



**НАЦИОНАЛЬНЫЙ  
РАСЧЕТНЫЙ  
ДЕПОЗИТАРИЙ**  
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

## **Репозиторий НКО АО НРД**

**Рекомендации по заполнению отчетных форм  
в WEB-кабинете Репозитария**

## Содержание

I.	Общие параметры сообщения.....	3
II.	Особые параметры сделки.....	9
III.	Обеспечение по сделке. ....	16
IV.	Экономические параметры сделки. ....	17
1.	Анкета валютного свопа (СМ021). ....	17
2.	Анкета конверсионной сделки (валютного форварда) (СМ022). ....	21
3.	Анкета валютного опциона (СМ023). ....	23
4.	Анкета бинарного валютного опциона (СМ024). ....	27
5.	Анкета соглашения о будущей процентной ставке (СМ031).....	30
6.	Анкета процентного свопа (СМ032). ....	32
7.	Анкета договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки (СМ033).....	38
8.	Анкета свопциона (СМ034).....	43
9.	Анкета договора РЕПО (СМ041). ....	45
10.	Анкета договора купли-продажи облигации (СМ042). ....	52
11.	Анкета форварда на облигацию или индекс (СМ043). ....	54
12.	Анкета опциона на облигацию (СМ044). ....	59
13.	Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (СМ045). ....	64
14.	Анкета договора купли-продажи акции (СМ046). ....	67
15.	Анкета форварда на акцию (СМ047). ....	68
16.	Анкета опциона на акцию (СМ048). ....	71
17.	Анкета свопа дохода на облигацию (СМ061). ....	78
18.	Анкета свопа дохода на акцию (СМ062). ....	84
19.	Анкета товарного форварда (СМ051). ....	91
20.	Анкета товарного опциона (СМ052). ....	94
21.	Анкета товарного свопа (СМ053). ....	100
22.	Анкета товарного свопциона (СМ054). ....	106
23.	Анкета кредитного дефолтного свопа (СМ071). ....	107
24.	Анкета кредитного дефолтного свопциона (СМ072). ....	115
25.	Анкета иной сделки (СМ081). ....	119
V.	Отчет об уплате маржевых сумм (СМ092). ....	122
VI.	Отчет о расчете справедливой (оценочной) стоимости (СМ094). ....	125
VII.	Анкета договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств (СМ015).....	128
VIII.	Анкета о состоянии обязательств по договорам (СМ093). ....	130
IX.	Анкета генерального соглашения (СМ010). ....	131
X.	Заявление о назначении Информировующих лиц (СМ016). ....	132
XI.	Заявление об отказе от функций Информировующего лица (СМ017). ....	138
XII.	Заявление на подключение/отключение сервиса форматно-логического контроля (СМ018).....	139
XIII.	Правила формирования сообщений в bulk-формате (СМ083, СМ084, СМ085) ....	140

## I. Общие параметры сообщения.

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

### 1. Договор заключен вне рамок Генерального соглашения.

Заполняется в Анкете договора.

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

### 2. Номер генерального соглашения.

Заполняется в Анкете договора.

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

### 3. Номер CSA репозитория.

Заполняется в Анкете договора.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Регистрационный номер договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств</b> <partyReference href="TradeRepository"/> <originatingTradeId> <tradeId>	Идентификационный код, присвоенный Репозитарием в соответствии с Извещением о регистрации (RM001) Анкеты договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств (СМ015). <i>Не заполняется</i> , если Анкета договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств (СМ015) не зарегистрирована.	sfr	Например, CSA1234567890

<sup>1</sup> Подробные правила присвоения идентификаторов см. в [Инструкции по заполнению идентификаторов анкеты](#) и [Инструкции по заполнению блока <party> и идентификаторов участников](#).

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

#### 4. Сторона 1.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Идентификационный код</b> <sup>3</sup> <party id="Party1"> <partyId>	<p>Репозитарный код Стороны 1 в соответствии со Справочником участников Репозитария (столбец «Идентификационный код / Identification Code»). Если Сторона 1 не является клиентом Репозитария НРД, указывается «NONREF».</p> <p>Сторона 1 и Сторона 2 определяются так же, как они указаны в Анкете генерального соглашения (СМ010), в рамках которого заключен договор. Если договор заключен вне рамок генерального соглашения, контрагентам необходимо заранее согласовать порядок указания сторон между собой.</p> <p>Не допускается изменение значения данного параметра в сообщении о внесении изменений в зарегистрированную Анкету договора.<sup>4</sup></p>	mfr	Значение из справочника <a href="https://www.nsd.ru/ru/services/repository/participants">https://www.nsd.ru/ru/services/repository/participants</a>
<b>Наименование участника</b> <party id="Party1"> <partyName>	<p>Наименование Стороны 1. Для клиентов Репозитария НРД указывается «Краткое наименование» в соответствии со Справочником участников Репозитария. Квитовка русского и английского наименований обеспечивается, если они указаны из Справочника участников Репозитария. Значение «NONREF» не допускается.</p> <p>Для физических лиц указывается фамилия, имя и отчество (при наличии) на русском или английском языке.</p>	mfr	

#### 5. LEI/SWIFT/INN стороны 1.

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

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

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

## 6. Классификация стороны 1.

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

## 7. Страна стороны 1.

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

## 8. Тип организации стороны 1.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Тип лица</b> <party id="Party1"> <organizationType>	<p>Тип Стороны 1. Допустимые значения: "P" – физическое лицо, "L" – юридическое лицо.</p>	sfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/organization-type(nsdрус)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/organization-type(nsdрус)</a>

## 9. Номер договора в системе учёта первой стороны.

Заполняется в Анкете договора и Анкете генерального соглашения.

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

## 10. Номер CSA стороны 1.

Заполняется в Анкете договора.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Регистрационный номер договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств</b> <partyReference href="Party1"/> <originatingTradeId> <tradeId>	<p>Указывается идентификатор договора о порядке уплаты маржевых сумм, присвоенный Стороной 1.</p> <p>Если для одной из сторон данный идентификатор включен в сообщение, для второй стороны он указывается обязательно, при этом допускается значение "NONREF". Для собственного номера, присвоенного Стороной 1, значение "NONREF" не допускается.</p> <p>Если зарегистрирована Анкета договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств (СМ015), указывается идентификатор, присвоенный Стороной 1 в соответствии с данной Анкетой.</p> <p><i>Не заполняется</i>, если договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм не заключен.</p>	sfr	Цифры и буквы латинского алфавита, не более 35 символов.

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

## 11. Сторона 2.

## 12. LEI/SWIFT/INN стороны 2.

## 13. Классификация стороны 2.

## 14. Страна стороны 2.

## 15. Тип организации стороны 2.

## 16. Номер договора в системе учёта второй стороны.

## 17. Номер CSA стороны 2.

## 18. Отправитель. LEI отправителя.

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

## 19. Формирующее UTI лицо.

Заполняется обязательно в Анкете договора и Анкете генерального соглашения.<sup>5</sup>

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Идентификационный код</b> <party id="UTIGeneratingParty"> <partyId>	Репозитарный код Формирующего UTI лица, т.е. стороны договора или третьего лица, формирующего и присваивающего уникальный код идентификации договора (Unique Trade Identifier, UTI) по соглашению сторон договора.	mfr	Значение из справочника <a href="https://www.nsd.ru/services/repository/participants">https://www.nsd.ru/services/repository/participants</a>
<b>Идентификационный код</b> <party id="UTIGeneratingParty"> <partyId>	Код LEI Формирующего UTI лица.	mfr	Например, LEI_253400M18U5TB02TW421
<b>Регистрационный номер</b> <partyReference href="UTIGeneratingParty"> <tradeId>	Уникальный код идентификации договора (UTI), формируемый в соответствии с Приложением 8 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У. <sup>6</sup>  Не допускается изменение значения данного параметра в сообщении о внесении изменений в зарегистрированную Анкету договора.	mfr	См. Приложение 8 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.

## 20. Место заключения сделки.

Заполняется в Анкете договора.

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

## 21. Дата совершения отчитываемого события.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Дата совершения отчитываемого события</b>	Дата совершения отчитываемого события, предназначенная для оценки соблюдения	mfr	ГГТТ-ММ-ДД

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

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

<asOfDate>	<p>стороной сроков предоставления отчетности в репозитарий.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• При <b>первичной регистрации</b> Анкеты договора и Анкеты генерального соглашения: дата заключения договора (&lt;tradeDate&gt;). При направлении сообщения об <b>изменении условий</b> зарегистрированной Анкеты: дата согласования (подписания) изменений (дополнительных соглашений) (&lt;agreementDate&gt;). При направлении сообщения о внесении <b>корректирующих записей</b> в отношении зарегистрированной Анкеты: дата обнаружения ошибки или дата направления сообщения в Репозитарий. В случае уступки права требования третьей стороне: дата уступки.</li> <li>• При предоставлении <b>Отчетов СМ092 и СМ094</b> в течение пяти рабочих дней после окончания отчетного месяца (в этом случае отчет может содержать несколько значений &lt;valuationDate&gt;) рекомендуется указывать последний рабочий день отчетного месяца.<sup>7</sup></li> <li>• При предоставлении <b>Отчета СМ092</b> по мере возникновения требований/обязательств по выплате маржевых сумм (в этом случае предполагается, что отчет содержит одно значение &lt;valuationDate&gt;) указывается дата расчета маржевой суммы (&lt;valuationDate&gt;).</li> <li>• При предоставлении <b>Отчета СМ094</b> по мере переоценки стоимости указывается дата оценки (&lt;valuationDate&gt;).</li> <li>• В Анкете о состоянии обязательств по договорам <b>СМ093</b> указывается дата события (например, дата прекращения обязательств по договору; если исполнение обязательств по договору просрочено, указывается дата просрочки, т. е. плановая дата прекращения обязательств по договору).</li> </ul>		Например, 2015-12-31
------------	---	--	----------------------

## 22. Дата заключения сделки.

Заполняется в Анкете договора и Анкете генерального соглашения.

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

## 23. Номер сообщения.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения

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

<b>Номер сообщения</b> <messageId>	Произвольный уникальный идентификатор, присвоенный сообщению. В Web-кабинете генерируется автоматически.	nfr	Цифры и буквы латинского алфавита.
---------------------------------------	--	-----	------------------------------------

#### 24. Уникальный код цепочки сообщений.

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

#### 25. Исх. № Анкеты связанного документа.

Заполняется в Анкете договора.

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

## II. Особые параметры сделки.

Заполняется в Анкете договора.

### 1. Код брокера.

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

### 2. Обязанность централизованного клиринга.

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

<b>Обязанность централизованного клиринга</b> <Cleared>	Обязанность централизованного клиринга. “Y” – договор подлежит обязательному централизованному клирингу. “N” – договор не подлежит обязательному централизованному клирингу.	mfr	Y; N
--	---	-----	------

### 3. Выбор типа клиринга.

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

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

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

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Код центрального контрагента</b> <clearingCentralCounterpartyCode>	Код LEI центрального контрагента. Заполняется, если тип расчётов определен как “ССР” (расчет по результатам клиринга с участием центрального контрагента – например, НКЦ).	mfr	Например, LEI_2534007UK6G30KDX1A47
<b>Код участника клиринга</b> <clearingMemberID>	Код LEI участника клиринга. Указывается одна из сторон договора по согласованию сторон.	mfr	Например, LEI_253400M18U5TB02TW421
<b>Дата включения обязательств из договора в клиринговый пул</b> <clearedDate>	Дата включения обязательств из договора в клиринговый пул (как правило, равна дате заключения сделки).	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
<b>Дата и время клиринга</b> <clearingDateTime>	Дата и время клиринга обязательств из договора. Если не применимо, не заполняется.	mfr	ГГГГ-ММ-ДДТЧЧ:ММ:СС

### 4. Условия согласования параметров сделки (договора).

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Условия согласования</b>	Условия проведения сверки полей по договору. “FULL” – сверка проводится по всем полям, содержащимся в сообщении, т.е. всем	mfr	Значение из справочника

<p><b>параметров сделки (договора)</b> &lt;reconciliationType&gt;</p>	<p>заполненным (как обязательным, так и опциональным) полям обязательной сверки, полям специальной сверки и полям дополнительной сверки.</p> <p>“GENF” – сверка проводится по основным полям, т.е. заполненным (как обязательным, так и опциональным) полям обязательной сверки и полям специальной сверки. Поля с признаком дополнительной сверки не сверяются.</p>	<p><a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleReconciliationType">http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleReconciliationType</a></p>
---	--	--

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

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

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

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

## 5. Тип расчетов.

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

## 6. Метод расчетов.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<p><b>Метод расчетов</b> &lt;clearSettlementMethod&gt;</p>	<p>Код метода расчетов: “Р” – поставочный; “С” – расчетный; “Е” – расчетно-поставочный, предполагающий выбор какой-либо стороной договора метода расчетов: поставочный или расчетный.</p>	<p>mfr</p>	<p>Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/clear-settlement-method(nsdrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/clear-settlement-method(nsdrus)</a></p>

## 7. Способ подтверждения сделки.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения

Способ подтверждения сделки <confirmationMethod>	Способ подтверждения Анкеты: “МХМЕ” - последовательное либо комбинированное подтверждение, “МАТН” - встречное подтверждение.	sfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simple/MasterAgreementConfirmationEnum">http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simple/MasterAgreementConfirmationEnum</a>
---	--	-----	---

## 8. Автоматическое закрытие сделки в дату окончания срока действия договора.

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

## 9. Признак связанности стороны 1 и стороны 2.

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

## 10. Регуляторный тип сделки.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Регуляторный тип сделки <regulatoryStatus>	Тип договора в соответствии со справочником. “Term” означает сделку с отсрочкой исполнения, которая в соответствии с регулированием и/или	afr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/">http://repository.nsd.ru/versioned/current/</a>

	условиями договора не классифицируется как производный финансовый инструмент.		<a href="#">t/taxonomy/regulatory-status(nsdrus)</a>
--	---	--	--

### 11. Дата начала срока действия договора.

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

### 12. Дата окончания срока действия договора.

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

### 13. Коды классификации финансовых инструментов.

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

#### 13.1 Общие коды классификации для продукта.

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

#### 13.2 Коды классификации для части (потока) продукта.

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

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

<b>Идентификатор части продукта</b> <productLegSpecificCodes> <legId>	Идентификатор части («ноги») свопа, в отношении которой определяется код.	sfr	Символьная строка. Например, “leg1”, “leg2”.
<b>Тип кода</b> <productLegSpecificCodes> <specificCode>	<p>“FixedRateChange” – код амортизации или повышения фиксированной процентной ставки.</p> <p>“NotionalChange” – код амортизации или повышения номинальной суммы.</p> <p>“UnderlierValuation” – код периодичности переоценки.</p> <p>“PaymentFrequency” – код периодичности платежей.</p>	sfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleNsdSpecificCodesEnum">http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleNsdSpecificCodesEnum</a>
<b>Код</b> <productLegSpecificCodes> <Code>	Значение кода в соответствии с Приложениями 4 и 5 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.	sfr	Символьная строка.

#### 14. Информация о клиенте стороны.

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

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

##### 14.1 Сторона, обслуживающая клиента.

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

##### 14.2 Выбор типа клиента стороны.

###### Вариант выбора «Договор заключен не в интересах клиента».

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

###### Вариант выбора «Договор заключен в интересах клиента».

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

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

#### Вариант выбора «Нет сведений в чьих интересах заключен договор».

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

### III. Обеспечение по сделке.

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

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

## IV. Экономические параметры сделки.

Рекомендации по заполнению экономических параметров сделок, сведения о которых предоставляется в репозитарий.<sup>9</sup>

### 1. Анкета валютного свопа (СМ021).

#### 1.1 Тип продукта.

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

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

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

#### 1.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

#### 1.3 Первоначальный платеж по валютному свопу.

##### 1.3.1 Валюта 1.

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

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

### 1.3.2 Валюта 2.

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

### 1.3.3 Торгуемая валюта.

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

### 1.3.4 Дата валютирования.

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

### 1.3.5 Обменный курс.

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

	валюты – базового актива (п. 1.3.3), если иное не определено условиями договора.		
--	--	--	--

### 1.3.6 Беспоставочное исполнение.

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

#### 1.3.6.1 Валюта расчетов.

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

#### 1.3.6.2 Фиксинг.

Не используется.

## 1.4 Окончательный платеж по валютному свопу.

### 1.4.1 Валюта 1.

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

### 1.4.2 Валюта 2.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Сторона-плательщик</b> <payerPartyReference>	Сторона 1, осуществляющая окончательный платеж в Валюте 2.	mfr	Party1
<b>Сторона-получатель</b> <receiverPartyReference>	Сторона 2, получающая окончательный платеж в Валюте 2.	mfr	Party2
<b>Валюта суммы</b> <paymentAmount> <currency>	Валюта 2. Определяется как валюта, уплачиваемая по первой части договора Стороной 2.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)</a>

<b>Сумма денежных средств</b> <paymentAmount> <amount>	Сумма окончательного платежа в Валюте 2.	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000
--	--	-----	---

#### 1.4.3 Торгуемая валюта.

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

#### 1.4.4 Дата валютирования.

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

#### 1.4.5 Обменный курс.

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

#### 1.4.6 Беспоставочное исполнение.

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

## 2. Анкета конверсионной сделки (валютного форварда) (СМ022).

### 2.1 Тип продукта.

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

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

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

### 2.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

### 2.3 Валюта 1.

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

### 2.4 Валюта 2.

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

## 2.5 Торгуемая валюта.

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

## 2.6 Дата валютирования.

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

## 2.7 Обменный курс.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта 1 <currency1>	Валюта 1, как она определена в п. 2.3.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)</a>
Валюта 2 <currency2>	Валюта 2, как она определена в п. 2.4.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleQuoteBasisEnum">http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleQuoteBasisEnum</a>
Базис котировки <quoteBasis>	Базис котировки валютного курса, определенный как "Currency1PerCurrency2" или "Currency2PerCurrency1". Курс указывается за единицу валюты - базового актива (п. 2.5), если иное не определено условиями договора.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleQuoteBasisEnum">http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleQuoteBasisEnum</a>
Обменный курс <rate>	Форвардный валютный курс, соответствующий базису котировки.  Если форвардный курс не определен на дату предоставления информации о договоре в Репозиторий, указывается текущий рыночный курс. При этом не позднее трех рабочих дней с даты определения форвардного курса следует предоставить в Репозиторий информацию об изменении соответствующего договора.	mfr	Положительное десятичное число. Например, 50.1234567

## 2.8 Беспоставочное исполнение.

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

### 2.8.1 Валюта расчетов.

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

## 2.8.2 Фиксинг.

Не используется.

## 3. Анкета валютного опциона (СМ023).

### 3.1 Тип продукта.

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

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

### 3.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

### 3.3 Описание покупателя и продавца.

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

### 3.4 Выбор стиля исполнения опциона.

Вариант выбора «Американский/бермудский стиль исполнения опциона».

#### 3.4.1 Начальная дата.

Заполняется для американского и бермудского опционов.

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

#### 3.4.2 Дата истечения.

Заполняется для американского и бермудского опционов.

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

### 3.4.3 Множественное исполнение.

Не используется.

### 3.4.4 Даты исполнения бермудского опциона.

Заполняется только для бермудского опциона.

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

### Вариант выбора «Европейский стиль исполнения опциона».

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

### 3.5 Сумма валюты на продажу.

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

### 3.6 Сумма валюты на покупку.

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

### 3.7 Оговоренный тип опциона.

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

### 3.8 Цена исполнения.

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

### 3.9 Дополнительные параметры.

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

#### Вариант выбора «Условия азиатского и барьерного опциона».

##### 3.9.1 Условия азиатского опциона.

###### 3.9.1.1 Первичный источник данных для валютного курса.

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

###### 3.9.1.2 График наблюдений.

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

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

### 3.9.2 Условия барьерного опциона.

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

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

### Вариант выбора «Условия барьерного опциона».

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

### 3.10 Премия опциона.

#### 3.10.1 Определение плательщика и получателя.

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

### 3.10.2 Сумма платежа.

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

### 3.11 Денежные расчеты.

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

#### 3.11.1 Валюта расчетов.

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

#### 3.11.2 Фиксинг.

Не используется.

## 4. Анкета бинарного валютного опциона (CM024).

### 4.1 Тип продукта.

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

Значение	Описание
ForeignExchange:SimpleExotic:Digital:American	Опцион валютный бинарный американский
ForeignExchange:SimpleExotic:Digital:Bermuda	Опцион валютный бинарный бермудский
ForeignExchange:SimpleExotic:Digital:European	Опцион валютный бинарный европейский

### 4.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

### 4.3 Описание покупателя и продавца.

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

#### 4.4 Выбор стиля исполнения опциона.

##### Вариант выбора «Американский/бермудский стиль исполнения опциона».

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

<b>Дата окончания периода наблюдения</b> <observationEndDate>	Дата окончания периода, в течение которого проводится наблюдение за выполнением условия касания. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	
--	---	-----	--

#### Вариант выбора «Европейский стиль исполнения опциона».

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

#### 4.5 Выплата по опциону.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Валюта суммы</b> <payout> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма платежа по бинарному опциону.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)</a>

<b>Сумма денежных средств</b> <payout> <amount>	Сумма платежа по бинарному опциону.	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000
<b>Стиль выплаты по опциону</b> <payoutStyle>	Условие выплаты по опциону: при наступлении триггерного события (Immediate) либо позже – например, в дату истечения опциона (Deferred). <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePayoutEnum">http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePayoutEnum</a>

## 4.6 Премия опциона.

### 4.6.1 Определение плательщика и получателя.

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

### 4.6.2 Сумма платежа.

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

## 5. Анкета соглашения о будущей процентной ставке (СМ031).

### 5.1 Тип продукта.

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

Значение	Описание
InterestRate:FRA	Соглашение о будущей процентной ставке

### 5.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

### 5.3 Описание покупателя и продавца.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Сторона-покупатель инструмента</b>	Сторона-покупатель по договору. Если покупатель не определен в условиях	mfr	Party1; Party2

<buyerPartyReference>	сделки, указывается Сторона-плательщик фиксированной ставки.		
<b>Сторона-продавец инструмента</b> <sellerPartyReference>	Сторона-продавец по договору. Если продавец не определен в условиях сделки, указывается Сторона-плательщик плавающей ставки.	mfr	

#### 5.4 Дата начала срока.

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

#### 5.5 Дата истечения срока.

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

#### 5.6 Дата платежа по договору.

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

#### 5.7 Коэффициент для расчета дней в процентном периоде.

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

#### 5.8 Номинальная сумма.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Валюта суммы</b> <currency>	Валюта номинальной суммы.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)</a>
<b>Номинальная сумма</b> <notional>	Номинальная сумма по договору.	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000

## 5.9 Фиксированная ставка.

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

## 5.10 Плавающая ставка.

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

## 5.11 Период плавающей ставки.

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

## 5.12 Дисконтирование.

Не используется.

## 6. Анкета процентного свопа (СМ032).

### 6.1 Тип продукта.

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

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

### 6.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

### 6.3 Платежи по свопу.

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

#### 6.3.1 Определение плательщика и получателя.

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

#### 6.3.2 Расчетные (процентные) периоды.

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

#### 6.3.3 Даты платежей / Периодичность платежей.

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

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

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

### 6.3.4 Даты изменения плавающей ставки / Периодичность изменения плавающей ставки.

Не используется.

### 6.3.5 Сумма расчетного периода / Выбор суммы расчетного периода.

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

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

#### 6.3.5.1 Вариант выбора «Параметры расчета суммы».

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

##### 6.3.5.1.1 Выбор номинальной суммы.

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

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

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

<step>	<stepDate>	<i>предусмотрен график изменения номинальной суммы.</i>		
	<b>Очередное значение</b> <stepValue>	Значение номинальной суммы с учетом амортизации и/или иного изменения. <i>Заполняется, если условиями сделки предусмотрен график изменения номинальной суммы.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000
<b>Валюта</b> <currency>		Валюта, в которой выражена номинальная сумма по данной части свопа.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)</a>

### 6.3.5.1.2 Выбор процентной ставки.

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

Вариант выбора «График фиксированной ставки».

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

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

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения	
<b>Индекс плавающей ставки</b> <floatingRateIndex>	Индекс плавающей ставки. Если значение индекса отсутствует в справочнике, указывается «Прочее» (Other).	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/floating-rate-index(nsdрус)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/floating-rate-index(nsdрус)</a>	
<b>Период плавающей ставки</b> <indexTenor>	<b>Мультипликатор периода</b> <periodMultiplier>	Мультипликатор, определяющий период плавающей ставки.	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
	<b>Тип временно</b>	Тип периода плавающей ставки. Например, мультипликатор «3» и период	mfr	Значение из справочника

	<b>го периода</b> <period>	«М» означают, что используется трехмесячная ставка.		<a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodEnum">http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodEnum</a>
<b>График множителя плавающей ставки – Начальное значение</b> <floatingRateMultiplierSchedule> <initialValue>		Значение множителя, применимого к плавающей ставке. Если условиями предусмотрено несколько значений множителя, указывается его начальное значение, а в блоке «Шаг изменений» определяется график значений. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки (значение не равно «1»).</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1.5.
<b>Шаг изменений</b> <step>	<b>Очередная дата</b> <stepDate>	Дата изменения множителя плавающей ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	<b>Очередное значение</b> <stepValue>	Значение множителя, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1.5.
<b>График спреда плавающей ставки – Начальное значение</b> <spreadSchedule> <initialValue>		Значение спреда, применимого к плавающей ставке. Может принимать положительные и отрицательные значения. Если условиями предусмотрено несколько значений ставки спреда, указывается ее начальное значение, а в блоке «Шаг изменений» определяется график значений. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки (значение не равно «0»).</i>	mfr	Десятичное число. Например, 10 базисных пунктов или 0,1% представляется как 0.001
<b>Шаг изменений</b> <step>	<b>Очередная дата</b> <stepDate>	Дата изменения ставки спреда. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	<b>Очередное значение</b> <stepValue>	Значение ставки спреда, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Десятичное число. Например, 0.001
<b>График максимума ставки – Начальное значение</b> <capRateSchedule> <initialValue>		Значение максимума плавающей ставки. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05.
<b>Шаг изменений</b> <step>	<b>Очередная дата</b> <stepDate>	Дата изменения максимума ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	<b>Очередное значение</b> <stepValue>	Значение максимума ставки, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05.
<b>График минимума ставки – Начальное значение</b> <floorRateSchedule> <initialValue>		Значение минимума плавающей ставки. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05.

<b>Шаг изменений</b> <step>	<b>Очередная дата</b> <stepDate>	Дата изменения минимума ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	<b>Очередное значение</b> <stepValue>	Значение минимума ставки, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05.
<b>Начальное значение ставки</b> <initialRate>		Значение плавающей ставки для первого процентного периода.	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05.

### 6.3.5.1.3 Коэффициент для расчета дней в процентном периоде.

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

### 6.3.5.1.4 Дисконтирование.

Не используется.

### 6.3.5.1.5 Метод капитализации.

Не используется.

### 6.3.5.2 Вариант выбора «График известных сумм».

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

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

## 6.4 Обмен основными суммами.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Первоначальный платеж</b> <initialExchange>	Определяет, будет ли осуществляться первоначальный платеж номинальной суммы на дату начала срока. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Флаг да/нет ("true"; "false")
<b>Окончательный платеж</b> <finalExchange>	Определяет, будет ли осуществляться окончательный платеж номинальной суммы на дату истечения срока. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	
<b>Промежуточный платеж</b> <intermediateExchange>	Определяет, будут ли осуществляться промежуточные платежи номинальной суммы в течение срока договора. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	

## 6.5 Дополнительные условия расчетов.

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

## 7. Анкета договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки (СМ033).

### 7.1 Тип продукта.

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

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

### 7.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

### 7.3 Определение плательщика и получателя.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Сторона-плательщик</b> <payerPartyReference>	Сторона, осуществляющая платеж по плавающей процентной ставке (продавец договора фиксации)	mfr	Party1; Party2

	максимальной/минимальной процентной ставки).		
<b>Сторона-получатель</b> <receiverPartyReference>	Сторона, получающая платеж по плавающей процентной ставке (покупатель договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки).	mfr	

#### 7.4 Расчетные (процентные) периоды.

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

#### 7.5 Даты платежей / Периодичность платежей.

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

	<i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>		
<b>Дата последнего регулярного платежа</b> <lastRegularPaymentDate>	Дата последнего регулярного платежа. Может указываться при наличии неполного последнего расчетного периода. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	

## 7.6 Даты изменения плавающей ставки / Периодичность изменения плавающей ставки.

Не используется.

## 7.7 Сумма расчетного периода / Выбор суммы расчетного периода.

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

### Вариант выбора «Параметры расчета суммы».

#### 7.7.1 Выбор номинальной суммы.

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

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

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

#### 7.7.2 Выбор процентной ставки.

Вариант выбора «График фиксированной ставки».

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

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

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

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Индекс плавающей ставки</b> <floatingRateIndex>	Индекс плавающей ставки. Если значение индекса отсутствует в справочнике, указывается «Прочее» (Other).	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/floating-rate-index(nsdrus)">http://repository.nsd.ru/ versioned/current/taxon omy/floating-rate- index(nsdrus)</a>
<b>Период плавающей ставки</b> <indexTenor>	Мультипликатор периода <periodMultiplier>	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

	<b>Тип временного периода</b> <period>	Тип периода плавающей ставки. Например, мультипликатор «3» и период «М» означают, что используется трехмесячная ставка.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodEnum">http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodEnum</a>
<b>График множителя плавающей ставки – Начальное значение</b> <floatingRateMultiplierSchedule> <initialValue>		Значение множителя, применимого к плавающей ставке. Если условиями предусмотрено несколько значений множителя, указывается его начальное значение, а в блоке «Шаг изменений» определяется график значений. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки (значение не равно «1»).</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1.5
<b>Шаг изменений</b> <step>	<b>Очередная дата</b> <stepDate>	Дата изменения множителя плавающей ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	<b>Очередное значение</b> <stepValue>	Значение множителя, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1.5
<b>График спреда плавающей ставки – Начальное значение</b> <spreadSchedule> <initialValue>		Значение спреда, применимого к плавающей ставке. Может принимать положительные и отрицательные значения. Если условиями предусмотрено несколько значений ставки спреда, указывается ее начальное значение, а в блоке «Шаг изменений» определяется график значений. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки (значение не равно «0»).</i>	mfr	Десятичное число. Например, 10 базисных пунктов или 0,1% представляется как 0.001
<b>Шаг изменений</b> <step>	<b>Очередная дата</b> <stepDate>	Дата изменения ставки спреда. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	<b>Очередное значение</b> <stepValue>	Значение ставки спреда, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Десятичное число. Например, 0.001
<b>График максимума ставки – Начальное значение</b> <capRateSchedule> <initialValue>		Значение максимума плавающей ставки. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05
<b>Шаг изменений</b> <step>	<b>Очередная дата</b> <stepDate>	Дата изменения максимума ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	<b>Очередное значение</b> <stepValue>	Значение максимума ставки, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 5% представляется как 0.05

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

### 7.7.3 Коэффициент для расчета дней в процентном периоде.

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

### 7.7.4 Дисконтирование.

Не используется.

### 7.7.5 Метод капитализации.

Не используется.

### 7.8 Обмен основными суммами.

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

### 7.9 Дополнительные условия расчетов.

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

### 7.10 Премия.

#### 7.10.1 Определение плательщика и получателя.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Сторона-плательщик</b> <payerPartyReference>	Сторона-покупатель опциона.	mfr	Party1; Party2

<b>Сторона-получатель</b> <receiverPartyReference>	Сторона-продавец опциона.	mfr	
---	---------------------------	-----	--

### 7.10.2 Сумма платежа.

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

## 8. Анкета свопциона (СМ034).

### 8.1 Тип продукта.

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

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

### 8.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

### 8.3 Описание покупателя и продавца.

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

### 8.4 Премия.

#### 8.4.1 Определение плательщика и получателя.

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

## 8.4.2 Сумма платежа.

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

## 8.5 Выбор стиля исполнения.

### 8.5.1 Вариант выбора «Американский стиль исполнения опциона».

#### 8.5.1.1 Начальная дата.

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

#### 8.5.1.2 Дата истечения.

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

#### 8.5.1.3 Множественное исполнение.

Не используется.

### 8.5.2 Вариант выбора «Бермудский стиль исполнения опциона».

#### 8.5.2.1 Даты исполнения бермудского опциона.

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

#### 8.5.2.2 Множественное исполнение.

Не используется.

### 8.5.3 Вариант выбора «Европейский стиль исполнения опциона».

#### 8.5.3.1 Дата истечения.

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

#### 8.5.3.2 Частичное исполнение.

Не используется.

## 8.6 Выбор метода исполнения.

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

## 8.7 Условия свопа.

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

## 9. Анкета договора РЕПО (СМ041).

### 9.1 Тип продукта.

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

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

### 9.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

### 9.3 Выбор процентной ставки.

#### 9.3.1 Вариант выбора «Фиксированная процентная ставка».

Заполняется обязательно для договора РЕПО с фиксированной ставкой.

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

#### 9.3.2 Вариант выбора «Плавающая процентная ставка».

Заполняется обязательно для договора РЕПО с плавающей ставкой.

Элемент		Описание	Сверка	Формат заполнения
Индекс плавающей ставки <floatingRateIndex>		Индекс плавающей ставки. Если значение индекса отсутствует в справочнике, указывается «Прочее» (Other).	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/floating-rate-index(nsdrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/floating-rate-index(nsdrus)</a>
Период плавающей ставки <indexTenor>	Мультипликатор периода <periodMultiplier>	Мультипликатор, определяющий период плавающей ставки.	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)
	Тип временного периода <period>	Тип периода плавающей ставки. Например, мультипликатор «3» и период «М» означают, что используется трехмесячная ставка.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodEnum">http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodEnum</a>
График множителя плавающей ставки – Начальное значение <floatingRateMultiplierSchedule> <initialValue>		Значение множителя, применимого к плавающей ставке. Если предусмотрено несколько значений множителя, указывается его начальное значение, а в блоке «Шаг изменений» определяется график значений. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки (значение не равно «1»).</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1.5
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения множителя плавающей ставки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение множителя, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1.5
График спреда плавающей ставки – Начальное значение <spreadSchedule> <initialValue>		Значение спреда, применимого к плавающей ставке. Может принимать положительные и отрицательные значения. Если предусмотрено несколько значений ставки спреда, указывается ее начальное значение, а в блоке «Шаг изменений» определяется график значений. <i>Заполняется, если содержится в условиях сделки (значение не равно «0»).</i>	mfr	Десятичное число. Например, 10 базисных пунктов или 0,1% представляется как 0.001
Шаг изменений <step>	Очередная дата <stepDate>	Дата изменения ставки спреда. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
	Очередное значение <stepValue>	Значение ставки спреда, действующее с указанной даты. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	Десятичное число. Например, 0.001

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

#### 9.4 Коэффициент для расчета дней в процентном периоде.

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

#### 9.5 Тип срока РЕПО.

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

#### 9.6 Первая часть сделки РЕПО.

##### 9.6.1 Описание покупателя и продавца.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения

<b>Сторона-покупатель инструмента</b> <buyerPartyReference>	Сторона-покупатель по договору.	mfr	Party1; Party2
<b>Сторона-продавец инструмента</b> <sellerPartyReference>	Сторона-продавец по договору.	mfr	

### 9.6.2 Дата расчетов.

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

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

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

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

### 9.6.4 Обеспечение.

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

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

#### 9.6.4.1 Вариант выбора «По номиналу актива».

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Номинальная сумма обеспечения - <b>Валюта суммы</b> <nominalAmount> <currency>	Валюта номинальной суммы.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versions/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versions/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)</a>
Номинальная сумма обеспечения - <b>Сумма</b>	Номинальная стоимость облигаций в обеспечении. Рассчитывается как количество облигаций, умноженное на начальную номинальную стоимость одной облигации (без дисконта). <sup>11</sup>	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000

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

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

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

#### 9.6.4.2 Вариант выбора «По цене лота актива».

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

#### 9.6.4.3 Ссылка на актив.

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

#### 9.6.4.4 Дисконт по ценной бумаге.

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

##### 9.6.4.4.1 Значение дисконта.

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

#### 9.6.4.4.2 Выбор ограничения изменения значения дисконта.

Вариант выбора «Максимальное отклонение дисконта». Не используется.

Вариант выбора «Верхнее и нижнее предельное значение дисконта».

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

#### 9.6.5 Порядок расчетов.

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

#### 9.6.6 Дата поставки.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Дата поставки</b> deliveryDate - unadjustedDate	Дата поставки ценных бумаг по первой части договора РЕПО. Заполняется обязательно.	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

#### 9.7 Вторая часть сделки РЕПО.

##### 9.7.1 Описание покупателя и продавца.

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

##### 9.7.2 Дата расчетов.

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

### 9.7.3 Выбор суммы и валюты расчетов.

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

#### Вариант выбора «Сумма расчетов».

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

#### Вариант выбора «Валюта расчетов».

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

### 9.7.4 Обеспечение.

*Не заполняется* для второй части договора РЕПО.

### 9.7.5 Порядок расчетов.

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

### 9.7.6 Дата поставки.

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

## 9.8 Финансовый инструмент сделки РЕПО.

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

### 9.8.1 Вариант выбора «Облигация».

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

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

### 9.8.2 Вариант выбора «Фондовый актив».

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

## 10. Анкета договора купли-продажи облигации (СМ042).

### 10.1 Тип продукта.

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

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

### 10.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

### 10.3 Описание покупателя и продавца.

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

### 10.4 Номинальная сумма.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения

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

## 10.5 Цена.

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

## 10.6 Облигация.

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

## 10.7 Срок сделки.

*Необязательные для заполнения* элементы, определяющие срок сделки.

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

			<a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodEnum">ference/types/simplePeriodEnum</a>
--	--	--	--

## 10.8 Порядок расчетов.

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

## 10.9 Дата расчетов.

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

## 10.10 Дата поставки.

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

## 10.11 Количество единиц актива.

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

## 11. Анкета форварда на облигацию или индекс (СМ043).

### 11.1 Тип продукта.

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

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

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

### 11.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

### 11.3 Описание покупателя и продавца.

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

### 11.4 Базовый актив. Выбор типа базового актива.

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

#### 11.4.1 Вариант выбора «Единичный базовый актив».

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

##### 11.4.1.1 Базовый актив.

##### Вариант выбора «Облигация».

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

##### Вариант выбора «Индекс».

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

##### 11.4.1.2 Лот актива.

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

#### 11.4.2 Вариант выбора «Корзина базовых активов».

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

#### 11.4.2.1 Число единиц активов.

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

#### 11.4.2.2 Компонент корзины.

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

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

##### 11.4.2.2.1 Базовый актив.

Вариант выбора «Облигация».

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

Вариант выбора «Индекс».

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

##### 11.4.2.2.2 Вес элемента. Выбор типа весового коэффициента.

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

Вариант выбора «Количество единиц базового актива».

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

### Вариант выбора «Вес компонента корзины в процентах».

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

### 11.5 Номинальная сумма.

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

### 11.6 Дата расчетов.

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

### 11.7 Валюта расчетов.

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

### 11.8 Источник расчетных цен.

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

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

### 11.9 Частичная поставка.

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

### 11.10 Форвардная цена.

#### Вариант выбора «Форвардная цена».

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

#### Вариант выбора «Форвардная цена в процентах».

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

## 12. Анкета опциона на облигацию (СМ044).

### 12.1 Тип продукта.

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

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

### 12.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

### 12.3 Описание покупателя и продавца.

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

### 12.4 Тип опциона.

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

### 12.5 Премия опциона.

#### 12.5.1 Определение плательщика и получателя.

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

#### 12.5.2 Сумма платежа.

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

### 12.6 Выбор стиля исполнения.

#### 12.6.1 Вариант выбора «Американский стиль исполнения опциона».

### 12.6.1.1 Начальная дата.

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

### 12.6.1.2 Дата истечения.

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

### 12.6.1.3 Множественное исполнение.

Не используется.

## 12.6.2 Вариант выбора «Бермудский стиль исполнения опциона».

### 12.6.2.1 Даты исполнения бермудского опциона.

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

### 12.6.2.2 Множественное исполнение.

Не используется.

## 12.6.3 Вариант выбора «Европейский стиль исполнения опциона».

### 12.6.3.1 Дата истечения.

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

### 12.6.3.2 Частичное исполнение.

Не используется.

## 12.7 Дополнительные параметры.

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

### 12.7.1 Параметры азиатского опциона.

#### 12.7.1.1 Метод усреднения цены.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Метод усреднения цены</b> <averagingInOut>	Метод усреднения цены, используемый для азиатского опциона.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/cu">http://repository.nsd.ru/versioned/cu</a>

	<p>“In” означает, что цена страйк определяется как среднее значение цены базового актива на спот-рынке за указанный период (опцион с азиатским страйком).</p> <p>“Out” означает, что цена базового актива при экспирации опциона определяется как среднее значение цены базового актива на спот-рынке за указанный период (опцион с азиатской ценой).</p> <p>“Both” означает опцион с азиатским страйком и азиатской ценой.</p>		<a href="http://rent/reference/types/simpleAveragingInOutEnum">rent/reference/types/simpleAveragingInOutEnum</a>
--	---	--	--

### 12.7.1.2 Период усреднения цены страйка. График наблюдений.

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

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

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

### 12.7.1.3 Период усреднения цены базового актива. График наблюдений.

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

## 12.7.2 Условия барьерного опциона.

### 12.7.2.1 Параметры отлагательного условия.

#### 12.7.2.1.1 Параметры триггерного условия.

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

### 12.7.2.1.2 Выплата по бинарному опциону.

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

### 12.7.2.2 Параметры отменительного условия.

#### 12.7.2.2.1 Параметры триггерного условия.

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

#### 12.7.2.2.2 Выплата по бинарному опциону.

Заполняется аналогично п. 12.7.2.1.2.

### 12.8 Номинальная сумма.

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

### 12.9 Объем лота.

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

## 12.10 Количество опционов.

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

## 12.11 Тип расчетов.

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

## 12.12 Цена исполнения.

### 12.12.1 Вариант выбора «Цена страйк».

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Цена исполнения</b> <strikePrice>	Цена исполнения, определенная как сумма в соответствующей валюте. <i>В случае барьерного условия может заполняться цена, относительно которой рассчитывается в моменте барьер на дату заключения сделки (текущая рыночная цена, если не оговорено иное).</i>	mfr	Положительное десятичное число.

### 12.12.2 Вариант выбора «Цена исполнения в процентах».

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

### 12.12.3 Валюта.

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

## 12.13 Облигация.

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

<b>Наименование актива</b> <description>	Полное наименование базового актива. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка.
---	--	-----	--------------------

### 13. Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (СМ045).

#### 13.1 Тип продукта.

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

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

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

#### 13.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

#### 13.3 Описание покупателя и продавца.

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

#### 13.4 Тип опциона.

Заполняется аналогично п. 12.4 Анкеты опциона на облигацию (СМ044).

#### 13.5 Премия опциона.

Заполняется аналогично п. 12.5 Анкеты опциона на облигацию (СМ044).

#### 13.6 Выбор стиля исполнения.

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

#### 13.7 Дополнительные параметры.

Заполняется аналогично п. 12.7 Анкеты опциона на облигацию (СМ044).

#### 13.8 Номинальная сумма.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Валюта суммы</b> <nominalAmount> <currency>	Валюта номинальной суммы.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)</a>
<b>Сумма</b> <nominalAmount> <amount>	Совокупная номинальная сумма (объем договора). В случае опциона на корзину облигаций/индексов определяется как произведение количества опционов,	mfr	Положительное десятичное число. Например, 1000

	<p>количества корзин и номинальной стоимости одной корзины.</p> <p>В случае опциона на индекс определяется как произведение количества опционов, значения индекса на дату заключения договора в индексных пунктах и мультипликатора индекса (стоимости 1 пункта индекса в соответствии со спецификацией). Если данным способом определить номинальную сумму невозможно, указывается стоимость договора на дату его заключения в соответствии с данными бухгалтерского учета.</p>		
--	--	--	--

### 13.9 Объем лота.

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

### 13.10 Количество опционов.

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

### 13.11 Тип расчетов.

Заполняется аналогично п. 12.11 Анкеты опциона на облигацию (СМ044).

### 13.12 Цена исполнения (страйк).

Заполняется аналогично п. 12.12 Анкеты опциона на облигацию (СМ044).

### 13.13 Выбор базового актива.

#### 13.13.1 Вариант выбора «Корзина».

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

#### 13.13.1.1 Число единиц активов.

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

#### 13.13.1.2 Компонент корзины.

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

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

#### 13.13.1.2.1 Базовый актив.

Вариант выбора «Облигация».

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

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

Вариант выбора «Индекс».

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

13.13.1.2.2 Вес элемента. Выбор типа весового коэффициента.

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

Вариант выбора «Количество единиц базового актива».

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

Вариант выбора «Вес компонента корзины в процентах».

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

13.13.2 Вариант выбора «Индекс».

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

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Идентификатор базового актива</b> <instrumentId>	Идентификатор (код) индекса.	mfr	Символьная строка. Например, RU000A0JREQ7.

<b>Наименование актива</b> <description>	Полное наименование индекса. <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>	afr	Символьная строка.
---	--	-----	--------------------

## 14. Анкета договора купли-продажи акции (СМ046).

### 14.1 Тип продукта.

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

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

### 14.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

### 14.3 Описание покупателя и продавца.

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

### 14.4 Количество единиц.

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

### 14.5 Цена за единицу.

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

### 14.6 Акция.

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

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

#### 14.7 Срок сделки.

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

#### 14.8 Порядок расчетов.

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

#### 14.9 Дата расчетов.

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

#### 14.10 Дата поставки.

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

### 15. Анкета форварда на акцию (СМ047).

#### 15.1 Тип продукта.

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

Значение	Описание

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

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

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

## 15.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

## 15.3 Описание покупателя и продавца.

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

## 15.4 Базовый актив.

### 15.4.1 Вариант выбора «Едиличный базовый актив».

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

#### 15.4.1.1 Базовый актив.

##### Вариант выбора «Акция».

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

#### 15.4.1.2 Лот актива.

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

### 15.4.2 Вариант выбора «Корзина базовых активов».

Параметры базового актива в виде корзины акций.

### 15.4.2.1 Лот актива.

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

### 15.4.2.2 Компонент корзины.

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

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

#### 15.4.2.2.1 Базовый актив.

Вариант выбора «Акция».

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

#### 15.4.2.2.2 Вес элемента. Выбор типа весового коэффициента.

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

Вариант выбора «Количество единиц базового актива».

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

## 15.5 Исполнение контракта на фондовые активы.

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

### 15.5.1 Дата.

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

### 15.5.2 Валюта расчетов.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Валюта расчетов</b> <settlementCurrency>	Валюта, в которой проводятся расчеты.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxon">http://repository.nsd.ru/ versioned/current/taxon</a>

			<a href="http://www.iso4217-2001-08-15(fpmlrus)"><u>omy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)</u></a>
--	--	--	---

### 15.5.3 Тип расчетов.

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

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

### 15.6 Форвардная цена.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Валюта суммы</b> <forwardPrice> <currency>	Валюта, в которой выражена форвардная цена.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)"><u>http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)</u></a>
<b>Сумма</b> <forwardPrice> <amount>	Форвардная цена за единицу базового актива. В случае форварда на корзину акций – стоимость одной корзины.  Если форвардная цена не определена на дату предоставления информации о договоре в Репозиторий, указывается текущая рыночная цена. При этом не позднее трех рабочих дней с даты определения форвардной цены следует предоставить в Репозиторий информацию об изменении соответствующего договора.	mfr	Положительное десятичное число.

## 16. Анкета опциона на акцию (СМ048).

### 16.1 Тип продукта.

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

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

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

### 16.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

### 16.3 Описание покупателя и продавца.

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

### 16.4 Базовый актив.

#### 16.4.1 Вариант выбора «Едиличный базовый актив».

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

##### 16.4.1.1 Базовый актив.

###### Вариант выбора «Акция».

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

##### 16.4.1.2 Лот актива.

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

#### 16.4.2 Вариант выбора «Корзина базовых активов».

Параметры базового актива в виде корзины акций.

##### 16.4.2.1 Лот актива.

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

	опционов и количества корзин в одном опционе. Если договор заключен в отношении одного опциона, совпадает с объемом опциона.		
--	--	--	--

#### 16.4.2.2 Компонент корзины.

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

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

##### 16.4.2.2.1 Базовый актив.

Вариант выбора «Акция».

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

##### 16.4.2.2.2 Вес элемента. Выбор типа весового коэффициента.

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

Вариант выбора «Количество единиц базового актива».

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

#### 16.5 Номинальная сумма

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

Номинальная сумма договора

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

## 16.6 Выбор стиля исполнения.

### 16.6.1 Вариант выбора «Европейский стиль исполнения опциона».

#### 16.6.1.1 Дата.

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

### 16.6.2 Вариант выбора «Американский стиль исполнения опциона».

#### 16.6.2.1 Начальная дата.

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

#### 16.6.2.2 Дата истечения.

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

#### 16.6.2.3 Многократное исполнение фондовых опционов.

Не используется.

### 16.6.3 Вариант выбора «Бермудский стиль исполнения опциона».

#### 16.6.3.1 Начальная дата.

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

#### 16.6.3.2 Дата истечения.

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

#### 16.6.3.3 Даты исполнения бермудского опциона.

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

#### 16.6.3.4 Многократное исполнение фондовых опционов.

Не используется.

## 16.7 Валюта расчетов.

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

## 16.8 Тип расчетов.

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

## 16.9 Дополнительные характеристики.

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

### 16.9.1 Параметры азиатского опциона.

#### 16.9.1.1 Метод усреднения цены.

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

#### 16.9.1.2 Период усреднения цены страйка. График наблюдений.

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

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

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Начало периода наблюдения</b> <schedule> <startDate>	Дата начала периода, за который определяется среднее значение цены базового актива.	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

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

### 16.9.1.3 Период усреднения цены базового актива. График наблюдений.

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

### 16.9.2 Условия барьерного опциона.

#### 16.9.2.1 Параметры отлагательного условия.

##### 16.9.2.1.1 Параметры триггерного условия.

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

##### 16.9.2.1.2 Выплата по бинарному опциону.

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

##### 16.9.2.2 Параметры отменительного условия.

### 16.9.2.2.1 Параметры триггерного условия.

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

### 16.9.2.2.2 Выплата по бинарному опциону.

Заполняется аналогично п. 16.8.2.1.2.

## 16.10 Цена исполнения.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Цена исполнения</b> <strikePrice>	Цена исполнения за одну акцию (корзину акций). <i>В случае барьерного условия может заполняться цена, относительно которой рассчитывается в моменте барьер на дату заключения сделки (текущая рыночная цена, если не оговорено иное).</i>	mfr	Положительное десятичное число
<b>Валюта</b> <strike> <currency>	Валюта, в которой выражена цена исполнения.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)</a>
<b>Цена исполнения</b> <strikePercentage>	Цена исполнения в процентном отношении (применяется для опционов на фондовый индекс)	mfr	Положительное десятичное число

## 16.11 Цена спот.

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

## 16.12 Количество опционов.

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

## 16.13 Объем опциона.

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

## 16.14 Премия опциона.

### 16.14.1 Определение плательщика и получателя.

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

### 16.14.2 Сумма платежа.

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

## 17. Анкета свопа дохода на облигацию (СМ061).

### 17.1 Тип продукта.

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

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

### 17.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

### 17.3 Описание покупателя и продавца.

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

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

#### 17.4 Выбор типа потока сумм.

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

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

##### 17.4.1 Вариант выбора «Суммы фиксированного дохода».

Параметры платежей, привязанных к процентной ставке.

###### 17.4.1.1 Определение плательщика и получателя.

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

###### 17.4.1.2 Даты расчетных периодов процентного потока.

###### 17.4.1.2.1 Даты изменения плавающей ставки / Периодичность дат изменения плавающей ставки.

Не используется.

###### 17.4.1.2.2 Даты платежа.

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

###### 17.4.1.3 Номинальная сумма.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Валюта суммы</b> <nominalAmount> <currency>	Валюта номинальной суммы.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)</a>
<b>Сумма денежных средств</b> <nominalAmount> <amount>	Совокупная номинальная сумма по договору.	mfr	Положительное десятичное число

#### 17.4.1.4 Расчет процентной суммы.

##### 17.4.1.4.1 Выбор типа процентной ставки.

Вариант выбора «Расчет плавающей ставки».

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

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

#### Вариант выбора «Фиксированная ставка».

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

#### 17.4.1.4.2 Коэффициент для расчета дней в процентном периоде.

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

#### 17.4.2 Вариант выбора «Суммы дохода от облигации».

Параметры платежей, привязанных к доходности базового актива.

##### 17.4.2.1 Определение плательщика и получателя.

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

<b>Сторона-плательщик</b> <payerPartyReference>	Сторона-плательщик платежей, привязанных к доходности базового актива.	mfr	Party1; Party2
<b>Сторона-получатель</b> <receiverPartyReference>	Сторона-получатель платежей, привязанных к доходности базового актива.	mfr	

#### 17.4.2.2 Дата начала срока форвардного потока.

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

#### 17.4.2.3 Базовый актив.

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

##### 17.4.2.3.1 Вариант выбора «Единичный базовый актив».

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

##### 17.4.2.3.1.1 Базовый актив.

Вариант выбора «Облигация».

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

Вариант выбора «Индекс».

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

##### 17.4.2.3.1.2 Лот актива.

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

### 17.4.2.3.2 Вариант выбора «Корзина базовых активов».

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

#### 17.4.2.3.2.1 Число единиц активов.

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

#### 17.4.2.3.2.2 Компонент корзины.

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

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

#### 17.4.2.3.2.2.1 Базовый актив.

Вариант выбора «Облигация».

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

#### 17.4.2.3.2.2.2 Вес элемента. Выбор типа весового коэффициента.

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

Вариант выбора «Количество единиц базового актива».

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

Вариант выбора «Вес компонента корзины в процентах».

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

### 17.4.2.4 Оценка потока доходов.

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

<paymentDates> <unadjustedDate>			
------------------------------------	--	--	--

#### 17.4.2.5 Номинальная сумма.

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

#### 17.4.2.6 Тип дохода.

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

#### 17.5 Платеж основной суммы.

Не используется.

#### 17.6 Дополнительный платеж.

Не используется.

### 18. Анкета свопа дохода на акцию (CM062).

#### 18.1 Тип продукта.

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

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

## 18.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

## 18.3 Описание покупателя и продавца.

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

## 18.4 Выбор типа потока сумм.

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

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

### 18.4.1 Вариант выбора «Суммы фиксированного дохода».

Параметры платежей, привязанных к процентной ставке.

#### 18.4.1.1 Определение плательщика и получателя.

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

#### 18.4.1.2 Даты расчетных периодов процентного потока.

18.4.1.2.1 Даты изменения плавающей ставки / Периодичность дат изменения плавающей ставки.

Не используется.

18.4.1.2.2 Даты платежа.

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

#### 18.4.1.3 Номинальная сумма.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Валюта суммы</b> <nominalAmount> <currency>	Валюта номинальной суммы.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)</a>
<b>Сумма денежных средств</b> <nominalAmount> <amount>	Совокупная номинальная сумма.	mfr	Положительное десятичное число.

#### 18.4.1.4 Расчет процентной суммы.

##### 18.4.1.4.1 Выбор типа процентной ставки.

Вариант выбора «Расчет плавающей ставки».

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

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

#### Вариант выбора «Фиксированная ставка».

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

#### 18.4.1.4.2 Коэффициент для расчета дней в процентном периоде.

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

<b>Коэффициент для расчета дней в процентном периоде</b> <dayCountFraction>	Коэффициент для расчета дней в процентном периоде.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/day-count-fraction(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/day-count-fraction(fpmlrus)</a>
--	--	-----	---

#### 18.4.2 Вариант выбора «Суммы дохода от актива».

Параметры платежей, привязанных к доходности базового актива.

##### 18.4.2.1 Определение плательщика и получателя.

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

##### 18.4.2.2 Дата начала срока форвардного потока.

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

##### 18.4.2.3 Базовый актив.

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

##### 18.4.2.3.1 Вариант выбора «Единичный базовый актив».

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

###### 18.4.2.3.1.1 Базовый актив.

Вариант выбора «Акция».

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

Вариант выбора «Индекс».

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

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

#### 18.4.2.3.1.2 Лот актива.

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

#### 18.4.2.3.2 Вариант выбора «Корзина базовых активов».

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

##### 18.4.2.3.2.1 Лот актива.

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

##### 18.4.2.3.2.2 Компонент корзины.

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

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

##### 18.4.2.3.2.2.1 Базовый актив.

Вариант выбора «Акция».

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

##### 18.4.2.3.2.2.2 Вес элемента. Выбор типа весового коэффициента.

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

Вариант выбора «Количество единиц базового актива».

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

#### Вариант выбора «Вес компонента корзины в процентах».

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

#### 18.4.2.4 Оценка потока доходов.

##### 18.4.2.4.1 Первоначальная цена<sup>12</sup>.

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

##### 18.4.2.4.2 Окончательная цена.

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

##### 18.4.2.4.3 Даты платежа.

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

#### 18.4.2.5 Номинальная сумма.

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

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

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

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

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

#### 18.4.2.6 Индексированная сумма.

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

#### 18.5 Платеж основной суммы.

Не используется.

### 19. Анкета товарного форварда (CM051).

#### 19.1 Тип продукта.

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

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

#### 19.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

#### 19.3 Выбор ценовых параметров товарного форварда - Параметры фиксированной цены.

##### 19.3.1 Определение плательщика и получателя.

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

### 19.3.2 Фиксированная цена.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Цена <price>	Форвардная цена за единицу базового актива. Если форвардная цена не определена на дату предоставления информации о договоре в Репозиторий, указывается текущая рыночная цена. При этом не позднее трех рабочих дней с даты определения форвардной цены следует предоставить в Репозиторий информацию об изменении соответствующего договора.	mfr	Положительное десятичное число.
Валюта цены <priceCurrency>	Валюта, в которой выражена форвардная цена.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is04217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is04217-2001-08-15(fpmlrus)</a>
Единица измерения цены <priceUnit>	Единица измерения, соответствующая форвардной цене.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/price-quote-units(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/price-quote-units(fpmlrus)</a>

### 19.3.3 Общая сумма.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <totalPrice> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is04217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is04217-2001-08-15(fpmlrus)</a>
Сумма денежных средств <totalPrice> <amount>	Расчетная номинальная сумма по договору. Определяется как произведение количества базового актива и форвардной цены в единицах валюты. Если форвардная цена не определена на дату предоставления информации о договоре в Репозиторий, используется текущая рыночная цена.	mfr	Положительное десятичное число.

### 19.3.4 Определение даты платежа.

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

## 19.4 Выбор части товарной сделки

### 19.4.1 Вариант выбора «Поставочная часть товарной сделки».

#### 19.4.1.1 Определение плательщика и получателя.

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

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

#### 19.4.1.2 Товар.

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

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

«Выбор источника публикации цены товарного актива» не используется.

#### 19.4.1.3 Периоды поставки.

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

#### 19.4.1.4 Поставляемое количество актива.

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

#### 19.4.1.5 Конверсионный фактор.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Конверсионный фактор</b> <conversionFactor>	Коэффициент, используемый для конвертации единиц измерения, соответствующих цене базового актива, в единицы измерения, соответствующие количеству	afr	Положительное десятичное число.

	базового актива (в случае если они не совпадают). Значение по умолчанию - «1». <i>Необязательный для заполнения и сверки элемент.</i>		
--	---	--	--

## 19.4.2 Вариант выбора «Товарная часть расчетного форварда».

### 19.4.2.1 Определение плательщика и получателя.

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

### 19.4.2.2 Товар.

Параметры базового актива. Заполняется аналогично п. 19.4.1.2.

### 19.4.2.3 Указания номинального количества.

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

### 19.4.2.4 Расчет плавающей цены.

Не используется.

### 19.4.2.5 Определение даты платежа.

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

## 20. Анкета товарного опциона (СМ052).

### 20.1 Тип продукта.

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

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

## 20.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

## 20.3 Описание покупателя и продавца.

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

## 20.4 Выбор типа опциона.

### 20.4.1 Вариант выбора «Товарный опцион».

#### 20.4.1.1 Товарный актив.

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

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Идентификатор базового актива</b> <instrumentId>	Код базового актива в соответствии со справочником.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/commodity-instrument-id(nsdrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/commodity-instrument-id(nsdrus)</a>
<b>Наименование актива</b> <description>	Полное наименование базового актива (например, вид драгоценного металла, сорт нефти, код фьючерса).	afr	Символьная строка.
<b>Единица измерения</b> <unit>	Единица измерения, соответствующая публикуемой цене базового актива.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/price-quote-units(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/price-quote-units(fpmlrus)</a>
<b>Валюта товарного актива</b> <currency>	Валюта, в которой выражена публикуемая цена базового актива.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is04217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is04217-2001-08-15(fpmlrus)</a>

«Выбор источника публикации цены товарного актива» не используется.

#### 20.4.1.2 Выбор способа определения расчетных периодов.

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

#### Вариант выбора «Расписание расчетных периодов».

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Мультипликатор периода</b> <calculationPeriodsSchedule> > <periodMultiplier>	Мультипликатор периода времени.	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

<b>Период времени</b> <calculationPeriodsSchedule> <period>	Тип периода времени, соответствующий периодичности определения средней цены для азиатского опциона.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodExtendedEnum">http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simplePeriodExtendedEnum</a>
---	---	-----	---

#### *Вариант выбора «Расчетные периоды».*

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

#### *20.4.1.3 Указания номинального количества.*

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

#### *20.4.1.4 Выбор стиля исполнения опциона*

##### *Вариант выбора «Американский стиль исполнения».*

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

##### *Вариант выбора «Европейский стиль исполнения».*

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

#### *20.4.1.5 Валюта расчетов.*

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

#### *20.4.1.6 Определение даты платежа.*

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

Дата <paymentDates> <unadjustedDate>	Дата платежа по договору.	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
--	---------------------------	-----	------------

#### 20.4.1.7 Определение цены страйк.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <strikePricePerUnit> <currency>	Валюта, в которой выражена цена исполнения.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is04217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is04217-2001-08-15(fpmlrus)</a>
Сумма денежных средств <strikePricePerUnit> <amount>	Цена исполнения за единицу базового актива. <i>В случае барьерного условия может заполняться цена, относительно которой рассчитывается в моменте барьер на дату заключения сделки (текущая рыночная цена, если не оговорено иное).</i>	mfr	Положительное десятичное число.

#### 20.4.2 Вариант выбора «Погодный опцион».

##### 20.4.2.1 Расчетные периоды погодного контракта.

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

##### 20.4.2.2 Номинальная сумма погодного контракта.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта суммы <weatherNotionalAmount> <currency>	Валюта, в которой выражена цена.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is04217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is04217-2001-08-15(fpmlrus)</a>
Сумма денежных средств <weatherNotionalAmount> <amount>	Цена за единицу измерения погодного индекса.	mfr	Положительное десятичное число.

##### 20.4.2.3 Выбор стиля исполнения опциона

Заполняется аналогично п. 20.4.1.4.

##### 20.4.2.4 Валюта расчетов.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Валюта расчетов	Валюта расчетов по договору.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/ver">http://repository.nsd.ru/ver</a>

<settlementCurrency>			<a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is-o4217-2001-08-15(fpmlrus)"><u>ioned/current/taxonomy/is-o4217-2001-08-15(fpmlrus)</u></a>
----------------------	--	--	---

#### 20.4.2.5 Определение даты платежа.

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

#### 20.4.2.6 Уровень страйк погодного индекса.

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

### 20.5 Премия опциона.

#### 20.5.1 Определение плательщика и получателя.

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

#### 20.5.2 Сумма платежа.

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

### 20.6 Дополнительные характеристики.

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

#### 20.6.1 Параметры азиатского опциона.

##### 20.6.1.1 Метод усреднения цены.

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

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

### 20.6.1.2 Период усреднения цены страйка. График наблюдений.

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

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

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

### 20.6.1.3 Период усреднения цены базового актива. График наблюдений.

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

## 20.6.2 Условия барьерного опциона.

### 20.6.2.1 Параметры отлагательного условия.

#### 20.6.2.1.1 Параметры триггерного условия.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Пороговый уровень</b> <level>	Барьерная цена, с достижением которой стороны связали возникновение у покупателя опциона права требовать от продавца исполнения договора (отлагательное условие, knock-in).	mfr	Положительное десятичное число

<b>Тип порогового уровня</b> <triggerType>	Условие достижения барьерной цены (значение рыночной цены по отношению к барьерной цене): “EqualOrLess», “EqualOrGreater”, “Equal”, “Less”, “Greater”.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleTriggerTypeEnum">http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleTriggerTypeEnum</a>
---	--	-----	---

#### 20.6.2.1.2 Выплата по бинарному опциону.

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

#### 20.6.2.2 Параметры отменительного условия.

##### 20.6.2.2.1 Параметры триггерного условия.

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

##### 20.6.2.2.2 Выплата по бинарному опциону.

Заполняется аналогично п. 16.8.2.1.2.

## 21. Анкета товарного свопа (CM053).

### 21.1 Тип продукта.

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

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

## 21.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

## 21.3 Дата начала срока.

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

## 21.4 Дата окончания срока.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
Дата <terminationDate> <unadjustedDate>	Дата истечения срока по договору.	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

## 21.5 Валюта расчетов.

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

## 21.6 Выбор части сделки.

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

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

### 21.6.1 Вариант выбора «Товарная часть контракта своп».

#### 21.6.1.1 Вариант выбора «Часть сделки с фиксированной ценой».

##### 21.6.1.1.1 Определение плательщика и получателя.

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

#### 21.6.1.1.2 Выбор способа указания расчетных периодов.

Вариант выбора «Расчетные даты». Не используется.

Вариант выбора «График расчетных периодов».

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

#### 21.6.1.1.3 Выбор метода определения фиксированной цены.

Не используется.

#### 21.6.1.1.4 Итоговая цена.

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

#### 21.6.1.1.5 Указания номинального количества.

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

#### 21.6.1.1.6 Определение даты платежа.

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

### 21.6.1.2 Вариант выбора «Поставочная часть товарной сделки».

#### 21.6.1.2.1 Товар.

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

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Идентификатор базового актива</b> <instrumentId>	Код базового актива в соответствии со справочником.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versions/current/taxonomy/com">http://repository.nsd.ru/versions/current/taxonomy/com</a>

			<a href="#">modity-instrument-id(nsdrus)</a>
<b>Наименование актива</b> <description>	Полное наименование базового актива (например, вид драгоценного металла, сорт нефти, код фьючерса).	afr	Символьная строка.
<b>Единица измерения</b> <unit>	Единица измерения, соответствующая публикуемой цене базового актива.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/price-quote-units(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/price-quote-units(fpmlrus)</a>
<b>Валюта товарного актива</b> <currency>	Валюта, в которой выражена публикуемая цена базового актива.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)</a>

«Выбор источника публикации цены товарного актива» не используется.

#### 21.6.1.2.2 Определение плательщика и получателя.

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

#### 21.6.1.2.3 Периоды поставки.

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

#### 21.6.1.2.4 Поставляемое количество актива.

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

#### 21.6.1.2.5 Конверсионный фактор.

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

#### 21.6.1.3 Вариант выбора «Часть сделки с плавающей ценой».

### 21.6.1.3.1 Определение плательщика и получателя.

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

### 21.6.1.3.2 Выбор способа указания расчетных периодов.

Заполняется аналогично п. 21.6.1.1.2.

### 21.6.1.3.3 Товар.

Заполняется аналогично п. 21.6.1.2.1.

### 21.6.1.3.4 Указания номинального количества.

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

### 21.6.1.3.5 Даты определения цены.

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

### 21.6.1.3.6 Метод усреднения.

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

### 21.6.1.3.7 Конверсионный фактор.

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

### 21.6.1.3.8 Выбор варианта представления спреда.

Не используется.

### 21.6.1.3.9 Определение даты платежа.

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

### 21.6.1.3.10 Первоначальная цена единицы товарного актива.

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

### 21.6.1.3.11 Максимальная цена единицы товарного актива.

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

### 21.6.1.3.12 Минимальная цена единицы товарного актива.

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

## 21.6.2 Вариант выбора «Поток по сделке погодного свопа».

### 21.6.2.1 Определение плательщика и получателя.

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

### 21.6.2.2 Уровень погодного индекса.

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

### 21.6.2.3 Расчетные периоды погодного контракта.

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

#### 21.6.2.4 Номинальная сумма погодного контракта.

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

#### 21.6.2.5 Расчет погодного индекса.

Не используется.

#### 21.6.2.6 Даты платежа.

Не используется.

## 22. Анкета товарного свопциона (СМ054).

### 22.1 Тип продукта.

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

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

### 22.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

### 22.3 Описание покупателя и продавца.

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

### 22.4 Товарный своп.

Заполняется аналогично пп. 21.3 – 21.6 Анкеты товарного свопа.

## 22.5 Физическое исполнение - Выбор стиля исполнения опциона.

### Вариант выбора «Американский стиль исполнения».

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

### Вариант выбора «Европейский стиль исполнения».

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

## 22.6 Премия.

### 22.6.1 Определение плательщика и получателя.

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

### 22.6.2 Сумма платежа.

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

## 23. Анкета кредитного дефолтного свопа (CM071).

### 23.1 Тип продукта.

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

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

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

### 23.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

### 23.3 Общие условия.

#### 23.3.1 Дата начала срока.

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

#### 23.3.2 Дата истечения срока.

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

#### 23.3.3 Описание покупателя и продавца.

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

#### 23.3.4 Выбор типа референсного обязательства.

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

##### 23.3.4.1 Вариант выбора «Информация о референсном лице».

###### 23.3.4.1.1 Референсное лицо.

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

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

#### 23.3.4.1.2 Выбор варианта определения референсного обязательства.

Параметры обязательства референсного лица.

Вариант выбора «Референсное обязательство» - Облигация.

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

Вариант выбора «Референсное обязательство не включено». Не используется.

#### 23.3.4.2 Вариант выбора «Референсная информация об индексе».

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

#### 23.3.4.3 Вариант выбора «Референсная информация о корзине»

##### 23.3.4.3.1 Референсный пул - Компонент референсного пула.

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

##### 23.3.4.3.1.1 Выбор типа весового коэффициента.

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

Вариант выбора «Количество единиц базового актива».

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

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

Вариант выбора «Вес компонента корзины в процентах».

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

23.3.4.3.1.2 Референсное лицо и обязательство.

Заполняется аналогично п. 23.3.4.1.

23.3.4.3.2 Вариант дефолта.

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

## 23.4 Поток платежей.

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

### 23.4.1 Первоначальный платеж.

Необязательные для заполнения элементы.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Сторона-плательщик</b> <initialPayment> <payerPartyReference>	Сторона, осуществляющая платеж, указанная в этом качестве в Подтверждении.	mfr	Party1; Party2
<b>Сторона-получатель</b> <initialPayment> <receiverPartyReference>	Сторона, получающая платеж, указанная в этом качестве в Подтверждении.	mfr	
<b>Дата платежа</b> <initialPayment> <adjustablePaymentDate>	Дата платежа.	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
<b>Скорректированная дата платежа</b> <initialPayment>	Скорректированная дата платежа, если эта дата попадает на день, не являющийся рабочим. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	mfr	ГГГГ-ММ-ДД

<adjustedPaymentDate>			
<b>Валюта суммы</b> <initialPayment> <paymentAmount> <currency>	Валюта, в которой выражена сумма платежа.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)</a>
<b>Сумма</b> <initialPayment> <paymentAmount> <amount>	Сумма разового платежа.	mfr	Положительное десятичное число.

### 23.4.2 Единый платеж.

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

### 23.4.3 Периодический платеж.

#### 23.4.3.1 Периодичность платежей.

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

#### 23.4.3.2 Дата начала первого периода

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

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

#### 23.4.3.3 Первая дата платежа по договору.

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

#### 23.4.3.4 Последняя регулярная дата платежа по договору.

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

#### 23.4.3.5 Конвенция периодичности дат.

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

#### 23.4.3.6 Выбор способа определения фиксированной суммы.

##### Вариант выбора «Фиксированная сумма».

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

##### Вариант выбора «Расчет фиксированной суммы».

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

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

## 23.5 Условия защиты.

### 23.5.1 Расчетная сумма.

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

### 23.5.2 Кредитные события.

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

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

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

### 23.6 Выбор способа исполнения.

Не используется.

## 24. Анкета кредитного дефолтного свопциона (СМ072).

### 24.1 Тип продукта.

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

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

### 24.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

### 24.3 Описание покупателя и продавца.

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

### 24.4 Тип опциона.

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

### 24.5 Премия.

#### 24.5.1 Определение плательщика и получателя.

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

#### 24.5.2 Сумма платежа.

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

<paymentAmount> <amount>			
-----------------------------	--	--	--

## 24.6 Выбор стиля исполнения.

### 24.6.1 Вариант выбора «Американский стиль исполнения опциона».

#### 24.6.1.1 Начальная дата.

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

#### 24.6.1.2 Дата истечения.

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

#### 24.6.1.3 Множественное исполнение.

Не используется.

### 24.6.2 Вариант выбора «Бермудский стиль исполнения опциона».

#### 24.6.2.1 Даты исполнения бермудского опциона.

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

#### 24.6.2.2 Множественное исполнение.

Не используется.

### 24.6.3 Вариант выбора «Европейский стиль исполнения опциона».

#### 24.6.3.1 Дата истечения.

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

#### 24.6.3.2 Частичное исполнение.

Не используется.

## 24.7 Дополнительные параметры опциона.

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

### 24.7.1 Параметры азиатского опциона.

#### 24.7.1.1 Метод усреднения цены.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения

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

### 24.7.1.2 Период усреднения цены страйка. График наблюдений.

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

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

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

### 24.7.1.3 Период усреднения цены базового актива. График наблюдений.

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

## 24.7.2 Условия барьерного опциона.

### 24.7.2.1 Параметры отлагательного условия.

#### 24.7.2.1.1 Параметры триггерного условия.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Пороговый уровень</b> <level>	Барьерная цена, с достижением которой стороны связали возникновение у покупателя опциона права требовать от продавца исполнения договора (отлагательное условие, knock-in).	mfr	Положительное десятичное число.

<b>Тип порогового уровня</b> <triggerType>	Условие достижения барьерной цены (значение рыночной цены по отношению к барьерной цене): “EqualOrLess», “EqualOrGreater”, “Equal”, “Less”, “Greater”.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleTriggerTypeEnum">http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleTriggerTypeEnum</a>
---	--	-----	---

#### 24.7.2.1.2 Выплата по бинарному опциону.

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

#### 24.7.2.2 Параметры отменительного условия.

##### 24.7.2.2.1 Параметры триггерного условия.

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

##### 24.7.2.2.2 Выплата по бинарному опциону.

Заполняется аналогично п. 24.7.2.1.2.

#### 24.8 Номинальная сумма.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Валюта суммы</b> <notionalAmount> <currency>	Валюта номинальной суммы.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)</a>
<b>Сумма</b> <notionalAmount> <amount>	Совокупная номинальная стоимость договора. В случае опциона на облигации определяется как произведение количества опционов, количества облигаций в одном опционе и номинальной стоимости одной	mfr	Положительное десятичное число.

	облигации. В случае опциона на индекс определяется как произведение количества опционов, значения индекса на дату заключения договора в индексных пунктах и мультипликатора индекса либо как совокупная стоимость договора на дату его заключения в соответствии с данными бухгалтерского учета.		
--	--	--	--

#### 24.9 Объем лота.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Объем лота</b> <optionEntitlement>	Количество базового актива по договору.	mfr	Положительное целое число (1, 2, 3 и т.д.)

#### 24.10 Количество опционов.

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

#### 24.11 Тип расчетов.

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

#### 24.12 Цена исполнения (страйк).

##### Вариант выбора «Спрэд».

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

##### Вариант выбора «Цена исполнения в процентах».

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения
<b>Цена исполнения</b> <price>	Цена исполнения по отношению к цене базового актива или индекса.	mfr	Положительное десятичное число.

#### 24.13 Кредитный дефолтный своп.

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

## 25. Анкета иной сделки (CM081).

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

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

### 25.1 Тип продукта.

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

Значение	Описание
Other	Иной инструмент

### 25.2 Код классификации ПФИ и договоров РЕПО.

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

### 25.3 Обязательство стороны 1.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения	
<b>Код объекта договора</b> <assetCode>	Код базисного актива в соответствии с Приложением 7 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.	mfr	Символьная строка.	
<b>Наименование объекта договора</b> <assetDescription>	Наименование базисного актива. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	afr	Символьная строка.	
<b>Код единицы измерения объекта договора</b> <assetMeasureUnit>	Единица измерения базисного актива. Если указано количество базового актива, в качестве единицы его измерения используются, например, штуки, тонны, баррели, литры. В случае указания номинальной стоимости базисного актива используется код валюты.	afr	Символьная строка.	
<b>Номинальная сумма (количество) объекта договора</b> <assetQuantity>	В зависимости от условий договора указывается количество базисного актива в единицах измерения либо номинальная сумма базисного актива в денежном выражении.	afr	Положительное десятичное число.	
<b>Цена за единицу объекта договора</b> <assetUnitPrice>	<b>Валюта суммы</b> <currency>	Валюта, в которой выражена цена.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is04217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is04217-2001-08-15(fpmlrus)</a>
	<b>Сумма</b> <amount>	Цена за единицу измерения базисного актива. Заполняется, если в качестве «Номинальной суммы (количества) объекта договора» указано количество базисного актива в единицах измерения.	mfr	Положительное десятичное число.
<b>Общая денежная сумма, подлежащая</b>	<b>Валюта суммы</b> <currency>	Валюта, в которой выражена общая денежная сумма, подлежащая уплате Стороне 2.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/cu">http://repository.nsd.ru/versioned/cu</a>

уплате контрагенту <nominalAmount>				<a href="http://sd.ru/versioned/current/taxonomy/is-o4217-2001-08-15(fpmlrus)">rrent/taxonomy/is o4217-2001-08- 15(fpmlrus)</a>
	Сумма <amount>	Общая денежная сумма, подлежащая уплате Стороне 2.	mfr	Положительное десятичное число.
Дата платежа <settlementDate>		Дата платежа по договору.	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Дата поставки объекта договора <deliveryDate>		Дата поставки базисного актива.	afr	ГГГГ-ММ-ДД

## 25.4 Обязательство стороны 2.

Элемент	Описание	Сверка	Формат заполнения	
Код объекта договора <assetCode>	Код базисного актива в соответствии с Приложением 7 к Указанию Банка России от 16.08.2016 № 4104-У.	mfr	Символьная строка.	
Наименование объекта договора <assetDescription>	Наименование базисного актива. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	afr	Символьная строка.	
Код единицы измерения объекта договора <assetMeasureUnit>	Единица измерения базисного актива. Если указано количество базового актива, в качестве единицы его измерения используются, например, штуки, тонны, баррели, литры. В случае указания номинальной стоимости базисного актива используется код валюты.	afr	Символьная строка.	
Номинальная сумма (количество) объекта договора <assetQuantity>	В зависимости от условий договора указывается количество базисного актива в единицах измерения либо номинальная сумма базисного актива в денежном выражении.	afr	Положительное десятичное число.	
Цена за единицу объекта договора <assetUnitPrice>	Валюта суммы <currency>	Валюта, в которой выражена цена.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is-o4217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is-o4217-2001-08-15(fpmlrus)</a>
	Сумма <amount>	Цена за единицу измерения базисного актива. Заполняется, если в качестве «Номинальной суммы (количества) объекта договора» указано количество базисного актива в единицах измерения.	mfr	Положительное десятичное число.
Общая денежная сумма, подлежащая	Валюта суммы <currency>	Валюта, в которой выражена общая денежная сумма, подлежащая уплате Стороне 1.	mfr	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/is</a>

уплате контрагенту <nominalAmount>				o4217-2001-08-15(fpmlrus)
	Сумма <amount>	Общая денежная сумма, подлежащая уплате Стороне 1.	mfr	Положительное десятичное число.
Дата платежа <settlementDate>		Дата платежа по договору.	mfr	ГГГГ-ММ-ДД
Дата поставки объекта договора <deliveryDate>		Дата поставки базисного актива.	afr	ГГГГ-ММ-ДД

## 25.5 Дополнительная информация.

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

## V. Отчет об уплате маржевых сумм (CM092).

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

### 1. Регистрационный номер отчета, присвоенный участником.

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

Элемент	Описание	Формат заполнения
Участник <partyReference href="TradeRepository"/> <partyReference href="Party1"/> <partyReference href="Party2"/>	Ссылка на участника: <ul style="list-style-type: none"> <li>Репозитарий (НКО АО НРД);</li> <li>Сторона 1;</li> <li>Сторона 2.</li> </ul>	TradeRepository; Party 1; Party 2.
Регистрационный номер <tradeId>	Идентификатор Отчета об уплате маржевых сумм, присвоенный соответствующим участником. <ul style="list-style-type: none"> <li>Для Репозитария при первичной регистрации Отчета указывается "NONREF". В случае направления сообщения о внесении изменений в Отчет указывается идентификатор, присвоенный Репозитарием в</li> </ul>	Цифры и буквы латинского алфавита, не более 35 символов. Например, CSA1234567890

	<p>соответствии с Извещением о регистрации (RM001) Отчета.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Для Стороны 1 / Стороны 2 указывается идентификатор Отчета об уплате маржевых сумм, присвоенный Стороной 1 (Стороной 2). Если идентификатор, присвоенный контрагентом, неизвестен Стороне 1 (Стороне 2), в отношении Стороны 2 (Стороны 1) указывается “NONREF”. Для собственного номера, присвоенного стороной, значение “NONREF” не допускается. Если Отчет подается от обеих сторон (в поле &lt;reportParty&gt; указано значение “all”), идентификаторы, присвоенные Стороной 1 и Стороной 2, должны совпадать.</li> </ul>	
<p><b>Регистрационный номер генерального соглашения</b> &lt;partyReference href="TradeRepository"/&gt; &lt;linkId&gt;</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Для Репозитория указывается идентификатор Анкеты генерального соглашения (CM010), в рамках которого заключен договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, присвоенный Репозитарием в соответствии с Извещением о регистрации (RM001) данной Анкеты.</li> <li>Для Стороны 1 и Стороны 2 не заполняется.</li> </ul>	<p>Первые два символа – “MA”, далее 10 цифр. Например, MA0000000123</p>
<p><b>Регистрационный номер договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств</b> &lt;originatingTradeId&gt; &lt;tradeId&gt;</p>	<p>Идентификатор договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, присвоенный соответствующей стороной в соответствии с Анкетой договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств (CM015).</p> <p>Если Анкета договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств (CM015) не зарегистрирована, указываются собственные идентификаторы, присвоенные Стороной 1 и Стороной 2, а в качестве значения идентификатора, присвоенного Репозитарием, указывается “NONREF”. При этом для собственных идентификаторов, присвоенных Стороной 1 и Стороной 2, значение “NONREF” не допускается.</p> <p><i>Заполняется обязательно.</i></p>	<p>Цифры и буквы латинского алфавита, не более 35 символов. Например, CSA1ID</p>

## 2. Сторона, от имени которой направлено сообщение.

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

## 3. Обеспечение исполнения обязательств.

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

### 3.1 Дата расчета маржевой суммы.

Элемент	Описание	Формат заполнения
<p><b>Дата расчета маржевой суммы</b> &lt;valuationDate&gt;</p>	<p>Фактическая дата возникновения требования и (или) обязательства по выплате маржевых сумм.</p>	<p>ГГГГ-ММ-ДД</p>

	<p>Для успешной регистрации Отчета об уплате плавающих маржевых сумм необходимо следовать следующим правилам:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Даты в полях &lt;asofDate&gt; и &lt;valuationDate&gt; должны быть указаны в одном календарном месяце либо совпадать.</li> <li>• Если Отчет подается от имени каждой из сторон (Стороны 1 и Стороны 2) независимо, то на одну дату расчета допускаются разные значения маржевых сумм в Отчетах, имеющих одинаковые идентификаторы, присвоенные соответствующими сторонами.</li> <li>• В рамках одной даты расчета маржевой суммы осуществляется проверка на отличие идентификаторов Отчета &lt;tradeId&gt;, присвоенных соответствующими участниками, от идентификаторов, указанных в ранее зарегистрированных сообщениях.</li> </ul>	
--	---	--

### 3.2 Общая маржевая сумма.

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

### 3.3 Накопленная маржевая сумма.

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

### 3.4 Начальная маржевая сумма.

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

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

### 3.5 Плавающая маржевая сумма.

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

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

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

### 1. Регистрационный номер отчета, присвоенный участником.

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

Элемент	Описание	Формат заполнения
<b>Участник</b> <partyReference href="TradeRepository"/> <partyReference href="Party1"/> <partyReference href="Party2"/>	Ссылка на участника: <ul style="list-style-type: none"> <li>Репозитарий (НКО АО НРД);</li> <li>Сторона 1;</li> <li>Сторона 2.</li> </ul>	TradeRepository; Party 1; Party 2.
<b>Регистрационный номер</b> <tradeId>	Идентификатор Отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости, присвоенный соответствующим участником.	Цифры и буквы латинского

	<ul style="list-style-type: none"> <li>Для Репозитария при первичной регистрации Отчета указывается “NONREF”. В случае направления сообщения о внесении изменений указывается идентификатор, присвоенный Репозитарием в соответствии с Извещением о регистрации (RM001) Отчета.</li> <li>Для Стороны 1 и Стороны 2 указывается идентификатор Отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости, присвоенный Стороной 1 (Стороной 2). Если идентификатор, присвоенный контрагентом, неизвестен Стороне 1 (Стороне 2), в отношении Стороны 2 (Стороны 1) указывается “NONREF”. Для собственного номера, присвоенного стороной, значение “NONREF” не допускается. Если Отчет подается от обеих сторон (в поле &lt;reportParty&gt; указано значение “all”), идентификаторы, присвоенные Стороной 1 и Стороной 2, должны совпадать.</li> </ul>	алфавита, не более 35 символов.
--	---	---------------------------------

## 2. Идентификатор договора о расчете справедливой стоимости.

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

## 3. Тип оценки стоимости.

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

## 4. Сторона, от имени которой направлено сообщение.

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

## 5. Справедливая/оценочная стоимость.

Блок <markToMarketDetails> повторяется, если в рамках одного Отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости предоставляется информация о *нескольких датах* оценки (<valuationDate>).<sup>13</sup>

<sup>13</sup> Информация о справедливой (оценочной) стоимости может направляться как в течение месяца, в котором осуществляется переоценка (по мере ее проведения), так и не позднее пяти рабочих дней месяца, следующего за месяцем, в котором осуществлена переоценка (за каждый день месяца, в который производилась соответствующая переоценка).

## 5.1 Дата оценки.

Элемент	Описание	Формат заполнения
Дата оценки <valuationDate>	<p>Фактическая дата оценки справедливой (оценочной) стоимости.</p> <p>Для успешной регистрации Отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости необходимо следовать следующим правилам:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Даты в полях &lt;asofDate&gt; и &lt;valuationDate&gt; должны быть указаны в одном календарном месяце либо совпадать.</li> <li>Если Отчет подается от имени каждой из сторон (Стороны 1 и Стороны 2) независимо, то на одну дату оценки допускаются разные значения справедливой (оценочной) стоимости в Отчетах, имеющих одинаковые идентификаторы, присвоенные соответствующими сторонами.</li> <li>В рамках одной даты оценки осуществляется проверка на отличие идентификаторов Отчета &lt;tradeId&gt;, присвоенных соответствующими участниками, от идентификаторов, указанных в ранее зарегистрированных сообщениях.</li> </ul>	ГГГГ-ММ-ДД
Дата и время оценки <valuationDateTime>	Дата и время расчета справедливой (оценочной) стоимости договора. Заполняется, если зафиксировано время, на которое приводится информация о справедливой (оценочной) стоимости.	YYYY-MM-DDThh:mm:ss

## 5.2 Справедливая/оценочная стоимость.

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

Элемент	Описание	Формат заполнения
Идентификатор сделки <tradeId>	Идентификатор договора, в отношении которого определяется справедливая (оценочная) стоимость, присвоенный Репозитарием в соответствии с Извещением о регистрации (RM001) Анкеты договора. <sup>14</sup>	Цифры и буквы латинского алфавита, не более 35 символов.
Справедливая/оценочная стоимость <amount>	Значение справедливой (оценочной) стоимости договора на фактическую дату оценки. Отрицательное значение указывается со знаком «минус».	Десятичное число.

<sup>14</sup> Допускается указание идентификатора договора, зарегистрированного только на уровне Журнала учета сообщений, то есть не попавшего в реестр договоров на момент регистрации Отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости (например, если контрагент не подтвердил соответствующую Анкету договора). В этом случае идентификатор договора заполняется в соответствии с Уведомлением о нахождении Анкеты в состоянии «Ожидание» (RM007).

<b>Валюта</b> <currency>	Валюта, в которой выражена справедливая (оценочная) стоимость.	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taconomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taconomy/iso4217-2001-08-15(fpmlrus)</a>
-----------------------------	--	---

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

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

### **1. Регистрационный номер отчета, присвоенный участником.**

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

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

	<ul style="list-style-type: none"> <li>Для Стороны 1 и Стороны 2 не заполняется.</li> </ul>	
--	---	--

## 2. Особые параметры.

Элемент	Описание	Формат заполнения
Дата сделки <tradeDate>	Дата заключения договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм.	ГГГГ-ММ-ДД
Тип договора <tradeType>	Наименование организации, опубликовавшей стандартную документацию для договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм. Для Стандартных условий договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, утвержденных Национальной ассоциацией участников фондового рынка, Национальной валютной ассоциацией и Ассоциацией российских банков, используется значение “NASMP”.	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/master-agreement-organization(nsdrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/master-agreement-organization(nsdrus)</a>
Тип обеспечения по договору <collateralType>	Тип обеспечения (маржинальных требований) согласно договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм. “FC” – полное обеспечение (используется одновременно первоначальная и плавающая маржевая сумма). “PC” – частичное обеспечение (используется только плавающая маржевая сумма). “OC” – одностороннее обеспечение (первоначальная и (или) плавающая маржевая сумма вносится только одной стороной). “U” – договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм не заключен.	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleMarginType">http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleMarginType</a>
Форма обеспечения по договору <collateralForm>	Форма обеспечения согласно договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм. “Т” – обязательства по данному договору обеспечиваются индивидуально. “G” – обязательства по данному договору обеспечиваются совокупно с обязательствами по иным заключенным договорам в составе портфеля (кумулятивное обеспечение) – например, в рамках одного генерального соглашения. “U” – договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм не заключен.	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleCollateralForm">http://repository.nsd.ru/versioned/current/reference/types/simpleCollateralForm</a>
Способ подтверждения сделки <confirmationMethod>	Способ подтверждения Анкеты: “MXME” - последовательное либо комбинированное подтверждение, “MATH” - встречное подтверждение.	MXME; MATH.
Дополнительная информация о договоре <additionalInformation>	Дополнительная информация о договоре в формате текстовой строки. <i>Необязательный для заполнения элемент.</i>	Символьная строка

## **VIII. Анкета о состоянии обязательств по договорам (СМ093).**

Анкета о состоянии обязательств по договорам (СМ093) предоставляется в случае изменения состояния обязательств или прекращения обязательств по договору не позднее трех рабочих дней с даты события, указанного в поле «Статус обязательств по сделкам» (<tradeObligationStatus>).<sup>15</sup> Информация об изменении кода состояния обязательств по договору должна быть предоставлена не позднее трех рабочих дней с даты вступления в силу соответствующих изменений и/или наступления соответствующего события.<sup>16</sup>

### **1. Перечень сделок для отчета (Выбор типов идентификаторов).**

Выбор сделок, по которым предоставляется информация о состоянии обязательств.

#### **1.1 Вариант выбора «Все сделки».**

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

#### **1.2 Вариант выбора «Идентификаторы сделок».**

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

#### **1.3 Вариант выбора «Идентификаторы генеральных соглашений».**

Элемент	Описание	Формат заполнения
Идентификационный номер генерального соглашения <masterAgreementId>	Указывается идентификатор генерального соглашения, присвоенный Репозитарием в соответствии с Извещением о регистрации (RM001) соответствующей Анкеты генерального соглашения. Если предоставляется информация о нескольких генеральных соглашениях, элемент повторяется. По закрытым Анкетам генерального соглашения информация не предоставляется. Определяет, что информация о состоянии обязательств предоставляется по всем зарегистрированным договорам в	Первые два символа – “MA”, далее 10 цифр. Например, MA0000000123

<sup>15</sup> Если в Анкете договора элемент «Автоматическое закрытие сделки в дату окончания срока действия договора» (<automaticExecution>) имеет значение “Y”, соответствующая Анкета о состоянии обязательств по договорам (СМ093) не предоставляется. См. [Инструкцию по автоматической deregистрации договоров в реестре](#).

<sup>16</sup> Например, если исполнение обязательств по договору просрочено, в течение трех рабочих дней с плановой даты исполнения договора предоставляется СМ093 со статусом “С”, а в течение трех рабочих дней с фактической даты исполнения договора предоставляется СМ093 со статусом “Т”.

	рамках указанного генерального соглашения. При этом отправитель Анкеты СМ093 должен иметь полномочия Информировующего лица по всем типам договоров в рамках данного генерального соглашения.	
--	--	--

## 2. Статус обязательств по сделкам.

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

## IX. Анкета генерального соглашения (СМ010).

Условия генерального соглашения.

Элемент	Описание	Формат заполнения
<b>Тип генерального соглашения</b> <masterAgreementType>	<p>Тип генерального соглашения. Если форма генерального соглашения разработана сторонами самостоятельно, указывается “Bespoke”. Если необходимое значение отсутствует в справочнике, указывается “Other”.</p>	Значение из справочника <a href="http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/master-agreement-type(nsdrus)">http://repository.nsd.ru/versioned/current/taxonomy/master-agreement-type(nsdrus)</a>

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

## **Х. Заявление о назначении Информирующих лиц (СМ016).**

Сведения об Информирующем лице предоставляются клиентом Репозитария в Заявлении о назначении Информирующих лиц (СМ016). В Заявлении указываются все Информирующие лица с соответствующими полномочиями. Назначение каждого Информирующего лица в отдельном Заявлении не допускается.

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

- 1) один репозитарный код – по умолчанию считается, что функции Информирующего лица клиент выполняет самостоятельно;<sup>17</sup>
- 2) несколько репозитарных кодов – по умолчанию считается, что функции Информирующего лица клиент выполняет самостоятельно по каждому репозитарному коду.<sup>18</sup> Для распределения полномочий по конкретным репозитарным кодам (собственным кодам или кодам иных клиентов)

<sup>17</sup> При самостоятельном выполнении функций Информирующего лица предоставление Заявления о назначении Информирующих лиц не требуется.

<sup>18</sup> Если в Анкете договора Сторона указана с ее первым репозитарным кодом (Код 1), то в качестве репозитарного кода Отправителя данной Анкеты должен быть указан тот же репозитарный код (Party = Sender = Код 1). Соответственно, если контрагент укажет в Анкете договора данную Сторону с ее вторым репозитарным кодом (Код 2), то Репозитарий направит Анкету договора для подтверждения на Код 2, и только с этого кода Сторона сможет согласовать данную Анкету (Party = Sender = Код 2).

клиенту необходимо направить Заявление о назначении Информировующих лиц от каждого репозитарного кода с указанием соответствующих реквизитов.

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

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

## 1. Параметры сообщения.

### 1.1. Сторона.

Элемент	Описание	Формат заполнения
<b>Идентификационный код</b> <party id="Party"> <partyId>	Репозитарный код клиента – отправителя Заявления в соответствии со Справочником участников Репозитария (столбец «Идентификационный код / Identification Code»).	Значение из справочника <a href="https://www.nsd.ru/ru/services/repository/participants">https://www.nsd.ru/ru/services/repository/participants</a>
<b>Наименование участника</b> <party id="Party"> <partyName>	Указывается «Краткое наименование» в соответствии со Справочником участников Репозитария.	

### 1.2. LEI/SWIFT/INN стороны.

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

### 1.3. Отправитель.

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

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

#### 1.4. LEI/SWIFT/INN отправителя.

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

#### 1.5. Дата совершения отчитываемого события.

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

#### 1.6. Номер сообщения.

Элемент	Описание	Формат заполнения
<b>Номер сообщения</b> <messageId>	Произвольный уникальный идентификатор сообщения. В Web-кабинете генерируется автоматически при отправке сообщения.	Цифры и буквы латинского алфавита, не более 35 символов.

#### 1.7. Уникальный код цепочки сообщений.

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

## 2. Особые параметры.

### 2.1 Регистрационный номер заявления.

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

## 2.2 Информировующее лицо.

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

Элемент	Описание	Формат заполнения
<b>Идентификатор участника</b> <party id="ReportingAgent1"> <partyId> <sup>19</sup>	Репозитарный код Информировующего лица в соответствии со Справочником участников Репозитария (столбец «Идентификационный код / Identification Code»).	Значение из справочника <sup>20</sup> <a href="https://www.nsd.ru/ru/services/repository/participants">https://www.nsd.ru/ru/services/repository/participants</a>
<b>Наименование участника</b> <party id="ReportingAgent1"> <partyName>	Указывается «Краткое наименование» в соответствии со Справочником участников Репозитария.	
<b>Идентификатор участника</b> <party id="ReportingAgent1"> <partyId>	Указывается международный код идентификации юридического лица (Legal Entity Identifier, LEI) – Информировующего лица.	Например, LEI_253400M18U5TB02TW421

## 2.3 Тип отчетности информировующего лица.

### 2.3.1. Выбор контрагента.

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

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

- 1) получает право направлять информацию в Репозитарий по всем контрагентам и в рамках всех Анкет генеральных соглашений клиента, полномочия по которым не переданы другим Информировующим лицам;
- 2) в случае получения полномочий отчитываться по генеральным соглашениям (в поле «Тип документа» <documentType> указано значение “MasterAgreement”): получает возможность просматривать в веб-кабинете Репозитария все Анкеты договоров, одной из сторон которых является клиент;
- 3) в случае получения полномочий отчитываться по Анкетам договоров (в поле «Тип документа» <documentType> указано значение, отличное от “ALLD”, “MasterAgreement”, “creditSupportAnnex”, “transfersAndExecution”, “markToMarketValuation”): получает возможность просматривать в веб-кабинете Репозитария все Анкеты генеральных соглашений, одной из сторон которых является клиент;
- 4) в случае получения полномочий отчитываться по всем видам договоров (в поле «Тип документа» <documentType> указано значение “ALLD”): получает возможность просматривать в веб-кабинете Репозитария все Анкеты договоров и генеральных соглашений, одной из сторон которых является клиент.

<sup>19</sup> Ссылка на идентификатор Информировующего лица задаётся по правилу "ReportingAgentN", где "N" - порядковый номер. Например, ReportingAgent1, ReportingAgent2.

<sup>20</sup> Изменение данных Информировующего лица в Справочнике участников репозитария (дополнительного идентификатора участника и/или наименования участника) не требует внесения изменений в Заявление.

### Вариант выбора «Код идентификации генерального соглашения».

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

Элемент	Описание	Формат заполнения
<b>Код идентификации генерального соглашения</b> <linkId>	Идентификатор Анкеты генерального соглашения (СМ010), присвоенный Репозитарием в соответствии с Извещением о регистрации (RM001). Элемент повторяется для указания нескольких генеральных соглашений.	Первые два символа – «МА», далее 10 цифр. Например, МА0000000123

### Вариант выбора «Контрагент».

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

Элемент	Описание	Формат заполнения
<b>Идентификатор участника</b> <party id="CounterParty1"> <partyId> <sup>21</sup>	Репозитарный код контрагента в соответствии со Справочником участников Репозитария (столбец «Идентификационный код / Identification Code»). Если контрагент не является клиентом Репозитария НРД, указывается «NONREF».	Значение из справочника <sup>22</sup> <a href="https://www.nsd.ru/ru/services/repository/participants">https://www.nsd.ru/ru/services/repository/participants</a>
<b>Наименование участника</b> <party id=" CounterParty1"> <partyName>	Наименование контрагента. Для клиентов Репозитария НРД указывается «Краткое наименование» в соответствии со Справочником участников Репозитария. Для физических лиц указывается фамилия, имя и отчество (при наличии) на русском или английском языке.	
<b>Идентификатор участника</b> <party id=" CounterParty1"> <partyId>	Для юридических лиц, обязанных предоставлять информацию в репозитарий, указывается международный код идентификации юридического лица (Legal Entity Identifier, LEI). Для физических лиц указывается номер паспорта (PASS) или страховой номер индивидуального лицевого счета, СНИЛС (SNILS). Например, SNILS_XXX-XXX-XXX XX (X – цифры от 0 до 9). Для юридических лиц, не обязанных предоставлять информацию в репозитарий и не имеющих кода LEI, применимы следующие типы кодов: для российских юридических лиц – ИНН (INN), для иностранных юридических лиц – код SWIFT (SWIFT), коды информационных систем Bloomberg (BLOOM)	Например, LEI_253400M18U5TB02TW421

<sup>21</sup> Ссылка на идентификатор контрагента задаётся по правилу "CounterPartyN", где "N" - порядковый номер. Например, CounterParty1, CounterParty2.

<sup>22</sup> Изменение данных контрагента в Справочнике участников репозитария (дополнительного идентификатора участника и/или наименования участника) не требует внесения изменений в Заявление. Изменение данных контрагента, не являющегося клиентом Репозитария НРД, после регистрации Заявления о назначении Информирующих лиц требует внесения соответствующих изменений в Заявление (направления обновленного Заявления).

	и Thomson Reuters (THRTR) либо иной код (OWN).	
--	--	--

### 2.3.2. Тип отчетности информирующего лица.

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

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

## **XI. Заявление об отказе от функций Информированного лица (СМ017).**

Информированное лицо, имеющее действующие полномочия, может предоставить в Репозиторий Заявление об отказе от функций Информированного лица (СМ017).<sup>23</sup> Заявление может быть подано только Информированным лицом, ранее зарегистрированным в качестве Информированного лица по Заявлению о назначении Информированных лиц (СМ016) и подтвердившим свои полномочия.

### **1. Параметры сообщения.**

См. Заявление о назначении Информированных лиц (СМ016).

### **2. Особые параметры.**

#### **2.1 Регистрационный номер заявления.**

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

#### **2.2 Сторона по сделкам.**

<b>Элемент</b>	<b>Описание</b>	<b>Формат заполнения</b>
<b>Идентификационный код</b> <party id="AgreementParty1"> <partyId> <sup>24</sup>	Репозитарный код Стороны-клиента Репозитария, Информированное лицо которой отказывается от выполнения соответствующих функций, в соответствии со Справочником участников Репозитария (столбец «Идентификационный код / Identification Code»).	Значение из справочника <a href="https://www.nsd.ru/ru/services/repository/participants">https://www.nsd.ru/ru/services/repository/participants</a>
<b>Наименование участника</b> <party id="AgreementParty1"> <partyName>	Указывается «Краткое наименование» клиента в соответствии со Справочником участников Репозитария.	
<b>LEI участника</b> <party id="AgreementParty1"> <partyId>	Для юридических лиц, обязанных предоставлять информацию в репозитарий, указывается международный код идентификации юридического лица (Legal Entity Identifier, LEI). Для физических лиц указывается номер паспорта (PASS) или страховой номер индивидуального лицевого счета, СНИЛС (SNILS). Например, SNILS_XXX-XXX-XXX XX (X – цифры от 0 до 9). Для юридических лиц, не обязанных предоставлять информацию в репозитарий и не имеющих кода LEI, применимы следующие типы кодов: для российских юридических лиц – ИНН (INN), для иностранных юридических лиц – код SWIFT (SWIFT), коды информационных систем Bloomberg (BLOOM) и Thomson Reuters (THRTR) либо иной код (OWN).	Например, LEI_253400M18U5TB02TW421

<sup>23</sup> Для взаимодействия с Репозитарием клиент, Информированное лицо которого отказалось от выполнения соответствующих функций, обязан назначить новое Информированное лицо либо принять на себя выполнение функций Информированного лица путем направления в Репозитарий Заявления о назначении информируемых лиц с указанием реквизитов нового Информированного лица и его полномочий либо с указанием собственных реквизитов.

<sup>24</sup> Ссылка на идентификатор задается по правилу "AgreementPartyN", где "N" - порядковый номер. Например, AgreementParty1, AgreementParty2.

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

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

### 1. Параметры запроса.

#### 1.1. Стороны запроса

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

## 1.2. Выбор варианта подключения

Элемент	Описание	Формат заполнения
Сторона <requestToConnect>	Запрос на подключение к сервису форматно-логического контроля	<Да><true>
<requestToDisconnect>	Запрос на отключение от сервиса форматно-логического контроля	<Да><true>

## ХIII. Правила формирования сообщений в bulk-формате (СМ083, СМ084, СМ085)

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

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

### 1. Особенности заполнения и отправки сообщений

Сделки объединяются в сообщении по следующим параметрам:

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

Для предоставления сообщений по формам в Репозиторий для:

- СМ083 – `repoBulkReport` в Заявлении СМ016 Информирующее лицо должно быть определено по типам договоров («documentType»): ALLD или репо (без детализации по параметрам «counterParty» и «executionVenueType»).
- СМ084 – `fxSwapBulkReport` в Заявлении СМ016 Информирующее лицо должно быть определено по типам договоров («documentType»): ALLD или fxSwap (без детализации по параметрам «counterParty» и «executionVenueType»).
- СМ085 – `fxSingleLegBulkReport` в Заявлении СМ016 Информирующее лицо должно быть определено по типам договоров («documentType»): ALLD или fxSingleLeg (без детализации по параметрам «counterParty» и «executionVenueType»).

### 1.1. Порядок заполнения информации внутри сообщений

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

Данные группы состоят из двух параметров:

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

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

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

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

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

**! Важно:** если Стороны по сделке совпадают, группа Counterparty (для «CounterpartyN») заполняется аналогично группе party (для «Party1»).

В сообщениях группа party должна заполняться 4 раза (отдельно для «Party1», «Party2», «Sender» и «TradeRepository»).

Группа party для «Party1» заполняется данными о Стороне - клиенте репозитория НРД, от имени которой направляется отчет.

**! Важно:** по концепции формата Party1 – это профучастник, совершающий технические сделки для своих клиентов.

Группа party для «Party2» заполняется по правилу:

- Если bulk-сообщение отправляется по сделкам вне рамок Генерального соглашения (далее – ГС), то в полях «partyId» и «partyName» указывается значение NONREF (поля «classification», «country», «organizationType» не заполняются). Контрагент(ы) по сделкам, включенным в отчет, указывается(ются) в группе «counterparty» в части сообщения, описывающем параметры сделок.
- Если bulk-отчет отправляется по сделкам в рамках ГС, то заполняется данными о Стороне-контрагенте репозитория НРД, в соответствии с ГС (указываются 2 кода «partyId», «partyName», «classification», «country», «organizationType»). При этом группа «counterparty» в части сообщения, описывающем параметры сделок, должна совпадать с данными контрагента («Party2») и может быть заполнена только один раз.

**! Важно:** контрагенты (Counterparty1+n) по текущей реализации – не клиенты Репозитория, но клиенты брокера – Party1, которым брокер предоставляет заемные средства.

Группа party для «Sender» заполняется данными об Информирующем лице Стороны клиента репозитория, указанной в группе party («Party1»), от имени которого направляется отчет.

Полномочия Информирующего лица («Sender») на предоставление соответствующего отчета определяются на основании зарегистрированного Заявления о назначении информирующих лиц (СМ016) Стороны-клиента («Party1»).

В bulk-сообщениях стандартная группа элементов с информацией о клиентах сторон «clientDetails» не заполняется. Вместо него форматом предусмотрен опциональный множественный элемент «client» - «Клиент стороны» на уровне каждой сделки, входящей в отчет.

**! Важно:** в подразделе «Клиент стороны» могут перечисляться клиенты профучастника (Party1), которые не являются сторонами по сделке, но, в интересах которых, или за счет которых, брокер мог совершать сделки, давая заемные средства.

## 2. Коррекция сообщения балк-формата

Операция коррекции доступна для изменения информации в зарегистрированной анкете СМ083-СМ085 в реестре.

В зарегистрированную анкету xml-сообщения добавляются признаки коррекции `<amendment xsi:type="nsdext:TradeAmendmentContent">` и `<nsdext:correctRegisteredInfo>true</nsdext:correctRegisteredInfo>` в конце блока amendment.

При этом, есть возможность скорректировать:

- информацию об отдельных сделках внутри сообщения без необходимости указания всех договоров;
- информацию в общих параметрах сообщения, например, дату сделки, при этом потребуется указать заново всю информацию по всем ранее зарегистрированным сделкам в отчете.

### Пример сообщения:

```
</header>
  <isCorrection>>false</isCorrection>
  <correlationId correlationIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme">[MC004400000]-
[2016]-[24wds76s1wdddds3d1e]</correlationId>
  <asOfDate>2016-10-06</asOfDate>
  <amendment xsi:type="nsdext:TradeAmendmentContent">
    <trade xsi:type="nsdext:TradeNsd">
      <tradeHeader>
        ...
        Информация о договорах
        ....
      </amendment>
    <party id="Party1">
```

**!Важно:** Операция коррекции не допускает исключение ошибочно отчитанных сделок в сообщении. Если требуется удалить часть зарегистрированных сделок в отчете, необходимо удалить все сообщение целиком с помощью подачи анкеты СМ093 со статусом – R и подать сообщение заново с корректным составом сделок.

### 3. Пример заполнения xml-сообщения для CM083 - репоBulkReport.

```
<nonpublicExecutionReport
xmlns="http://www.fpml.org/FpML-5/recordkeeping"
xmlns:nsdext="http://www.fpml.org/FpML-5/recordkeeping/nsd-ext"
xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
xmlns:fpmlext="http://www.fpml.org/FpML-5/ext"
xsi:schemaLocation="http://www.fpml.org/FpML-5/recordkeeping fpml-recordkeeping-merged-
schema.xsd http://www.fpml.org/FpML-5/recordkeeping/nsd-ext nsd-ext-merged-schema.xsd"
fpmlVersion="5-4" actualBuild="5">
<!--Заголовок сообщения.-->
<header>
  <!--Номер сообщения-->
  <messageId messageIdScheme="">MesIdCM083</messageId>
  <!--Отправитель сообщения-->
  <sentBy>P00000000111</sentBy>
  <!--Получатель сообщения-->
  <sendTo>NDC000000000</sendTo>
  <!--Время создания сообщения-->
  <creationTimestamp>2016-07-01T19:03:13</creationTimestamp>
  <!--Версия спецификации.-->
  <implementationSpecification>
    <!--Версия спецификации.-->
    <version>4.2</version>
  </implementationSpecification>
</header>
<!--Признак корректирующего сообщения-->
<isCorrection>>false</isCorrection>
<!--Уникальный код цепочки сообщений-->
<correlationId correlationIdScheme="">[P00000000111]-[2016]-[MesIdCM083]</correlationId>
<!--Дата совершения отчитываемого события-->
<asOfDate>2016-07-01</asOfDate>
<!--Регистрация Анкеты-->
<trade xsi:type="nsdext:TradeNsd">
<!--Общая информация об отчете.-->
<tradeHeader>
  <!--Идентификатор отчета, присвоенный Репозитарием.-->
  <partyTradeIdentifier>
    <!--Участник.-->
    <partyReference href="TradeRepository"/>
    <!--Идентификатор отчета.-->
    <tradeId>NONREF</tradeId>
  </partyTradeIdentifier>
  <!--Идентификатор отчета, присвоенный Стороной1-->
  <partyTradeIdentifier>
    <!--Участник.-->
    <partyReference href="Party1"/>
    <!--Идентификатор отчета.-->
    <tradeId>CM083-Party-NUM1</tradeId>
  </partyTradeIdentifier>
  <!--Идентификатор отчета, присвоенный Стороной2-->
  <partyTradeIdentifier>
    <!--Участник.-->
    <partyReference href="Party2"/>
    <!--Идентификатор отчета.-->
    <tradeId>NONREF</tradeId>
  </partyTradeIdentifier>
  <!--Информация стороны о сделке.-->
  <partyTradeInformation>
    <!--Участник.-->
    <partyReference href="TradeRepository"/>
    <!--Регулятивный режим отчетности.-->
    <reportingRegime>
```

```

        <!--Наименование правил регулятивной отчетности.-->
        <name>RussianFederation</name>
    </reportingRegime>
    <nonStandardTerms>true</nonStandardTerms>
</partyTradeInformation>
<!--Дата сделки.-->
<tradeDate>2015-12-01</tradeDate>
</tradeHeader>
<!--Отчет по сделкам репо.-->
<nsdext:repoBulkReport>
    <!--Тип продукта.-->
    <productType>Other</productType>
    <!--Код классификации ПФИ.-->
    <productId>UKWN</productId>
    <!--Статус исполнения обязательств-->
    <nsdext:tradesObligationStatus>Т</nsdext:tradesObligationStatus >
    <!--Дата расчетов по первой части.-->
    <nsdext:spotLegSettlementDate>2016-07-01</nsdext:spotLegSettlementDate>
    <!--Дата поставки по первой части. Блок добавляется с 17.08.2020-->
    <nsdext:spotLegDeliveryDate>2016-07-01</nsdext:spotLegDeliveryDate>
    <!--Дата расчетов по второй части -->
    <nsdext:forwardLegSettlementDate>2016-07-01</nsdext:forwardLegSettlementDate>
    <!--Дата поставки по второй части. Блок добавляется с 17.08.2020-->
    <nsdext:forwardLegDeliveryDate>2016-07-01</nsdext:forwardLegDeliveryDate>
    <!--Параметры контракта (1).-->
    <nsdext:repos>
        <!--Контрагент 1.-->
        <nsdext:counterparty id="Counterparty1">
            <!--Идентификатор участника – репозитарный код.-->
            <partyId>NONREF</partyId>
            <!--Идентификатор участника – доп. Код (LEI, INN...)-->
            <partyId>SNILS_123-456-789 01</partyId>
            <!--Наименование участника.-->
            <partyName>Контрагент 1</partyName>
            <!--Вид экономической деятельности-->
            <classification>Other</classification>
            <!--Страна.-->
            <country>RU</country>
            <!--Тип лица-->
            <organizationType>P</organizationType>
        </nsdext:counterparty>
        <!--Детали контракта 1 по контрагенту 1.-->
        <nsdext:repoDetails>
            <!--Идентификаторы сделки:
            "r" - Идентификатор сделки, присвоенный репозитарием;
            "p" - Идентификатор сделки, присвоенный участником;
            "u" - УТИ сделки;
            "pid" - Код классификации ПФИ-->
            <nsdext:tradel r="NONREF" p="TRADE1" u="UTI1" pid="REOFF"/>

            <!--Тип стороны.-->
            <nsdext:side>Buyer</nsdext:side>
            <!--Фиксированная ставка репо.-->
            <nsdext:rate>0.0512</nsdext:rate>
            <!--Сумма расчетов по первой части договора:
            "a" – Сумма
            "с" – Валюта-->
            <nsdext:spot a="1000" c="RUB"/>
            <!--Сумма расчетов по второй части договора:
            "a" – Сумма
            "с" – Валюта-->
            <nsdext:forward a="1000.14" c="RUB"/>

```

```

        <!--Акция.
"i" - Код базисного актива
"n" - Количество ценных бумаг
"p" - Цена единицы актива
"с" - Валюта цены-->
        <nsdext:equity id="123456" n="5" p="200" c="RUB"/>
        <!--Клиент Стороны.
"i" - Идентификатор
"t" - Тип клиента
"n" - Наименование
"с" - Страна-->
        <nsdext:client i="SNILS_000-000-000 01" t="F" n="Иванов ИИ" c="RU"/>
        <nsdext:client i="SNILS_000-000-000 02" t="F" n="Петров ПП" c="RU"/>
    </nsdext:repoDetails>
    <!--Детали контракта 2 по контрагенту 1-->
    <nsdext:repoDetails>
        <nsdext:tradelId r="NONREF" p="TRADE11" u="UTI2" pid="RDOLF"/>
        <nsdext:side>Buyer</nsdext:side>
        <!--Плавающая ставка репо
"f" - Плавающая ставка репо
"t" - Мультипликатор периода ставки
"p" - Тип временного периода ставки
"i" - Начальное значение плавающей ставки-->
        <nsdext:floatingRate t="2" p="D" i="0.0512">RUB-RUONIA-OIS-
COMPOUND</nsdext:floatingRate>
        <nsdext:spot a="1000" c="RUB"/>
        <nsdext:forward a="1000.14" c="RUB"/>
        <!--Облигация.
"i" - Код базисного актива;
"n" - Номинальная сумма (Кол-во * номинал единицы БА);
"с" - Валюта-->
        <nsdext:bond id="123456" n="1000" c="RUB"/>
    </nsdext:repoDetails>
</nsdext:repos>
<!--Параметры контракта (2).-->
<nsdext:repos>
    <!--Контрагент 2.-->
    <nsdext:counterparty id="Counterparty2">
        <!--Идентификатор участника – репозитарный код.-->
        <partyId>NONREF</partyId>
        <!--Идентификатор участника – доп. Код (LEI, INN...)-->
        <partyId>SNILS_123-456-789 02</partyId>
        <!--Наименование участника.-->
        <partyName>Контрагент 2</partyName>
        <!--Вид экономической деятельности-->
        <classification>Other</classification>
        <!--Страна.-->
        <country>RU</country>
        <!--Тип лица-->
        <organizationType>P</organizationType>
    </nsdext:counterparty>
    <!--Детали контракта 1 по контрагенту 2-->
    <nsdext:repoDetails>
        <nsdext:tradelId r="NONREF" p="TRADE21" u="UTI3" pid="REOFF"/>
        <nsdext:side>Buyer</nsdext:side>
        <nsdext:rate>0.0512</nsdext:rate>
        <nsdext:spot a="1000" c="RUB"/>
        <nsdext:forward a="1000.14" c="RUB"/>
        <nsdext:equity id="123456" n="5" p="200" c="RUB"/>
    </nsdext:repoDetails>
    <!--Детали контракта 2 по контрагенту 2-->
    <nsdext:repoDetails>

```

```

        <nsdext:tradeId r="NONREF" p="TRADE31" u="UTI4" pid="REOLF"/>
        <nsdext:side>Buyer</nsdext:side>
        <nsdext:floatingRate t="1" p="D" i="0.0512">RUB-RUONIA-OIS-
COMPOUND</nsdext:floatingRate>
        <nsdext:spot a="1000" c="RUB"/>
        <nsdext:forward a="1000.14" c="RUB"/>
        <nsdext:equity id="123456" n="5" p="200" c="RUB"/>
        <nsdext:client i="SNILS_000-000-000 02" t="F" n="Петров ПП" c="RU"/>
    </nsdext:repoDetails>
</nsdext:repos>
</nsdext:repoBulkReport>
<!--Обеспечение по сделке-->
<nsdext:collateral>
    <!--Тип обеспечения по договору.-->
    <nsdext:marginType>U</nsdext:marginType>
    <!--Форма обеспечения-->
    <nsdext:collateralForm>U</nsdext:collateralForm>
</nsdext:collateral>
<!--Специальные атрибуты сделок.-->
<nsdext:nsdSpecificTradeFields>
    <!--Обязанность централизованного клиринга-->
    <nsdext:cleared>N</nsdext:cleared>
    <!--Условия согласования параметров сделки (договора).-->
    <nsdext:reconciliationType>FULL</nsdext:reconciliationType>
    <!--Тип расчетов.-->
    <nsdext:clearSettlementType>CS</nsdext:clearSettlementType>
    <!--Метод расчетов.-->
    <nsdext:clearSettlementMethod>C</nsdext:clearSettlementMethod>
    <!--Способ подтверждения сделки.-->
    <nsdext:confirmationMethod>MXME</nsdext:confirmationMethod>
    <!--Признак связанности стороны 1 и стороны 2-->
    <nsdext:partiesAreAffiliated>N</nsdext:partiesAreAffiliated>
    <!--Регуляторный тип сделки.-->
    <nsdext:regulatoryStatus>Repo</nsdext:regulatoryStatus>
    <!--Дата начала срока действия договора.-->
    <nsdext:startAgreementDate>2016-07-01</nsdext:startAgreementDate>
    <!--Дата окончания срока действия договора.-->
    <nsdext:endAgreementDate>2016-07-01</nsdext:endAgreementDate>
</nsdext:nsdSpecificTradeFields>
</trade>
<!--Участники Анкеты - Репозитарий.-->
<party id="TradeRepository">
    <!--Идентификатор участника – репозитарный код.-->
    <partyId>NDC000000000</partyId>
    <!--Идентификатор участника - LEI.-->
    <partyId>LEI_0000000000000000000001</partyId>
    <!--Наименование участника.-->
    <partyName>НКО АО НРД</partyName>
</party>
<!--Участники Анкеты – Сторона1.-->
<party id="Party1">
    <!--Идентификатор участника – репозитарный код.-->
    <partyId>P00000000111</partyId>
    <!--Идентификатор участника – доп. Код (LEI, INN...)-->
    <partyId>LEI_0000000000000000000001</partyId>
    <!--Наименование участника.-->
    <partyName>Клиент репозитария, Сторона</partyName>
    <!--Вид экономической деятельности-->
    <classification>Other</classification>
    <!--Страна.-->
    <country>RU</country>
    <!--Тип лица-->

```

```
        <organizationType>L</organizationType>
</party>
<!--Участники Анкеты – Сторона2.-->
<party id="Party2">
    <partyId>NONREF</partyId>
    <partyId>NONREF</partyId>
    <partyName>NONREF</partyName>
</party>
<!--Участники Анкеты – Отправитель сообщения (ИЛ).-->
<party id="Sender">
    <!--Идентификатор участника – репозитарный код.-->
    <partyId>P00000000111</partyId>
    <!--Идентификатор участника - LEI.-->
    <partyId>LEI_00000000000000000001</partyId>
    <!--Наименование участника.-->
    <partyName>Клиент репозитария</partyName>
</party>
</nonpublicExecutionReport>
```