **Обобщенные показатели** – показатели (количество договоров, общий размер обязательств из договоров каждого вида), основанные на внесенной в Реестр договоров информации и рассчитанные за Отчетный период в соответствии с Порядком.
- 1.3. **Отчет** – отчет по форме Приложения 1 к Порядку.
- 1.4. **Отчетный период** – календарный месяц, в котором были заключены договоры.
- 1.5. **Порядок** – настоящий Порядок расчета обобщенных показателей НКО АО НРД.
- 1.6. **Реестр договоров** – совокупность журналов (электронная база данных), предназначенных для учета договоров и информации, предоставленной в Репозиторий.
- 1.7. **Репозиторий** – Небанковская кредитная организация акционерное общество «Национальный расчетный депозитарий» (НКО АО НРД).
- 1.8. **Сайт** – официальные сайты Репозитария, размещенные в сети Интернет по адресам: www.nsd.ru и www.repository.nsd.ru.
- 1.9. **Указание** – Указание Банка России от 22.12.2017 № 4660-У «Об объеме и порядке раскрытия информации репозитарием».
- 1.10. Иные термины используются в значениях, установленных законодательством Российской Федерации, нормативными правовыми актами, нормативными актами Банка России, Договором ЭДО и Правилами осуществления репозитарной деятельности НКО АО НРД.

2. Общие положения

- 2.1. Порядок определяет правила расчета Обобщенных показателей и устанавливает процедуру и сроки их раскрытия Репозитарием. Порядок разработан в соответствии с требованиями Федерального закона от 22.04.1996 № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг» и Указанием.
- 2.2. Репозитарий осуществляет раскрытие информации путем ее размещения на Сайте в соответствии с требованиями законодательства Российской Федерации. Заинтересованные в получении раскрываемой информации лица самостоятельно отслеживают публикацию данной информации Репозитарием.
- 2.3. Раскрытие обобщенных показателей осуществляется с учетом мер по обеспечению конфиденциальности записей, составляющих реестр договоров, предусмотренных Указанием.

Если суммарное количество договоров, составляющих группу договоров, входящих в состав Обобщенных показателей по итогам Отчетного периода, не превышает 10 (десяти), то общий размер обязательств из таких договоров не раскрывается.
- 2.4. Обобщенные показатели, рассчитанные за Отчетный период, размещаются на Сайте в хронологическом порядке (с указанием даты их раскрытия) не позднее 8 (восьмого) рабочего дня месяца после окончания Отчетного периода.
- 2.5. Репозитарий не вносит изменения в размещенные на Сайте Обобщенные показатели в случае, если сведения о заключении договора или его изменении были внесены в Реестр договоров Репозитария после даты публикации Обобщенных показателей на Сайте. Обобщенные показатели публикуются в виде Отчета.
- 2.6. Доступ к раскрываемой информации предоставляется всем заинтересованным лицам круглосуточно (за исключением периодов проведения технических работ) без взимания платы и иных ограничений в течение не менее 3 (трех) лет с даты раскрытия указанной информации.

- 2.7. В случае возникновения причин, препятствующих доступу к Обобщенным показателям, Репозиторий в соответствии с внутренними документами, регламентирующими порядок действий сотрудников НРД при возникновении внештатных ситуаций, принимает меры, направленные на устранение таких причин и осуществляет информирование клиентов о причине, дате и времени прекращения (ограничения) доступа к Обобщенным показателям, а также о предполагаемой дате и времени его возобновления.
- 2.8. Репозиторий обязан уведомить об изменении Порядка не позднее, чем за 2 (два) месяца до даты их вступления в силу, если более короткий срок не обусловлен требованиями законодательства Российской Федерации и нормативными актами Банка России. Репозиторий уведомляет о внесении изменений в Порядок путем размещения указанных изменений на Сайте. Датой уведомления считается дата размещения изменений на Сайте. Заинтересованные лица обязаны самостоятельно проверять соответствующую информацию на Сайте, ответственность за получение указанной информации несет заинтересованное лицо.
- 2.9. Изменения в Порядок вносятся и публикуются на Сайте Репозитарием с соблюдением сроков и процедур, установленных нормативными актами Банка России.

3. Принципы расчета Обобщенных показателей

- 3.1. Обобщенные показатели рассчитываются в отношении договоров, сведения о которых внесены в раздел 2 Реестра договоров Репозитария за Отчетный период, в том числе в отношении договоров, расчеты по которым завершены.
- Если до формирования Отчета из Реестра договоров были исключены записи о договорах, заключенных в Отчетном периоде, такие договоры не учитываются в общем количестве договоров и в общем размере обязательств из договоров.
- 3.2. Совокупное количество заключенных договоров определяется как сумма количества договоров указанного вида.
- 3.3. Совокупный объем заключенных договоров определяется как сумма объемов договоров указанного вида.
- 3.4. Совокупный объем по виду договоров рассчитывается в рублевом эквиваленте, определенном по официальному курсу, установленному Банком России по дате заключения договоров.
- 3.5. Обобщенные показатели не рассчитываются по договорам, расчеты по которым осуществляются в валюте, для которой Банком России не установлен официальный курс.
- 3.6. Обобщенные показатели рассчитываются совокупно по следующим видам договоров, кроме договоров, в которых в качестве Кода классификации производных финансовых инструментов и договоров репо указано значение UKWN:

№	Группа Договоров	Вид договоров	Наименование формы	Код формы
1.	Договоры репо	Все виды договоров репо	repo, repoBulkReport	CM041 CM083
2.	Производные финансовые инструменты, базисным активом которых является наступление обстоятельства, являющегося кредитным событием	Все виды производных финансовых инструментов, базисным активом которых является наступление обстоятельства, являющегося кредитным событием	creditDefaultSwap, creditDefaultSwaption	CM071 CM072

№	Группа Договоров	Вид договоров	Наименование формы	Код формы
3.	Производные финансовые инструменты, базисным активом которых является валюта	Конверсионные договоры, форвардные договоры, валютные своп-договоры	fxSwap, fxSwapBulkReport, fxSingleLeg, fxSingleLegBulkReport	CM021 CM084 CM022 CM085
		Оptionные договоры	fxOption fxDigitalOption	CM023 CM024
4.	Производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются процентные ставки	Процентные своп-договоры, соглашения о будущей процентной ставке	fra, swap	CM031 CM032
		Оptionные договоры, включая договоры, базисным активом которых является максимальная и минимальная процентная ставка	capFloor, swaption	CM033 CM034
5.	Производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются ценные бумаги	Форвардные договоры, базисным активом которых являются облигации, форвардные договоры, базисным активом которых являются акции, своп-договоры на акции	bondForward, equityForward, bondSwap, equitySwap	CM043 CM047 CM061 CM062
		Оptionные договоры, базисным активом которых являются облигации (или корзина облигаций), опционнeые договоры, базисным активом которых являются акции	bondOption, basketBondOption, equityOption	CM044 CM045 CM048
6.	Производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются товары	Форвардные договоры, товарные своп-договоры	commodityForward, commoditySwap	CM051 CM053
		Оptionные договоры	commodityOption, commoditySwaption	CM052 CM054
7.	Иные договоры	Договоры, являющиеся производными финансовыми инструментами, содержащие условия, не предусмотренные указанными выше видами договоров	generalProduct	CM081

4. Особенности расчета обобщенных показателей по видам договоров

4.1. Валютный своп (fxSwap)

4.1.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора Валютный своп (fxSwap) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:fxSwap/fpml:nearLeg/fpml:exchangeCurrency/fpml:paymentAmount/fpml:currency nsdext:fxSwapBulkReport/nsdext:swaps/nsdext:swapDetails/nsdext:currencies – c1	Первоначальный платеж по валютному свопу / Валюта 1 / Сумма платежа / Валюта суммы	Валюта 1

2	fpml:fxSwap/fpml:nearLeg/fpml:exchangedCurrency1/fpml:paymentAmount/fpml:amount nsdext:fxSwapBulkReport/nsdext:swaps/ nsdext:swapDetails/nsdext:nearLeg – c1	Первоначальный платеж по валютному свопу / Валюта 1 / Сумма платежа / Сумма денежных средств	Сумма первоначального платежа в валюте 1
3	fpml:fxSwap/fpml:nearLeg/fpml:exchangedCurrency2/fpml:paymentAmount/fpml:currency nsdext:fxSwapBulkReport/nsdext:swaps/ nsdext:swapDetails/nsdext:currencies – c2	Первоначальный платеж по валютному свопу / Валюта 2 / Сумма платежа / Валюта суммы	Валюта 2
4	fpml:fxSwap/fpml:nearLeg/fpml:exchangedCurrency2/fpml:paymentAmount/fpml:amount nsdext:fxSwapBulkReport/nsdext:swaps/ nsdext:swapDetails/nsdext:nearLeg – c2	Первоначальный платеж по валютному свопу / Валюта 2 / Сумма платежа / Сумма денежных средств	Сумма первоначального платежа в валюте 2

4.1.2. В качестве объема договора используется значение исходного параметра «Сумма первоначального платежа в валюте 1» (п. 2) либо параметра «Сумма первоначального платежа в валюте 2» (п. 4) в зависимости от того, какая из валют – «Валюта 1» (п. 1) или «Валюта 2» (п. 3) – является российским рублем.

4.1.3. Если сумма первоначального платежа выражена в иностранной валюте, то выбирается «Сумма первоначального платежа в валюте 1» (п. 2) и переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора. Если для валюты 1 не установлен официальный курс Банка России, то выбирается «Сумма первоначального платежа в валюте 2» (п. 4) и переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России на дату заключения договора.

4.2. Конверсионная сделка / валютный форвард (fxSingleLeg)

4.2.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора Конверсионная сделка/ валютный форвард (fxSingleLeg) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:fxSingleLeg/fpml:exchangedCurrency1/ fpml:paymentAmount/fpml:currency nsdext:fxSingleLegBulkReport/nsdext:singleLegs/ nsdext:singleLegDetails/nsdext:currencies – c1	Валюта 1 / Сумма платежа / Валюта суммы	Валюта 1
2	fpml:fxSingleLeg/fpml:exchangedCurrency1/ fpml:paymentAmount/fpml:amount nsdext:fxSingleLegBulkReport/nsdext:singleLegs/ nsdext:singleLegDetails/nsdext:singleLeg – c1	Валюта 1 / Сумма платежа / Сумма денежных средств	Сумма платежа в валюте 1
3	fpml:fxSingleLeg/fpml:exchangedCurrency2/ fpml:paymentAmount/fpml:currency nsdext:fxSingleLegBulkReport/nsdext:singleLegs/ nsdext:singleLegDetails/nsdext:currencies – c2	Валюта 2 / Сумма платежа / Валюта суммы	Валюта 2
4	fpml:fxSingleLeg/fpml:exchangedCurrency2/ fpml:paymentAmount/fpml:amount nsdext:fxSingleLegBulkReport/nsdext:singleLegs/ nsdext:singleLegDetails/nsdext:singleLeg – c2	Валюта 2 / Сумма платежа / Сумма денежных средств	Сумма платежа в валюте 2

4.2.2. В качестве объема договора используется значение исходного параметра «Сумма первоначального платежа в валюте 1» (п. 2) либо параметра «Сумма первоначального платежа в валюте 2» (п. 4) в зависимости от того, какая из валют – «Валюта 1» (п. 1) или «Валюта 2» (п. 3) – является российским рублем.

4.2.3. Если сумма первоначального платежа выражена в иностранной валюте, то выбирается «Сумма первоначального платежа в валюте 1» (п. 2) и переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора. Если для валюты 1 не установлен официальный курс Банка России, то выбирается «Сумма первоначального платежа в валюте 2» (п. 4) и переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России на дату заключения договора.

4.3. Валютный опцион (fxOption)

4.3.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора Валютный опцион (fxOption) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:fxOption/fpml:putCurrencyAmount/ fpml:currency	Сумма валюты на продажу / Валюта суммы	Валюта на продажу
2	fpml:fxOption/fpml:putCurrencyAmount/ fpml:amount	Сумма валюты на продажу / Сумма денежных средств	Сумма в валюте на продажу
3	fpml:fxOption/fpml:callCurrencyAmount/ fpml:currency	Сумма валюты на покупку / Валюта суммы	Валюта на покупку
4	fpml:fxOption/fpml:callCurrencyAmount/ fpml:amount	Сумма валюты на покупку / Сумма денежных средств	Сумма в валюте на покупку

4.3.2. В качестве объема договора используется значение исходного параметра «Сумма в валюте на продажу» (п. 2) либо параметра «Сумма в валюте на покупку» (п. 4) в зависимости от того, какая из валют – «Валюта на продажу» (п. 1) или «Валюта на покупку» (п. 3) – является российским рублем.

4.3.3. Если «Сумма в валюте на продажу» и «Сумма в валюте на покупку» выражены в иностранной валюте, то выбирается «Сумма в валюте на продажу» (п. 2) и переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора. Если для валюты на продажу не установлен официальный курс Банка России, то выбирается «Сумма в валюте на покупку» (п. 4) и переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России на дату заключения договора.

4.4. Валютный бинарный опцион (fxDigitalOption)

4.4.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора Валютный бинарный опцион (fxDigitalOption) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:fxDigitalOption/fpml:payout / fpml:currency	Выплата по опциону / Валюта суммы	Валюта, в которой выражена сумма выплаты
2	fpml:fxDigitalOption/fpml:payout / fpml:amount	Выплата по опциону / Сумма денежных средств	Сумма выплаты по бинарному опциону

4.4.2. В качестве объема договора используется значение исходного параметра «Сумма денежных средств». Если сумма выплаты выражена в иностранной валюте, то указанное значение переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора.

4.5. Соглашение о будущей процентной ставке (fra)

4.5.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора Соглашение о будущей процентной ставке (fra) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:fra/fpml:notional/fpml:currency	Номинальная сумма / Валюта суммы	Валюта, в которой выражена номинальная сумма
2	fpml:fra/fpml:notional/fpml:amount	Номинальная сумма / Сумма	Номинальная сумма

4.5.2. В качестве объема договора используется значение исходного параметра «Номинальная сумма». Если сумма выплаты выражена в иностранной валюте, то указанное значение переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора.

4.6. Процентный своп (swap)

4.6.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора Процентный своп (swap) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:swap/fpml:swapStream[1]/fpml:calculationPeriodAmount/fpml:calculation/fpml:notionalSchedule/fpml:notionalStepSchedule/fpml:initialValue	Платежи по свопу / Сумма расчетного периода / Параметры расчета суммы / График номинальной суммы / График значений номинальной суммы / Начальное значение	Номинальная сумма
2	fpml:swap/fpml:swapStream[1]/fpml:calculationPeriodAmount/fpml:calculation/fpml:notionalSchedule/fpml:notionalStepSchedule/fpml:currency	Платежи по свопу / Сумма расчетного периода / Параметры расчета суммы / График номинальной суммы / График значений номинальной суммы / Валюта	Валюта номинальной суммы
3	fpml:swap/fpml:swapStream[1]/fpml:calculationPeriodAmount/fpml:calculation/fpml:fxLinkedNotionalSchedule/fpml:initialValue	Платежи по свопу / Сумма расчетного периода / Параметры расчета суммы / График номинальной суммы, привязанной к валютному курсу / Начальное значение номинальной суммы	Номинальная сумма, привязанная к валютному курсу
4	fpml:swap/fpml:swapStream[1]/fpml:calculationPeriodAmount/fpml:calculation/fpml:fxLinkedNotionalSchedule/fpml:varyingNotionalCurrency	Платежи по свопу / Сумма расчетного периода / Параметры расчета суммы / График номинальной суммы, привязанной к валютному курсу / Валюта переменной номинальной суммы	Валюта переменной номинальной суммы
5	fpml:swap/fpml:swapStream[1]/fpml:calculationPeriodAmount/fpml:knownAmountSchedule/fpml:initialValue	Платежи по свопу / Сумма расчетного периода / График известных сумм / Начальное значение	Фиксированная сумма
6	fpml:swap/fpml:swapStream[1]/fpml:calculationPeriodAmount/fpml:knownAmountSchedule/fpml:currency	Платежи по свопу / Сумма расчетного периода / График известных сумм / Начальное значение / Валюта суммы	Валюта фиксированной суммы

4.6.2. В качестве объема договора используется значение одного из альтернативных параметров по первой части свопа (обязательствам Стороны 1): «Номинальная сумма» (п. 1), «Номинальная сумма, привязанная к валютному курсу» (п. 3) или «Фиксированная сумма» (п. 5) – в зависимости от того, какая из сумм указана по первой части договора.

4.6.3. Если сумма, указанная в договоре, выражена в иностранной валюте («Валюта номинальной суммы» (п. 2), «Валюта переменной номинальной суммы» (п. 4) или

«Валюта фиксированной суммы» (п. 6) соответственно), то такая сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора.

4.7. Договор фиксации максимальной/минимальной процентной ставки (capFloor)

4.7.1. Для расчета Обобщенных показателей по Договору фиксации максимальной/минимальной процентной ставки (capFloor) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:capFloor/fpml:capFloorStream/ fpml:calculationPeriodAmount/ fpml:calculation/fpml:nominalSchedule/ fpml:nominalStepSchedule/fpml:initialValue	Платежи по сделке кэп/флор / Сумма расчетного периода / Параметры расчета суммы / График номинальной суммы / График значений номинальной суммы / Начальное значение	Номинальная сумма
2	fpml:capFloor/fpml:capFloorStream/ fpml:calculationPeriodAmount/ fpml:calculation/fpml:nominalSchedule/ fpml:nominalStepSchedule/fpml:currency	Платежи по сделке кэп/флор / Сумма расчетного периода / Параметры расчета суммы / График номинальной суммы / График значений номинальной суммы / Валюта	Валюта номинальной суммы
3	fpml:capFloor/fpml:capFloorStream/ fpml:calculationPeriodAmount/ fpml:calculation/fpml:fxLinkedNotionalSchedule/fpml:initialValue	Платежи по сделке кэп/флор / Сумма расчетного периода / Параметры расчета суммы / График номинальной суммы, привязанной к валютному курсу / Начальное значение номинальной суммы	Номинальная сумма, привязанная к валютному курсу
4	fpml:capFloor/fpml:capFloorStream/ fpml:calculationPeriodAmount/ fpml:calculation/fpml:fxLinkedNotionalSchedule/fpml:varyingNotionalCurrency	Платежи по сделке кэп/флор / Сумма расчетного периода / Параметры расчета суммы / График номинальной суммы, привязанной к валютному курсу / Валюта переменной номинальной суммы	Валюта переменной номинальной суммы

4.7.2. В качестве объема договора используется значение одного из альтернативных параметров: «Номинальная сумма» (п. 1) или «Номинальная сумма, привязанная к валютному курсу» (п. 3) – в зависимости от того, какая из сумм указана в договоре.

4.7.3. Если сумма, указанная в договоре, выражена в иностранной валюте («Валюта номинальной суммы» (п. 2) или «Валюта переменной номинальной суммы» (п. 4) соответственно), то такая сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора.

4.8. Процентный свопцион (swaption)

4.8.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора Процентный свопцион (swaption) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:swaption/fpml:swap/ fpml:swapStream[1]/ fpml:calculationPeriodAmount/fpml:calculation/fpml:nominalSchedule/fpml:nominalStepSchedule/fpml:initialValue	Платежи по свопу / Сумма расчетного периода / Параметры расчета суммы / График номинальной суммы / График значений номинальной суммы / Начальное значение	Номинальная сумма

2	fpml:swaption/fpml:swap/ fpml:swapStream[1]/ fpml:calculationPeriodAmount/ fpml:calculation/fpml:nominalSchedule/ fpml:nominalStepSchedule/fpml:currency	Платежи по свопу / Сумма расчетного периода / Параметры расчета суммы / График номинальной суммы / График значений номинальной суммы / Валюта	Валюта номинальной суммы
3	fpml:swaption/fpml:swap/ fpml:swapStream[1]/ fpml:calculationPeriodAmount/ fpml:calculation/fpml:fxLinkedNotionalSchedule/fpml:initialValue	Платежи по свопу / Сумма расчетного периода / Параметры расчета суммы / График номинальной суммы, привязанной к валютному курсу / Начальное значение номинальной суммы	Номинальная сумма, привязанная к валютному курсу
4	fpml:swaption/fpml:swap/ fpml:swapStream[1]/ fpml:calculationPeriodAmount/fpml:calculation/fpml:fxLinkedNotionalSchedule/ fpml:varyingNotionalCurrency	Платежи по свопу / Сумма расчетного периода / Параметры расчета суммы / График номинальной суммы, привязанной к валютному курсу / Валюта переменной номинальной суммы	Валюта переменной номинальной суммы
5	fpml:swaption/fpml:swap/ fpml:swapStream[1]/ fpml:calculationPeriodAmount/fpml:knownAmountSchedule/fpml:initialValue	Платежи по свопу / Сумма расчетного периода / График известных сумм / Начальное значение	Фиксированная сумма
6	fpml:swaption/fpml:swap/ fpml:swapStream[1]/ fpml:calculationPeriodAmount/ fpml:knownAmountSchedule/fpml:currency	Платежи по свопу / Сумма расчетного периода / График известных сумм / Начальное значение / Валюта суммы	Валюта фиксированной суммы

4.8.2. В качестве объема договора используется значение одного из альтернативных параметров по первой части базового свопа: «Номинальная сумма» (п. 1), «Номинальная сумма, привязанная к валютному курсу» (п. 3) или «Фиксированная сумма» (п. 5) – в зависимости от того, какая из сумм указана по первой части свопа.

4.8.3. Если сумма, указанная в договоре, выражена в иностранной валюте («Валюта номинальной суммы» (п. 2), «Валюта переменной номинальной суммы» (п. 4) или «Валюта фиксированной суммы» (п. 6) соответственно), то такая сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора.

4.9. Договор РЕПО (repo)

4.9.1. Для расчета Обобщенных показателей по Договору РЕПО (repo) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:repo/fpml:spotLeg/ fpml:settlementAmount/fpml:currency nsdext:repoBulkReport/nsdext:repos/ nsdext:repoDetails/nsdext:spot – c	Первая часть сделки репо / Сумма расчетов / Валюта суммы	Валюта суммы расчетов по первой части сделки репо
2	fpml:repo/fpml:spotLeg/ fpml:settlementAmount/fpml:amount nsdext:repoBulkReport/nsdext:repos/ nsdext:repoDetails/nsdext:spot – a	Первая часть сделки репо / Сумма расчетов / Сумма	Сумма расчетов по первой части сделки репо.

4.9.2. В качестве объема договора используется значение исходного параметра «Сумма расчетов по первой части сделки репо» (п. 2). Если «Валюта суммы расчетов по первой части сделки репо» (п. 1) является иностранной валютой, то сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора.

4.10. Форвард на облигации (bondForward)

4.10.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора Форвард на облигации (bondForward) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	nsdext:bondForward/nsdext:nominalAmount/ fpml:currency	Номинальная сумма / Валюта суммы	Валюта совокупной номинальной стоимости.
2	nsdext:bondForward/nsdext:nominalAmount/ fpml:amount	Номинальная сумма / Сумма	Совокупная номинальная стоимость договора ¹

4.10.2. В качестве объема договора используется значение исходного параметра «Совокупная номинальная стоимость договора» (п. 2). Если «Валюта совокупной номинальной стоимости» (п. 1) является иностранной валютой, то сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора.

4.11. Опцион на облигации (bondOption)

4.11.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора Опцион на облигации (bondOption) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:bondOption/ fpml:nominalAmount/ fpml:currency	Номинальная сумма / Валюта суммы	Валюта совокупной номинальной стоимости
2	fpml:bondOption/ fpml:nominalAmount/ fpml:amount	Номинальная сумма / Сумма	Совокупная номинальная стоимость договора ²

4.11.2. В качестве объема договора используется значение исходного параметра «Совокупная номинальная стоимость договора» (п. 2). Если «Валюта совокупной номинальной стоимости» (п. 1) является иностранной валютой, то сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора.

4.12. Опцион на корзину облигаций (basketBondOption)

4.12.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора Опцион на корзину облигаций (basketBondOption) используются следующие параметры:

¹ В данном поле указывается: в случае форварда на облигации – расчетная сумма, получаемая путем умножения количества облигаций по договору на начальную номинальную стоимость одной облигации; в случае форварда на корзину облигаций – расчетная сумма, получаемая путем умножения количества корзин по договору на начальную стоимость одной корзины; в случае форварда на индекс – расчетная сумма, получаемая путем умножения значения индекса на дату заключения договора в индексных пунктах на мультипликатор индекса (стоимость 1 пункта индекса в соответствии со спецификацией) либо совокупная стоимость договора на дату его заключения в соответствии с данными бухгалтерского учета.

² В соответствии с рекомендациями в данном поле указывается: в случае опциона на облигации – расчетная сумма, получаемая путем умножения количества опционов на количество облигаций в одном опционе и на начальную номинальную стоимость одной облигации; в случае опциона на индекс – расчетная сумма, получаемая путем умножения количества опционов на значение индекса на дату заключения договора в индексных пунктах и на мультипликатор индекса (стоимость 1 пункта индекса в соответствии со спецификацией) либо совокупная стоимость договора на дату его заключения в соответствии с данными бухгалтерского учета.

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	nsdext:bondBasketOption/ fpml:nominalAmount/fpml:currency	Номинальная сумма / Валюта суммы	Валюта совокупной номинальной стоимости
2	nsdext:bondBasketOption/ fpml:nominalAmount/fpml:amount	Номинальная сумма / Сумма	Совокупная номинальная стоимость договора ³

4.12.2. В качестве объема договора используется значение исходного параметра «Совокупная номинальная стоимость договора» (п. 2). Если «Валюта совокупной номинальной стоимости» (п. 1) является иностранной валютой, то сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора.

4.13. Форвард на акции (equityForward)

4.13.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора Форвард на акции (equityForward) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:equityForward/ fpml:underlyer/fpml:singleUnderlyer/fpml:openUnits	Базовый актив / Единичный базовый актив / Лот актива	Количество акций
2	fpml:equityForward/fpml:underlyer/ fpml:basket/fpml:openUnits	Базовый актив / Корзина / Число единиц активов	Количество корзин
3	fpml:equityForward/ fpml:forwardPrice/fpml:currency	Форвардная цена / Валюта суммы	Валюта форвардной цены
4	fpml:equityForward/ fpml:forwardPrice/fpml:amount	Форвардная цена / Сумма	Форвардная цена за единицу базового актива
5	Расчетный параметр	Расчетный параметр	Общая стоимость акций Рассчитывается как произведение количества акций (п. 1) и цены за единицу базового актива (п. 4)
6	Расчетный параметр	Расчетный параметр	Общая стоимость корзин. Рассчитывается как произведение количества корзин (п. 2) и цены за единицу базового актива (п. 4)

4.13.2. В качестве объема договора используется значение одного из альтернативных расчетных параметров: «Общая стоимость акций» (п. 5) или «Общая стоимость корзин» (п. 6) – в зависимости от того, какой из параметров – «Количество акций» (п. 1) или «Количество корзин» (п. 2) – указан в договоре.

4.13.3. Если «Валюта форвардной цены» является иностранной валютой, то сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора.

³ В соответствии с рекомендациями в данном поле указывается: в случае опциона на корзину облигаций – расчетная сумма, получаемая путем умножения количества опционов на количество корзин и на начальную стоимость одной корзины; в случае опциона на корзину индексов – расчетная сумма, получаемая путем умножения количества опционов на значение индекса на дату заключения договора в индексных пунктах и на мультипликатор индекса (стоимость 1 пункта индекса в соответствии со спецификацией) либо совокупная стоимость договора на дату его заключения в соответствии с данными бухгалтерского учета.

4.14. Опцион на акции (equityOption)

4.14.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора Опцион на акции (equityOption) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:equityOption/fpml:underlyer / fpml:singleUnderlyer/fpml:openUnits	Базовый актив / Единичный базовый актив / Лот актива	Количество акций
2	fpml:equityOption/fpml:underlyer / fpml:basket/fpml:openUnits	Базовый актив / Корзина / Число единиц активов	Количество корзин
3	fpml:equityOption/fpml:strike/ fpml:currency	Цена исполнения / Валюта	Валюта цены исполнения
4	fpml:equityOption/fpml:strike/ fpml:strikePrice	Цена исполнения / Цена исполнения	Цена исполнения за единицу базового актива
5	fpml:equityOption/fpml:notional	Номинальная сумма	Номинальная сумма договора
6	fpml:equityOption/fpml:feature/fpml:knock/fpml:knockIn/fpml:featurePayment/fpml:amount	Сумма платежа	Сумма платежа по бинарному опциону
7	fpml:equityOption/fpml:feature/fpml:knock/fpml:knockIn/fpml:featurePayment/fpml:currency	Валюта суммы	Валюта суммы выплаты
8	fpml:equityOption/fpml:feature/fpml:knock/fpml:knockOut/fpml:featurePayment/fpml:amount	Сумма платежа	Сумма платежа по бинарному опциону
9	fpml:equityOption/fpml:feature/fpml:knock/fpml:knockOut/fpml:featurePayment/fpml:currency	Валюта суммы	Валюта суммы выплаты
10	Расчетный параметр	Расчетный параметр	Общая стоимость акций. Рассчитывается как произведение количества акций (п. 1) и цены исполнения за единицу базового актива (п. 4)
11	Расчетный параметр	Расчетный параметр	Общая стоимость корзин. Рассчитывается как произведение количества корзин (п. 2) и цены исполнения за единицу базового актива (п. 4)
12	Расчетный параметр	Расчетный параметр	Номинальная сумма договора (п. 5)
13	Расчетный параметр	Расчетный параметр	Сумма выплаты по барьерному (бинарному) опциону (п. 6 или п. 8)

4.14.2. В качестве объема договора используется значение одного из альтернативных расчетных параметров: «Общая стоимость акций» (п. 10) или «Общая стоимость корзин» (п. 11) или Номинальная сумма договора (п. 12) или Сумма выплаты по барьерному (бинарному) опциону (п. 13) – в зависимости от того, какой из параметров – «Количество акций» (п. 1) или «Количество корзин» (п. 2) или Сумма платежа (п. 6, п. 7) указан в договоре. Приоритет расчета объема договора, исходя из наличия указанных значений в договоре, отдается Сумме выплаты (п. 13), затем Номинальной стоимости (п. 12), и далее Общей стоимости акций (п. 10) или Общей стоимости корзин (п. 11).

4.14.3. Если «Валюта цены исполнения» является иностранной валютой, то «Общая стоимость акций/корзин» переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора.

4.15. Товарный форвард (commodityForward)

4.15.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора Товарный форвард (commodityForward) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:commodityForward/fpml:fixedLeg/fpml:totalPrice/fpml:currency	Общая сумма / Валюта суммы	Валюта суммы фиксированного платежа по договору
2	fpml:commodityForward/fpml:fixedLeg/fpml:totalPrice/fpml:amount	Общая сумма / Сумма денежных средств	Сумма фиксированного платежа по договору

4.15.2. В качестве объема договора используется значение параметра «Сумма фиксированного платежа по договору» (п. 2). Если «Валюта суммы фиксированного платежа по договору» (п. 1) является иностранной валютой, то сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора.

4.16. Товарный опцион (commodityOption)

4.16.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора Товарный опцион (commodityOption) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:commodityOption/fpml:totalNotionalQuantity	Общее номинальное количество	Общее номинальное количество базового актива
2	fpml:commodityOption/fpml:strikePricePerUnit/fpml:amount	Цена страйк на единицу товара / Сумма денежных средств	Цена исполнения за единицу измерения базового актива
3	fpml:commodityOption/fpml:strikePricePerUnit/fpml:currency	Цена страйк на единицу товара / Валюта суммы	Валюта цены исполнения
4	fpml:commodityOption/fpml:weatherNotionalAmount/fpml:currency	Номинальная сумма погодного контракта / Валюта суммы	Валюта номинальной суммы погодного опциона
5	fpml:commodityOption/fpml:weatherNotionalAmount/fpml:amount	Номинальная сумма погодного контракта / Сумма денежных средств	Номинальная сумма погодного опциона
6	fpml:commodityOption/fpml:weatherIndexStrikeLevel/fpml:quantity	Уровень страйк погодного индекса / Количество пунктов	Цена исполнения погодного опциона (количество пунктов погодного индекса)
7	fpml:commodityOption/fpml:feature/fpml:knock/fpml:knockIn/fpml:featurePayment/fpml:amount	Сумма платежа	Сумма платежа по бинарному опциону
8	fpml:commodityOption/fpml:feature/fpml:knock/fpml:knockIn/fpml:featurePayment/fpml:currency	Валюта суммы	Валюта суммы выплаты
9	fpml:commodityOption/fpml:feature/fpml:knock/fpml:knockOut/fpml:featurePayment/fpml:amount	Сумма платежа	Сумма платежа по бинарному опциону

10	fpml:commodityOption/fpml:feature/fpml:knock/fpml:knockOut/fpml:featurePayment/fpml:currency	Валюта суммы	Валюта суммы выплаты
11	Расчетный параметр	Расчетный параметр	Общая стоимость товарного опциона. Рассчитывается как произведение общего номинального количества (п. 1) и цены исполнения за единицу измерения базового актива (п. 2)
12	Расчетный параметр	Расчетный параметр	Общая стоимость погодного опциона. Рассчитывается как произведение номинальной суммы погодного опциона (п. 5) и цены исполнения погодного опциона (п. 6)
13	Расчетный параметр	Расчетный параметр	Сумма выплаты по барьерному (бинарному) опциону (п.7 или п.9)

4.16.2. В качестве объема договора используется значение расчетного параметра «Общая стоимость товарного опциона» (п. 11) либо расчетного параметра «Общая стоимость погодного опциона» (п. 12), либо расчетного параметра «Суммы выплаты по барьерному (бинарному) опциону» – в зависимости от того, какой из параметров – «Общее номинальное количество базового актива» (п. 1) или «Номинальная сумма погодного опциона» (п. 5) или «Сумма платежа» – указан в договоре. Приоритет расчета объема договора, исходя из наличия указанных значений в договоре, отдается Сумме выплаты (п.13), затем Общей стоимости товарного опциона (п.11) и Общей стоимости погодного опциона (п.12).

4.16.3. Если значение выбранного расчетного параметра выражено в иностранной валюте («Валюта цены исполнения» (п. 3) или «Валюта номинальной суммы погодного опциона» (п. 4) соответственно), то такое значение переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора.

4.17. Товарный своп (commoditySwap)

4.17.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора Товарный своп (commoditySwap) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:commoditySwap/nsdext:floatingLegNsd[1]/fpml:commodity/fpml:currency	Часть сделки с плавающей ценой / Товар / Валюта товарного актива	Валюта, в которой выражена цена товара [1]
2	fpml:commoditySwap/nsdext:floatingLegNsd[1]/fpml:totalNotionalQuantity	Часть сделки с плавающей ценой / Совокупное номинальное количество	Совокупное номинальное количество товара [1]
3	fpml:commoditySwap/nsdext:floatingLegNsd[1]/nsdext:initialPrice	Часть сделки с плавающей ценой / Первоначальная цена единицы товарного актива	Первоначальная цена единицы товара [1]
4	fpml:commoditySwap/nsdext:floatingLegNsd[2]/fpml:commodity/fpml:currency	Часть сделки с плавающей ценой / Товар / Валюта товарного актива	Валюта, в которой выражена цена товара [2]

5	fpml:commoditySwap/ nsdext:floatingLegNsd[2]/ fpml:totalNotionalQuantity	Часть сделки с плавающей ценой / Совокупное номинальное количество	Совокупное номинальное количество товара [2]
6	fpml:commoditySwap/ nsdext:floatingLegNsd[2]/ nsdext:initialPrice	Часть сделки с плавающей ценой / Первоначальная цена единицы товарного актива	Первоначальная цена единицы товара [2]
7	fpml:commoditySwap/ fpml:weatherLeg[1]/ fpml:weatherNotionalAmount/ fpml:currency	Поток по сделке погодного свопа / Номинальная сумма погодного контракта / Валюта суммы	Валюта номинальной суммы погодного свопа
8	fpml:commoditySwap/ fpml:weatherLeg[1]/ fpml:weatherNotionalAmount/ fpml:amount	Поток по сделке погодного свопа / Номинальная сумма погодного контракта / Сумма денежных средств	Номинальная сумма погодного свопа
9	fpml:commoditySwap/ fpml:weatherLeg[1]/ fpml:weatherIndexLevel/fpml:q uantity	Поток по сделке погодного свопа / Уровень погодного индекса / Количество пунктов	Количество пунктов погодного индекса
10	fpml:commoditySwap/fpml:fixe dLeg/ fpml:totalPrice/fpml:amount	Часть сделки с фиксированной ценой / Итоговая цена / Сумма денежных средств	Общая сумма фиксированных платежей
11	fpml:commoditySwap/fpml:fixe dLeg/ fpml:totalPrice/fpml:currency	Часть сделки с фиксированной ценой / Итоговая цена / Валюта суммы	Валюта, в которой выражена сумма фиксированных платежей
12	Расчетный параметр	Расчетный параметр	Объем по первой части сделки с плавающей ценой. Рассчитывается как произведение совокупного номинального количества товара (п. 2) и первоначальной цены единицы товара (п. 3)
13	Расчетный параметр	Расчетный параметр	Объем по второй части сделки с плавающей ценой. Рассчитывается как произведение совокупного номинального количества товара (п. 5) и первоначальной цены единицы товара (п. 6)
14	Расчетный параметр	Расчетный параметр	Объем погодного свопа. Рассчитывается как произведение номинальной суммы погодного свопа (п. 8) и количества пунктов погодного индекса (п. 9)

4.17.2. В качестве объема договора используется значение расчетного параметра «Объем по первой части сделки с плавающей ценой» (п. 12). Если значение данного параметра отсутствует, используется значение расчетного параметра «Объем по второй части сделки с плавающей ценой» (п. 13). Если оба значения отсутствуют (в случае поставочного товарного свопа или погодного свопа), в качестве объема договора используется значение исходного параметра «Общая сумма фиксированных платежей» (п. 10) либо расчетного параметра «Объем погодного свопа» (п. 14) в зависимости от

того, какой из параметров указан в договоре: «Общая сумма фиксированных платежей» (п. 10) или «Номинальная сумма погодного свопа» (п. 8).

- 4.17.3. Если значение выбранного расчетного параметра выражено в иностранной валюте («Валюта, в которой выражена цена товара [1]» (п. 1), «Валюта, в которой выражена цена товара [2]» (п. 4), «Валюта, в которой выражена сумма фиксированных платежей» (п. 11) или «Валюта номинальной суммы погодного свопа» (п. 7) соответственно), то такое значение переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора.

4.18. Товарный свопцион (commoditySwaption)

- 4.18.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора Товарный свопцион (commoditySwaption) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:commoditySwap/ nsdext:floatingLegNsd[1]/ fpml:commodity/fpml:currency	Часть сделки с плавающей ценой / Товар / Валюта товарного актива	Валюта, в которой выражена цена товара [1]
2	fpml:commoditySwap/ nsdext:floatingLegNsd[1]/ fpml:totalNotionalQuantity	Часть сделки с плавающей ценой / Совокупное номинальное количество	Совокупное номинальное количество товара [1]
3	fpml:commoditySwap/ nsdext:floatingLegNsd[1]/ nsdext:initialPrice	Часть сделки с плавающей ценой / Первоначальная цена единицы товарного актива	Первоначальная цена единицы товара [1]
4	fpml:commoditySwap/ nsdext:floatingLegNsd[2]/ fpml:commodity/fpml:currency	Часть сделки с плавающей ценой / Товар / Валюта товарного актива	Валюта, в которой выражена цена товара [2]
5	fpml:commoditySwap/ nsdext:floatingLegNsd[2]/ fpml:totalNotionalQuantity	Часть сделки с плавающей ценой / Совокупное номинальное количество	Совокупное номинальное количество товара [2]
6	fpml:commoditySwap/ nsdext:floatingLegNsd[2]/ nsdext:initialPrice	Часть сделки с плавающей ценой / Первоначальная цена единицы товарного актива	Первоначальная цена единицы товара [2]
7	fpml:commoditySwap/ fpml:weatherLeg[1]/ fpml:weatherNotionalAmount/ fpml:currency	Поток по сделке погодного свопа / Номинальная сумма погодного контракта / Валюта суммы	Валюта номинальной суммы погодного свопа
8	fpml:commoditySwap/ fpml:weatherLeg[1]/ fpml:weatherNotionalAmount/ fpml:amount	Поток по сделке погодного свопа / Номинальная сумма погодного контракта / Сумма денежных средств	Номинальная сумма погодного свопа
9	fpml:commoditySwap/ fpml:weatherLeg[1]/ fpml:weatherIndexLevel/fpml:quantity	Поток по сделке погодного свопа / Уровень погодного индекса / Количество пунктов	Количество пунктов погодного индекса
10	fpml:commoditySwap/fpml:fixedLeg/ fpml:totalPrice/fpml:amount	Часть сделки с фиксированной ценой / Итоговая цена / Сумма денежных средств	Общая сумма фиксированных платежей
11	fpml:commoditySwap/fpml:fixedLeg/ fpml:totalPrice/fpml:currency	Часть сделки с фиксированной ценой / Итоговая цена / Валюта суммы	Валюта, в которой выражена сумма фиксированных платежей
12	Расчетный параметр	Расчетный параметр	Объем по первой части сделки с плавающей ценой. Рассчитывается как

			произведение совокупного номинального количества товара (п. 2) и первоначальной цены единицы товара (п. 3)
13	Расчетный параметр	Расчетный параметр	Объем по второй части сделки с плавающей ценой. Рассчитывается как произведение совокупного номинального количества товара (п. 5) и первоначальной цены единицы товара (п. 6)
14	Расчетный параметр	Расчетный параметр	Объем погодного свопа. Рассчитывается как произведение номинальной суммы погодного свопа (п. 8) и количества пунктов погодного индекса (п. 9)

4.18.2. В качестве объема договора используется значение расчетного параметра «Объем по первой части сделки с плавающей ценой» (п. 12). Если значение данного параметра отсутствует, используется значение расчетного параметра «Объем по второй части сделки с плавающей ценой» (п. 13). Если оба значения отсутствуют (в случае поставочного товарного свопа или погодного свопа), то в качестве объема договора используется значение исходного параметра «Общая сумма фиксированных платежей» (п. 10) либо расчетного параметра «Объем погодного свопа» (п. 14) в зависимости от того, какой из параметров указан в договоре: «Общая сумма фиксированных платежей» (п. 10) или «Номинальная сумма погодного свопа» (п. 8).

4.18.3. Если значение выбранного расчетного параметра выражено в иностранной валюте («Валюта, в которой выражена цена товара [1]» (п. 1), «Валюта, в которой выражена цена товара [2]» (п. 4), «Валюта, в которой выражена сумма фиксированных платежей» (п. 11) или «Валюта номинальной суммы погодного свопа» (п. 7) соответственно), то такое значение переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора.

4.19. Своп дохода на облигации (bondSwap)

4.19.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора Своп дохода на облигации (bondSwap) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	nsdext:bondSwap/fpml:interestLeg/fpml:notional/fpml:notionalAmount/fpml:currency	Суммы фиксированного дохода / Номинальная сумма / Номинальная сумма / Валюта суммы	Валюта номинальной суммы
2	nsdext:bondSwap/fpml:interestLeg/fpml:notional/fpml:notionalAmount/fpml:amount	Суммы фиксированного дохода / Номинальная сумма / Номинальная сумма / Сумма денежных средств	Номинальная сумма
3	nsdext:bondSwap/nsdext:bondReturnLeg[1]/nsdext:notionalAmount/fpml:currency	Суммы дохода от облигации / Номинальная сумма / Валюта суммы	Валюта номинальной суммы
4	nsdext:bondSwap/nsdext:bondReturnLeg[1]/nsdext:notionalAmount/fpml:amount	Суммы дохода от облигации / Номинальная сумма / Сумма	Номинальная сумма (вариант выбора «Суммы дохода от облигации»)

- 4.19.2. В качестве объема договора используется значение параметра «Номинальная сумма» (п. 2). Если данный параметр отсутствует, используется значение параметра «Номинальная сумма (вариант выбора «Суммы дохода от облигации»» (п. 4).
- 4.19.3. Если сумма, указанная в договоре, выражена в иностранной валюте («Валюта номинальной суммы» (п. 1 или п. 3) соответственно), то такая сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора.

4.20. Своп дохода на акции (equitySwap)

- 4.20.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора Своп дохода на акции (equitySwap) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:equitySwapTransactionSupplement/fpml:interestLeg/fpml:notional/fpml:notionalAmount/fpml:currency	Суммы фиксированного дохода / Номинальная сумма / Номинальная сумма / Валюта суммы	Валюта номинальной суммы
2	fpml:equitySwapTransactionSupplement/fpml:interestLeg/fpml:notional/fpml:notionalAmount/fpml:amount	Суммы фиксированного дохода / Номинальная сумма / Номинальная сумма / Сумма денежных средств	Номинальная сумма
3	fpml:equitySwapTransactionSupplement/fpml:returnLeg[1]/fpml:notional/fpml:notionalAmount/fpml:currency	Суммы дохода от актива / Номинальная сумма / Валюта суммы	Валюта номинальной суммы
4	fpml:equitySwapTransactionSupplement/fpml:returnLeg[1]/fpml:notional/fpml:notionalAmount/fpml:amount	Суммы дохода от актива / Номинальная сумма / Сумма денежных средств	Номинальная сумма (вариант выбора «Суммы дохода от актива»)

- 4.20.2. В качестве объема договора используется значение параметра «Номинальная сумма» (п. 2). Если данный параметр отсутствует, используется значение параметра «Номинальная сумма (вариант выбора «Суммы дохода от актива»» (п. 4).
- 4.20.3. Если сумма, указанная в договоре, выражена в иностранной валюте («Валюта номинальной суммы» (п. 1 или п. 3) соответственно), то такая сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора.

4.21. Кредитный дефолтный своп (creditDefaultSwap)

- 4.21.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора Кредитный дефолтный своп (creditDefaultSwap) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:creditDefaultSwap/fpml:protectionTerms/fpml:calculationAmount/fpml:currency	Условия защиты / Расчетная сумма / Валюта суммы	Валюта номинальной суммы
2	fpml:creditDefaultSwap/fpml:protectionTerms/fpml:calculationAmount/fpml:amount	Условия защиты / Расчетная сумма / Сумма	Номинальная сумма

- 4.21.2. В качестве объема договора используется значение параметра «Номинальная сумма». Если «Валюта номинальной суммы» является иностранной валютой, то сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора.

4.22. Кредитный свопцион (creditDefaultSwaption)

4.22.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора Кредитный свопцион (creditDefaultSwaption) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:creditDefaultSwapOption/ fpml:creditDefaultSwap/fpml:protectionTerms /fpml:calculationAmount/ fpml:currency	Условия защиты / Расчетная сумма / Валюта суммы	Валюта номинальной суммы
2	fpml:creditDefaultSwapOption/ fpml:creditDefaultSwap/fpml:protectionTerms /fpml:calculationAmount/ fpml:amount	Условия защиты / Расчетная сумма / Сумма	Номинальная сумма

4.22.2. В качестве объема договора используется значение параметра «Номинальная сумма». Если «Валюта номинальной суммы» является иностранной валютой, то сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора.

4.23. Иные договоры (generalProduct)

4.23.1. Для расчета Обобщенных показателей по виду договора «Иные договоры» (generalProduct) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	nsdext:generalProduct/nsdext:party1Obligatio ns/nsdext:nominalAmount/fpml:currency	Валюта суммы обязательств	Валюта суммы обязательств по договору Стороны1
2	nsdext:generalProduct/nsdext:party1Obligatio ns/nsdext:nominalAmount/fpml:amount	Сумма обязательств	Сумма обязательств по договору Стороны1
3	nsdext:generalProduct/nsdext:party2Obligatio ns/nsdext:nominalAmount/fpml:currency	Валюта суммы обязательств	Валюта суммы обязательств по договору Стороны2
4	nsdext:generalProduct/nsdext:party2Obligatio ns/nsdext:nominalAmount/fpml:amount	Сумма обязательств	Сумма обязательств по договору Стороны2

4.23.2. В качестве объема договора используется:

- если «Валюта суммы обязательств» для обеих Сторон выражена в российских рублях – большее значение суммы параметров «Сумма обязательств» Стороны1 или «Сумма обязательств» Стороны2;
- если «Валюта суммы обязательств» одной из Сторон выражена в российских рублях, а другой Стороны в иностранной валюте – значение «Сумма обязательств» той стороны, чья «Валюта суммы обязательств» выражена в российских рублях;
- если «Валюта суммы обязательств» для обеих Сторон выражена в иностранной валюте/частично в иностранной валюте – соответствующая сумма иностранной валюты переводится в российские рубли по официальному курсу Банка России, установленному на дату заключения договора, при этом выбирается большее значение суммы параметров «Сумма обязательств» Стороны1 или «Сумма обязательств» Стороны2.

Приложение 1

к Порядку расчета обобщенных показателей НКО АО НРД

Обобщенные показатели Репозитария НКО АО НРД

за период с _____ по _____⁴
(период предоставления)

№	Виды договоров	Количество внесенных в реестр договоров	Объем внесенных в реестр договоров, тыс. руб.
1. Группа договоров «Договоры РЕПО»			
1.1.	Все виды договоров РЕПО (repo, repoBulkReport)		
2. Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых является наступление обстоятельства, являющегося кредитным событием»			
2.1.	Все виды производных финансовых инструментов, базисным активом которых является наступление обстоятельства, являющегося кредитным событием (creditDefaultSwap, creditDefaultSwaption)		
3. Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых является валюта»			
3.1.	Конверсионные договоры, форвардные договоры, валютные своп-договоры (fxSwap, fxSingleLeg, fxSwapBulkReport, fxSingleLegBulkReport)		
3.2.	Опционные договоры (fxOption, fxDigitalOption)		
4. Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются процентные ставки»			
4.1.	Процентные своп-договоры, соглашения о будущей процентной ставке (fra, swap)		
4.2.	Опционные договоры, включая договоры, базисным активом которых является максимальная и минимальная процентная ставка (capFloor, swaption)		
5. Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются ценные бумаги»			
5.1.	Форвардные договоры, базисным активом которых являются облигации, форвардные договоры, базисным активом которых являются акции, своп-договоры на акции (bondForward, equityForward, bondSwap, equitySwap)		
5.2.	Опционные договоры, базисным активом которых являются облигации (или корзина облигаций), опционные договоры, базисным активом которых являются акции (bondOption, basketBondOption, equityOption)		
6. Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются товары»			
6.1.	Форвардные договоры, товарные своп-договоры (commodityForward, commoditySwap)		
6.2.	Опционные договоры (commodityOption, commoditySwaption)		
7. Группа договоров «Иные договоры»			
7.1.	Иные договоры		

⁴ Даты периода указываются в формате DD.MM.YYYY