



НАЦИОНАЛЬНЫЙ  
РАСЧЕТНЫЙ  
ДЕПОЗИТАРИЙ  
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

## **Репозиторий НКО АО НРД**

### **Описание Форматно-логических контролей**

## Содержание

<b>Общие положения</b> .....	<b>4</b>
<b>1. Проверки, не приводящие к отказам в обработке сообщений</b> .....	<b>5</b>
1.1. Для всех анкет.....	5
1.1.1. Проверка соблюдения регуляторных сроков регистрации сообщений в Разделе 1 Реестра договоров (Журнал учета сообщений).....	5
1.1.2. Проверка соблюдения регуляторных сроков регистрации сообщений в Разделе 2 реестра договоров.....	6
1.2. Для отдельных типов договоров.....	7
1.2.1. Проверка классификации договора как ПФИ.....	7
1.2.2. Проверка процентной ставки РЕПО.....	7
1.2.3. Проверка отклонения расчетного курса валюты от официального курса Банка России.....	8
1.2.4. Проверка значений, обозначающих сумму или количество.....	9
1.2.5. Проверка даты окончания срока действия договора.....	15
1.2.6. Проверка параметров, влияющих на расчет объема по сделке.....	18
1.2.7. Проверка формата заполнения процентной ставки.....	20
1.2.8. Проверка отклонения цены ценной бумаги от рыночной котировки.....	23
1.2.9. Проверка даты расчетов относительно даты погашения облигации.....	24
1.3. Проверка на дубликат сообщения.....	25
1.4. Проверки соблюдения сроков предоставления отчетов СМ093 и СМ094.....	26
1.4.1. Проверка сроков предоставления Анкеты о состоянии обязательств по договорам (СМ093).....	26
1.4.2. Проверка сроков предоставления Отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости (СМ094). 27	
Примечание 1: Алгоритм выбора даты окончания действия договора в зависимости от его типа.....	27
<b>2. Проверки, вызывающие отказы в обработке сообщений</b> .....	<b>28</b>
2.1. Проверка наименования стороны по договору, не являющейся клиентом Репозитория НРД.....	29
2.2. Проверка корректного указания кода клиента стороны.....	29
2.3. Проверка хронологии указания дат.....	29
2.4. Проверка последовательности указания частей сделки/валюты (валютный своп).....	39
2.5. Проверка на указание неотрицательного значения для полей типа «Количество» и «Номинальная сумма».....	40
2.6. Проверка корректности заполнения типа продукта (productType) в зависимости от параметров сообщения.....	44
2.7. Проверка корректности указания покупателя/продавца и плательщика/покупателя по первой и второй частям договора РЕПО и валютного свопа.....	55
2.8. Контроль отсутствия неиспользуемых элементов.....	55
2.9. Проверка кода классификации ПФИ и РЕПО.....	57
2.10. Проверка параметров, влияющих на расчет объема по сделке.....	58
2.11. Логические проверки внутри сообщений.....	60

2.12. Общие проверки Репозитария .....	62
<b>ПРИЛОЖЕНИЕ 1 .....</b>	<b>79</b>
<b>Справочник кодов, используемых для направления Извещения о расхождении в рамках обработки ФЛК (RM006). .....</b>	<b>79</b>
<b>ПРИЛОЖЕНИЕ 2 .....</b>	<b>81</b>
<b>Справочники кодов, используемых для формирования извещений и уведомлений репозитария (RM002/CM002). .....</b>	<b>81</b>
<b>Справочник «Коды причин», для направления Извещения об отказе в исполнении/регистрации (RM002). .....</b>	<b>82</b>
<b>ПРИЛОЖЕНИЕ 3. ....</b>	<b>106</b>
<b>Перечень информации (блоков информации), однозначно определяющий уникальность анкеты. ....</b>	<b>106</b>

## Общие положения.

Для снижения риска претензий со стороны регулятора и повышения качества регистрируемой информации с 5 декабря 2016 г. клиентам Репозитария НРД предоставляется сервис форматно-логического контроля (ФЛК), который позволяет проверять:

- Сроки предоставления информации о заключенных договорах;
- Отклонение процентной ставки от расчетного значения;
- Отклонение валютного курса от официального курса Банка России на дату заключения сделки;
- Корректность формата заполнения процентной ставки;
- Корректность классификации договора как ПФИ;
- Корректность количественных параметров;
- Наличие возможного дубликата сообщения;
- Соблюдение сроков предоставления Отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости;
- Отклонение указанной цены базового актива от рыночной котировки;
- Соблюдение сроков предоставления Анкеты о состоянии обязательств по договорам;
- Соблюдение хронологии дат в сообщении.

ФЛК является дополнительным сервисом и будет развиваться по мере получения новых запросов от Банка России и клиентов Репозитария НРД. Сервис является платным (**5 000 руб./мес. за одного участника по всем его репозитарным кодам**) и предоставляется на добровольной основе.

Для подключения к сервису ФЛК необходимо направить в WEB-кабинете Репозитария анкету по форме [СМ018](#) или, при необходимости, предоставить следующие документы в бумажном виде:

- Заявление о присоединении к Регламенту оказания сопутствующих услуг репозитария НКО АО НРД;
- Заявление на предоставление (отключение) удаленного доступа к услугам Репозитария с дополнительным сервисом форматно-логического контроля (СМ018).

Документы содержатся в Приложениях 1 и 3 Регламента оказания сопутствующих услуг репозитария и доступны по [ссылке](#).

После обработки предоставленных документов информирование о сработавшем контроле происходит незамедлительно путем направления отдельного сообщения RM006 с признаком «FLC» и описанием проверки.

Для удобства пользователей в интерфейсе Web-кабинета в закладке «Регистрация» реализован визуальный контроль с указанием сообщений, по которым было направлено уведомление ФЛК по форме RM006, а также разработано отдельное представление для данных уведомлений.

В рамках сервиса с 30 октября 2017 г. на бесплатной основе действуют дополнительные контроли, вызывающие отказы в обработке сообщений, которые проверяют, в том числе:

- Соответствие «Типа продукта» параметрам, указанным в анкете договора;
- Соответствие «Кода классификации» типу анкеты договора;
- Соответствие покупателя/продавца опциона плательщику/получателю премии;
- Корректное заполнение реквизитов клиента стороны;
- Соотношение номинальной суммы и премии по опциону;
- Корректность параметров, исходя из экономической сути договора.

**Дополнительные контроли срабатывают независимо от наличия подключения участника к платному сервису ФЛК.**

## 1. Проверки, не приводящие к отказам в обработке сообщений.

**Примечание:** проверка не выполняется в том случае, если указанный для проверки тэг отсутствует во входящем сообщении (при условии, что по xsd-схеме допускается отсутствие тэга и нет дополнительных проверок его обязательного заполнения).

### 1.1. Для всех анкет.

#### 1.1.1. Проверка соблюдения регуляторных сроков регистрации сообщений в Разделе 1 Реестра договоров (Журнал учета сообщений).

Дата (операционный день) регистрации сообщения (анкеты договора, сообщения о дерегистрации) в Журнале учета сообщений не должна превышать дату заключения сделки и дату отчитываемого события более чем на 3 рабочих дня.

В случае отказа репозитория в регистрации сообщения допускается подача нового сообщения с тем же кодом УТИ не позднее трех рабочих дней со дня получения сообщения об отказе. Для Анкеты генерального соглашения (СМ010), Анкеты договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств (СМ015) и bulk-отчетов (СМ083, СМ084, СМ085) данные проверки не выполняются.

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1	<p>Если сообщение подается на регистрацию договора с типом REGI и при этом код УТИ отсутствует (для договоров, заключенных до 01.07.2016) либо это первое уникальное сообщение с данным кодом УТИ, проверяется условие:</p> <p>Разница между параметрами «Дата (операционный день) регистрации сообщения в журнале входящих сообщений» и «Дата сделки» не должна превышать 3 рабочих дня.</p> <p>Если условие не выполняется – комментарий в RM006.</p>	<p>«<a href="#">NRW007</a> - Информация, содержащая сведения о договоре, занесена в журнал учета сообщений репозитория позднее трех рабочих дней с даты заключения, изменения или прекращения указанного договора».</p>
2	<p>Если сообщение подается на изменение/коррекцию договора или подается анкета СМ093 и при этом последнее сообщение анкеты договора с данным кодом УТИ не находится в статусе REJECT, проверяется условие:</p> <p>Разница между параметрами «Дата (операционный день) регистрации сообщения в журнале входящих» и «Дата совершения отчитываемого события» не должна превышать 3 рабочих дня.</p> <p>Если условие не выполняется – комментарий в RM006.</p>	
3	<p>Если сообщение подается на регистрацию договора и при этом имеется ранее зарегистрированное сообщение с таким же кодом УТИ в статусе REJECT, проверяется условие:</p> <p>Разница между параметрами «Дата (операционный день) регистрации сообщения в журнале входящих сообщений» нового сообщения и «Дата (операционный день) регистрации сообщения в журнале входящих сообщений» (самого раннего сообщения с таким же кодом УТИ в статусе REJECT) не должна превышать 3 рабочих дня.</p> <p>Если условие не выполняется – комментарий в RM006.</p>	
4	<p>Если подается сообщение на изменение договора или подается анкета СМ093, при этом последнее зарегистрированное сообщение с таким же кодом УТИ находится в статусе REJECT, проверяется условие:</p> <p>Разница между параметрами «Дата (операционный день) регистрации сообщения в журнале входящих сообщений» нового сообщения и «Дата</p>	

	(операционный день) регистрации сообщения в журнале входящих сообщений» (последнего сообщения с таким же кодом UTI, если оно находится в статусе REJECT) не должна превышать 3 рабочих дня. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.
--	---

### 1.1.2. Проверка соблюдения регуляторных сроков регистрации сообщений в Разделе 2 реестра договоров.

Дата (операционный день) внесения записи в реестр не должна превышать дату заключения сделки и дату отчитываемого события более чем на 3 рабочих дня. В случае отказа репозитория в регистрации сообщения допускается подача нового сообщения с тем же кодом UTI не позднее трех рабочих дней со дня получения сообщения об отказе.

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1	Если сообщение подается на регистрацию договора и при этом ранее не было отказов по сообщениям с данным кодом UTI, проверяется условие: Разница между параметрами «Дата (операционный день) регистрации сообщения в РЕЕСТРЕ» и «Дата сделки» не должна превышать 3 рабочих дня. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	«NRW005 - Информация, содержащая сведения о договоре, занесена в реестр репозитория позднее трех рабочих дней с даты заключения, изменения или прекращения указанного договора».
2	Если сообщение подается на изменение/коррекцию договора или подается анкета CM093 и при этом последнее сообщение анкеты договора с данным кодом UTI не находится в статусе REJECT, проверяется условие: Разница между параметрами «Дата (операционный день) регистрации сообщения в РЕЕСТРЕ» и «Дата совершения отчитываемого события» не должна превышать 3 рабочих дня. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
3	Если сообщение подается на регистрацию договора и при этом имеется ранее зарегистрированное сообщение с таким же кодом UTI в статусе REJECT, проверяется условие: Разница между параметрами «Дата (операционный день) регистрации сообщения в РЕЕСТРЕ» и «Дата (операционный день) регистрации сообщения в РЕЕСТРЕ» (самого раннего сообщения с таким же кодом UTI в статусе REJECT) 3 рабочих дня. Если условие выполняется – комментарий в RM006.	
4	Если сообщение подается на изменение/коррекцию договора или подается анкета CM093, при этом последнее зарегистрированное сообщение с таким же кодом UTI находится в статусе REJECT, проверяется условие: Разница между параметрами «Дата (операционный день) регистрации сообщения в РЕЕСТРЕ» и «Дата (операционный день) регистрации сообщения в РЕЕСТРЕ» (самого раннего сообщения с таким же кодом UTI в статусе REJECT) – 3 рабочих дня. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	

## 1.2. Для отдельных типов договоров.

### 1.2.1. Проверка классификации договора как ПФИ.

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1	<b>Анкета конверсионной сделки / валютного форварда (CM022 – fxSingleLeg):</b> Если разница между датой валютирования и датой сделки составляет не менее трех рабочих дней, то код классификации <i>productId</i> не равен «UKWN».	«NRW001 - Данный договор должен быть классифицирован как ПФИ».
2	<b>Анкета форварда на облигацию или индекс (CM043 – bondForward):</b> Если разница между датой расчетов и датой сделки составляет не менее трех рабочих дней, то код классификации <i>productId</i> не равен «UKWN».	
3	<b>Анкета форварда на акцию (CM047 – equityForward):</b> Если разница между датой исполнения и датой сделки составляет не менее трех рабочих дней, то код классификации <i>productId</i> не равен «UKWN».	
4	<b>Анкета товарного форварда (CM051 – commodityForward):</b> Если разница между датой платежа/поставки и датой сделки составляет не менее трех рабочих дней, то код классификации <i>productId</i> не равен «UKWN».	

### 1.2.2. Проверка процентной ставки РЕПО.

Если для договора РЕПО можно вычислить процентную ставку на основании сумм по 1 и 2 частям сделки, и при этом суммы по частям сделки указаны в одинаковой валюте, то указанная процентная ставка не должна отличаться от вычисляемой более чем на 0,1%.

#### Этапы проведения проверки.

##### 1. Определение валют по 1-й и 2-й части сделки.

Первоначально проверяется, что валюты, в которых выражены суммы расчетов по первой и второй частям РЕПО, совпадают. Если они не совпадают, дальнейшие этапы проверки не выполняются.

##### 2. Расчет простой и сложной процентной ставки.

Расчет отклонения простой процентной ставки «SD»:

$$SD = (FV/PV - 1) * (BASIS/t) - r,$$

$$SD = (FV/PV - 1) * \left(\frac{BASIS}{t}\right) - r$$

Расчет отклонения сложной процентной ставки «CD»:

$$CD = \left[\left(\frac{FV}{PV}\right)^{1/t} - 1\right] * BASIS - r$$

$$CD = \left(\left(\frac{FV}{PV}\right)^{\frac{1}{t}} - 1\right) * BASIS - r$$

где:

FV (сумма расчетов по второй части РЕПО)

PV (сумма расчетов по первой части РЕПО)

r (фиксированная процентная ставка)

t (срок сделки репо): разница между датой расчетов по второй части РЕПО и датой расчетов по первой части РЕПО;

BASIS – количество дней в периоде. Определяется в зависимости от значений параметров CONV (коэффициента для расчета дней в процентном периоде) и CURR (валюты актива в обеспечении по первой части РЕПО):

- Если CONV = 'ACT/365L' и дата расчетов по второй части РЕПО приходится на високосный год, то BASIS = 366, иначе BASIS = 365;
  - Если CONV = 'ACT/365.FIXED', то BASIS = 365;
  - Если CONV = 'ACT/360', то BASIS = 360;
  - Если указана иная конвенция, значение BASIS определяется в зависимости от значения CURR:
- Если CURR = 'RUB' и дата расчетов по второй части РЕПО приходится на високосный год, то BASIS = 366, иначе BASIS = 365;
  - Если CURR = 'EUR', то BASIS = 365;
  - Если CURR = 'USD', то BASIS = 360;
  - Для прочих валют BASIS = 365.

### 3. Определение расхождения между вычисленными ставками и указанной ставкой.

Рассчитывается относительное минимальное отклонение указанной в анкете процентной ставки от расчетного значения (по формулам сложной и простой процентных ставок):

$$D_{\min} = (\min\{|SD|, |CD|\}) / (|r|)$$

Выбираем минимальное значение из SD и CD, и рассчитываем его отношение к указанной ставке «r».

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1.	Если значение $D_{\min} > 0.001$ либо $D_{\min} \leq 0.001$ – комментарий в RM006.	« <a href="#">NRW002</a> - Указанная процентная ставка отличается от вычисляемой ставки более чем на 0,001 (0,1%)».

### 1.2.3. Проверка отклонения расчетного курса валюты от официального курса Банка России.

Проверка выполняется для следующих валютных инструментов:

- Анкета валютного свопа (CM021).
- Анкета конверсионной сделки (валютного форварда) (CM022).
- Анкета валютного опциона (CM023).

Для определения параметров отклонения курса необходимо сопоставить расчетный курс по 1 и 2 частям сделки с официальным курсом иностранной валюты, установленным Банком России. Допустимое отклонение < 10%.

В качестве официального курса валюты к рублю используется значение курса из базы Банка России, деленное на «фактор» (размер лота – например, 100 японских иен), таким образом, чтобы курс соответствовал соотношению «1 единица валюты за 1 единицу рубля».

#### Этапы проведения проверки.

##### 1. Проверка соответствия расчетного курса указанному в анкете курсу <rate>.

Для базиса котировки  $Currency1PerCurrency2$  должно выполняться равенство:

Сумма валюты 1 платежа/Сумма валюты 2 платежа = **указанный курс** или Сумма валюты на продажу/Сумма валюты на покупку = **указанный курс**

Для базиса котировки  $Currency2PerCurrency1$  должно выполняться равенство:



Сумма валюты 2 платежа/Сумма валюты 1 платежа = **указанный курс** или Сумма валюты на покупку/Сумма валюты на продажу = **указанный курс**

## 2. Проверка отклонения.

Если обе суммы (в Валюте 1 и Валюте 2), а также **указанный курс** > 1, то

- Отклонение в процентах =  $|((\text{указанный курс} * \text{сумма в валюте 2} - \text{сумма в валюте 1}) / \text{сумма в валюте 1}) * 100| \leq 1\%$

Если обе суммы (в валюте 1 и в валюте 2) > 1, и  $0.1 < \text{указанный курс} \leq 1$ , то

- Отклонение в процентах =  $|((\text{указанный курс} * \text{сумма в валюте 2} - \text{сумма в валюте 1}) / \text{сумма в валюте 1}) * 100| \leq 5\%$

В остальных случаях допускается любое отклонение без отказа.

Если условие не выполняется – отказ [NRD207](#), проверка завершается.

Если условие выполняется – переход на следующий этап.

## 3. Сравнение официального курса Банка России (ОКБР) с указанным в анкете курсом.

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1.	Если одна из валют является RUB: Определяется <b>ОФкурс</b> для валюты и сравнивается с указанным курсом <i>rate</i> : $0,9 * \text{ОФкурс} \leq \text{указанный курс} \leq 1,1 * \text{ОФкурс}$ Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	« <a href="#">NRW006</a> - Указанный курс по сделке отклоняется от официального курса иностранной валюты, установленного Банком России, более чем на 10%»
2.	Если ни одна из валют не является RUB: Определяется <b>ОФкурс1</b> (в RUB) для Валюты 1 и <b>ОФкурс2</b> (в RUB) для Валюты 2. Далее определяется отношение $\text{ОФкурс1} / \text{ОФкурс2} = \text{ОФкурс}$ и сравнивается с указанным курсом <i>rate</i> : $0,9 * \text{ОФкурс} \leq \text{указанный курс} \leq 1,1 * \text{ОФкурс}$	

### 1.2.4. Проверка значений, обозначающих сумму или количество.

Проверка выполняется с целью контроля нулевых значений, а также значений, превышающих 1 трлн. руб. (данный порог может быть изменен по требованию клиентов).

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1	<b>Анкета валютного свопа (CM021 – fxSwap)</b>	<b>Комментарий 1</b> " <a href="#">NRW008</a> - В поле <название поля– xml тэг > ожидается положительное значение, отличное от 0"
1.1	Проверить значения суммы платежа в Валюте 1 и суммы платежа в Валюте 2: <code>exchangedCurrency1/paymentAmount</code> <code>exchangedCurrency2/paymentAmount</code> Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006. Если значение в рублях > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.	

2	<b>Анкета конверсионной сделки (валютного форварда) (CM022 – fxSingleLeg)</b>	<b>Комментарий 2</b> "NRW009 - Возможная ошибка: значение в <название поля – xml тэг> превышает значение 1 трлн. руб."
2.1	Проверить значения суммы платежа в Валюте 1 и суммы платежа в Валюте 2:  exchangedCurrency1/paymentAmount exchangedCurrency2/paymentAmount  Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.  Если значение в рублях > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.	
3.	<b>Анкета валютного опциона (CM023 – fxOption)</b>	
3.1	Проверить значения суммы валюты на покупку, суммы валюты на продажу и суммы премии:  callCurrencyAmount putCurrencyAmount premium/paymentAmount  Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.  Если значение в рублях > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.	
4.	<b>Анкета бинарного валютного опциона (CM024 – fxDigitalOption)</b>	
4.1	Проверить значения суммы выплаты по опциону и суммы премии:  payout premium/paymentAmount  Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.  Если значение в рублях > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.	
5.	<b>Анкета соглашения о будущей процентной ставке (CM031 – fra)</b>	
5.1	Проверить значение номинальной суммы:  notional  Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.  Если значение в рублях > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.	
6.	<b>Анкета процентного свопа (CM032 – swap)</b>	
6.1	Проверить значение номинальной суммы:  notionalStepSchedule/initialValue knownAmountSchedule/initialValue  Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.  Если значение в рублях > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.	

7.	<b>Анкета договора фиксации максимальной/ минимальной процентной ставки (CM033 – capFloor)</b>
7.1	<p>Проверить значения номинальной суммы и суммы премии:  notionalStepSchedule/initialValue  premium/paymentAmount</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях &gt; 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>
8	<b>Анкета свопциона (CM034 – swaption)</b>
8.1	<p>Проверить значения номинальной суммы и суммы премии:  notionalStepSchedule/initialValue  knownAmountSchedule/initialValue  premium/paymentAmount</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях &gt; 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>
9.	<b>Анкета договора РЕПО (CM041 - repo)</b>
9.1	<p>Проверить значения суммы расчетов, номинальной суммы обеспечения / количества и цены единицы актива в обеспечении:  spotLeg/settlementAmount*  spotLeg/collateral/nominalAmount*  spotLeg/collateral/numberOfUnits  spotLeg/collateral/unitPrice*</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях (только для тегов, отмеченных «*») &gt; 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>
10.	<b>Анкета договора купли-продажи облигации (CM042 – bondSimpleTransaction)</b>
10.1	<p>Проверить значение номинальной суммы:  notionalAmount</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях &gt; 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>
11.	<b>Анкета форварда на облигацию или индекс (CM043 – bondForward)</b>
11.1	<p>Проверить значение номинальной суммы:  notionalAmount</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях &gt; 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>

12.	<b>Анкета опциона на облигацию (CM044 – bondOption)</b>	
12.1	<p>Проверить значения номинальной суммы, суммы премии, объема лота и количества опционов:</p> <p>notionalAmount premium/paymentAmount optionEntitlement numberOfOptions</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях (только для <i>notionalAmount</i> и <i>premium</i>) &gt; 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
13	<b>Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (CM045 – bondBasketOption)</b>	
13.1	<p>Проверить значения номинальной суммы, суммы премии, объема лота и количества опционов:</p> <p>notionalAmount premium/paymentAmount optionEntitlement numberOfOptions</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях (только для <i>notionalAmount</i> и <i>premium</i>) &gt; 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
14.	<b>Анкета договора купли-продажи акции (CM046 – equitySimpleTransaction)</b>	
14.1	<p>Проверить значения количества акций и цены:</p> <p>numberOfUnits unitPrice</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях (только для <i>unitPrice</i>) &gt; 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
15.	<b>Анкета форварда на акцию (CM047 – equityForward)</b>	
15.1	<p>Проверить значения форвардной цены и лота актива:</p> <p>forwardPrice singleUnderlyer/openUnits basket/openUnits</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях (только для <i>forwardPrice</i>) &gt; 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
16.	<b>Анкета опциона на акцию (CM048 – equityOption)</b>	

16.1	<p>Проверить значения количества опционов, объема опциона, лота актива и премии:</p> <p>numberOfOptions optionEntitlement singleUnderlyer/openUnits basket/openUnits equityPremium/paymentAmount</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях (только для <i>equityPremium</i>) &gt; 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
17.	<b>Анкета товарного форварда (CM051 – commodityForward)</b>	
17.1	<p>Проверить значения общего номинального количества / поставляемого количества актива, фиксированной цены и общей суммы:</p> <p>floatingForwardLeg/totalNotionalQuantity commodityForwardPhysicalLeg/deliveryQuantity/totalPhysicalQuantity fixedLeg/fixedPrice fixedLeg/totalPrice</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях (только для <i>totalPrice</i>) &gt; 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
18.	<b>Анкета товарного опциона (CM052 – commodityOption)</b>	
18.1	<p>Проверить значения общего номинального количества и премии:</p> <p>totalNotionalQuantity premium/paymentAmount</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях (только для <i>premium</i>) &gt; 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
19.	<b>Анкета товарного свопа (CM053 – commoditySwap)</b>	
19.1	<p>Проверить значения общего номинального количества / поставляемого количества актива и общей суммы:</p> <p>floatingLegNsd/totalNotionalQuantity fixedLeg/totalNotionalQuantity commoditySwapPhysicalLeg/deliveryQuantity/totalPhysicalQuantity/quantity fixedLeg/totalPrice</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях (только для <i>totalPrice</i>) &gt; 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
20.	<b>Анкета товарного свопциона (CM054 – commoditySwaption)</b>	

20.1	<p>Проверить значения общего номинального количества / поставляемого количества актива, общей суммы и премии:</p> <p>fixedLeg/totalNotionalQuantity floatingLegNsd/totalNotionalQuantity commoditySwapPhysicalLeg/deliveryQuantity/totalPhysicalQuantity fixedLeg/totalPrice premium/paymentAmount</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях (только для <i>totalPrice</i> и <i>premium</i>) &gt; 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>
21.	<b>Анкета свопа дохода на облигацию (CM061 – bondSwap)</b>
21.1	<p>Проверить значения номинальной суммы:</p> <p>bondReturnLeg/notionalAmount interestLeg/notional/notionalAmount</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях &gt; 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>
22.	<b>Анкета свопа дохода на акцию (CM062 – equitySwapTransactionSupplement)</b>
22.1	<p>Проверить значения номинальной суммы:</p> <p>interestLeg/notional/notionalAmount returnLeg/notional/notionalAmount</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях &gt; 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>
23.	<b>Анкета кредитного дефолтного свопа (CM071 – creditDefaultSwap)</b>
23.1	<p>Проверить значение расчетной суммы:</p> <p>protectionTerms/calculationAmount</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях &gt; 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>
24.	<b>Анкета кредитного дефолтного свопциона (CM072 – creditDefaultSwapOption)</b>
24.1	<p>Проверить значения расчетной суммы, премии и цены страйк:</p> <p>protectionTerms/calculationAmount premium/paymentAmount strike/spread strike/price</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p>

	Если значение в рублях (только для <i>calculationAmount</i> и <i>premium</i> ) > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.	
25.	<b>Анкета иной сделки (CM081 – generalProduct)</b>	
25.1	<p>Проверить значения общей денежной суммы:</p> <p>party1Obligations/nominalAmount party2Obligations/nominalAmount</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях &gt; 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	

### 1.2.5. Проверка даты окончания срока действия договора.

Проверка выполняется с целью контроля значения параметра «Дата окончания срока действия договора» *endAgreementDate*, которая не должна предшествовать дате исполнения / расчетов по договору. Если установлен флаг автоматического закрытия сделки, в аналогичных случаях направляется отказ в регистрации сообщения (см. п. 2.3).

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
<b>1</b>	<b>Анкета валютного свопа (CM021 – fxSwap)</b>	"NRW010 - Возможно нарушена хронологическая последовательность дат в сообщении: <Дата окончания срока действия договора> меньше <название поля>"
1.1	Дата валютирования для окончательного платежа <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>2</b>	<b>Анкета конверсионной сделки (валютного форварда) (CM022 – fxSingleLeg)</b>	
2.1	Дата валютирования <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>3</b>	<b>Анкета валютного опциона (CM023 – fxOption)</b>	
3.1	Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>4</b>	<b>Анкета бинарного валютного опциона (CM024 – fxDigitalOption)</b>	
4.1	Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>5</b>	<b>Анкета соглашения о будущей процентной ставке (CM031 – fra)</b>	
5.1	Дата платежа <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>6</b>	<b>Анкета процентного свопа (CM032 – swap)</b>	

6.1	Дата истечения срока <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>7</b>	<b>Анкета договора фиксации максимальной/ минимальной процентной ставки (CM033 – capFloor)</b>	
7.1	Дата истечения срока <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>8</b>	<b>Анкета свопциона (CM034 – swaption)</b>	
8.1	Дата истечения срока <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>9</b>	<b>Анкета договора РЕПО (CM041 - repo)</b>	
9.1	Дата расчетов по 2 части <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>10</b>	<b>Анкета договора купли-продажи облигации (CM042 – bondSimpleTransaction)</b>	
10.1	Дата расчетов <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>11</b>	<b>Анкета форварда на облигацию или индекс (CM043 – bondForward)</b>	
11.1	Дата расчетов <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>12</b>	<b>Анкета опциона на облигацию (CM044 – bondOption)</b>	
12.1	Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>13</b>	<b>Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (CM045 – bondBasketOption)</b>	
13.1	Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>14</b>	<b>Анкета договора купли-продажи акции (CM046 – equitySimpleTransaction)</b>	
14.2	Дата расчетов <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>15</b>	<b>Анкета форварда на акцию (CM047 – equityForward)</b>	
15.1	Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	



<b>16</b>	<b>Анкета опциона на акцию (CM048 – equityOption)</b>	
16.1	Дата истечения $\leq$ Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>17</b>	<b>Анкета товарного форварда (CM051 – commodityForward)</b>	
17.1	Даты платежей $\leq$ Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>18</b>	<b>Анкета товарного опциона (CM052 – commodityOption)</b>	
18.1	Дата истечения, Даты платежей $\leq$ Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>19</b>	<b>Анкета товарного свопа (CM053 – commoditySwap)</b>	
19.1	Дата истечения срока $\leq$ Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
19.2	Даты платежей $\leq$ Дата истечения срока. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
19.3	Даты поставки $\leq$ Дата истечения срока. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>20</b>	<b>Анкета товарного свопциона (CM054 – commoditySwaption)</b>	
20.1	Дата истечения $\leq$ Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
20.2	Даты платежей $\leq$ Дата истечения срока. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
20.3	Даты поставки $\leq$ Дата истечения срока. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>21</b>	<b>Анкета свопа дохода на облигацию (CM061 – bondSwap)</b>	
21.1	Даты платежа $\leq$ Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>22</b>	<b>Анкета свопа дохода на акцию (CM062 – equitySwapTransactionSupplement)</b>	
22.1	Даты платежа $\leq$ Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>23</b>	<b>Анкета кредитного дефолтного свопа (CM071 – creditDefaultSwap)</b>	

23.1	Плановая дата окончания срока $\leq$ Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>24</b>	<b>Анкета кредитного дефолтного свопциона (CM072 – creditDefaultSwapOption)</b>	
24.1	Дата истечения $\leq$ Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
<b>25</b>	<b>Анкета иной сделки (CM081 – generalProduct)</b>	
25.1	Дата платежа $\leq$ Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	

### 1.2.6. Проверка параметров, влияющих на расчет объема по сделке.

Проверки предназначены для выявления случаев, когда заполненные параметры договора могут противоречить экономическому смыслу инструмента, что может повлиять на корректность расчета объема договора как на стороне репозитория, так и на стороне Банка России.

Если сравниваемые суммы выражены в различных валютах, в процессе выполнения проверки они конвертируются в рубли по официальному курсу Банка России на дату сделки.

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1.	<b>Анкета валютного опциона (CM023 – fxOption)</b>	"NRW011 - Отношение суммы премии опциона к номинальной сумме валюты на продажу превышает 25%"
1.1	Проверить, что отношение суммы премии к номинальной сумме $putCurrencyAmount \leq 0,25$ . Если значение $> 0,25$ , то комментарий в RM006.	
2.	<b>Анкета бинарного валютного опциона (CM024 – fxDigitalOption)</b>	
2.1	Проверить, что отношение суммы премии к сумме выплаты $payout \leq 0,25$ . Если значение $> 0,25$ , то комментарий в RM006.	
3.	<b>Анкета договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки (CM033 – capFloor)</b>	
3.1	Проверить, что отношение суммы премии к номинальной сумме $notionalStepSchedule/initialValue \leq 0,25$ . Если значение $> 0,25$ , то комментарий в RM006.	
4.	<b>Анкета свопциона (CM034 – swaption)</b>	
4.1	Проверить, что отношение суммы премии к номинальной сумме $notionalStepSchedule/initialValue \leq 0,25$ . Если значение $> 0,25$ , то комментарий в RM006.	
5.	<b>Анкета форварда на облигацию или индекс (CM043 – bondForward)</b>	

5.1	<p>Если указан идентификатор облигации <i>instrumentId</i>, в корпоративной базе данных НРД находится значение номинала облигации и умножается на количество облигаций по договору <i>openUnits</i>. Полученное значение должно равняться номинальной сумме <i>notionalAmount</i>.</p> <p>Если инструмент в КБД не найден, то проверка не выполняется.</p> <p>Если условие не выполняется, то комментарий в RM006.</p>	"NRW012 - Указанная Номинальная сумма не соответствует рассчитанному значению <Описание условия>"
6.	<b>Анкета опциона на облигацию (CM044 – bondOption)</b>	
6.1	<p>Если указан идентификатор облигации <i>instrumentId</i>, в корпоративной базе данных НРД находится значение номинала облигации и умножается на количество облигаций в одном опционе <i>optionEntitlement</i> и количество опционов <i>numberOfOptions</i>. Полученное значение должно равняться номинальной сумме <i>notionalAmount</i>.</p> <p>Если инструмент в КБД не найден, то проверка не выполняется.</p> <p>Если условие не выполняется, то комментарий в RM006.</p>	
7.	<b>Анкета опциона на акцию (CM048 – equityOption)</b>	
7.1	<p>Проверить, что отношение суммы премии к расчетной номинальной сумме (определяется как произведение количества опционов <i>numberOfOptions</i>, объема опциона <i>optionEntitlement</i> и цены исполнения <i>strikePrice</i>) <math>\leq 0,25</math>.</p> <p>Если значение <math>&gt; 0,25</math>, то комментарий в RM006.</p>	"NRW011 - Отношение суммы премии опциона к номинальной сумме валюты на продажу превышает 25%"
8.	<b>Анкета товарного форварда (CM051 – commodityForward)</b>	
8.1	<p>Проверить, что</p> <p>1) Для поставочного товарного форварда выполняется следующее условие: разность между номинальной суммой <i>totalPrice</i> и ее расчетным значением (определяется как произведение форвардной цены <i>fixedPrice</i> и количества базового актива <i>totalPhysicalQuantity</i>) находится в интервале (-1; 1).</p> <p>2) Для расчетного товарного форварда выполняется следующее условие: разность между номинальной суммой <i>totalPrice</i> и ее расчетным значением (определяется как произведение форвардной цены <i>fixedPrice</i> и количества базового актива <i>totalNotionalQuantity</i>) находится в интервале (-1; 1).</p> <p>Если условие не выполняется, то комментарий в RM006.</p>	"NRW012 - Указанная Номинальная сумма не соответствует рассчитанному значению <Описание условия>"
9.	<b>Анкета товарного опциона (CM052 – commodityOption)</b>	
9.1	<p>Проверить, что отношение суммы премии к расчетной номинальной сумме (определяется как произведение общего номинального количества базового актива <i>totalNotionalQuantity</i> и цены исполнения <i>strikePricePerUnit</i>) <math>\leq 0,25</math>.</p> <p>Если значение <math>&gt; 0,25</math>, то комментарий в RM006.</p>	"NRW011 - Отношение суммы премии опциона к номинальной сумме валюты на продажу превышает 25%"
10.	<b>Анкета товарного свопциона (CM054 – commoditySwaption)</b>	
10.1	<p>Проверить, что отношение суммы премии к расчетной номинальной сумме (определяется как произведение общего номинального количества базового актива <i>totalNotionalQuantity</i> либо <i>weatherNotionalAmount</i> и цены базового актива <i>initialPrice</i> либо <i>weatherIndexLevel</i>) <math>\leq 0,25</math>.</p>	

	Если значение > 0,25, то комментарий в RM006.	
11.	<b>Анкета кредитного дефолтного свопциона (CM072 – creditDefaultSwapOption)</b>	
11.1	Проверить, что отношение суммы премии к номинальной сумме <i>calculationAmount</i> <= 0,25. Если значение > 0,25, то комментарий в RM006.	

### 1.2.7. Проверка формата заполнения процентной ставки.

Проверка выполняется для контроля значения процентной ставки, которая указывается в виде десятичного числа или процентных пунктов в зависимости от заполняемого параметра и типа анкеты.

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1.	<b>Анкета соглашения о будущей процентной ставке (CM031 – fra)</b>	"NRW013 - Возможная ошибка: значение в <название поля – xml тэг> превышает 1 (100%)"
1.1	Проверить значение параметра: <i>fixedRate</i> Если значение < -2 или > 2, то ошибка <a href="#">NRD234</a> . Если значение < -1 или > 1, то комментарий в RM006.	
2.	<b>Анкета процентного свопа (CM032 – swap)</b>	
2.1	Проверить значения параметров: <i>floatingRateCalculation/initialRate</i> <i>floatingRateCalculation/spreadSchedule/initialValue</i> <i>floatingRateCalculation/capRateSchedule/initialValue</i> <i>floatingRateCalculation/floorRateSchedule/initialValue</i> <i>fixedRateSchedule/initialValue</i> Если значение < -2 или > 2, то ошибка <a href="#">NRD234</a> . Если значение < -1 или > 1, то комментарий в RM006.	
3.	<b>Анкета договора фиксации максимальной/ минимальной процентной ставки (CM033 – capFloor)</b>	
3.1	Проверить значения параметров: <i>floatingRateCalculation/initialRate</i> <i>floatingRateCalculation/spreadSchedule/initialValue</i> <i>floatingRateCalculation/capRateSchedule/initialValue</i> <i>floatingRateCalculation/floorRateSchedule/initialValue</i> Если значение < -2 или > 2, то ошибка <a href="#">NRD234</a> . Если значение < -1 или > 1, то комментарий в RM006.	
4	<b>Анкета свопциона (CM034 – swaption)</b>	
4.1	Проверить значения параметров: <i>floatingRateCalculation/initialRate</i> <i>floatingRateCalculation/spreadSchedule/initialValue</i> <i>floatingRateCalculation/capRateSchedule/initialValue</i>	

	<p>floatingRateCalculation/floorRateSchedule/initialValue fixedRateSchedule/initialValue</p> <p>Если значение &lt; -2 или &gt; 2, то ошибка <a href="#">NRD234</a>.</p> <p>Если значение &lt; -1 или &gt; 1, то комментарий в RM006.</p>	
5.	<b>Анкета договора РЕПО (CM041 - repo)</b>	
5.1	<p>Проверить значения параметров:</p> <p>fixedRateSchedule/initialValue floatingRateCalculation/initialRate floatingRateCalculation/spreadSchedule/initialValue floatingRateCalculation/capRateSchedule/initialValue floatingRateCalculation/floorRateSchedule/initialValue</p> <p>Если значение &lt; -2 или &gt; 2, то ошибка <a href="#">NRD234</a>.</p> <p>Если значение &lt; -1 или &gt; 1, то комментарий в RM006.</p>	
5.2	<p>Проверить значение параметра:</p> <p>cleanPrice</p> <p>Если значение &lt; 2, то ошибка <a href="#">NRD235</a>.</p> <p>Если значение &gt; 200, то комментарий в RM006.</p>	
6.	<b>Анкета договора купли-продажи облигации (CM042 – bondSimpleTransaction)</b>	
6.1	<p>Проверить значение параметра:</p> <p>cleanPrice</p> <p>Если значение &lt; 2, то ошибка <a href="#">NRD235</a>.</p> <p>Если значение &gt; 200, то комментарий в RM006.</p>	
7.	<b>Анкета форварда на облигацию или индекс (CM043 – bondForward)</b>	
7.1	<p>Проверить значение параметра:</p> <p><math>0 \leq \text{basketPercentage} \leq 1</math></p> <p>Если значение &lt; 0 или &gt; 1, то ошибка <a href="#">NRD234</a>.</p>	
7.2	<p>Проверить значение параметра:</p> <p>forwardPricePercentage</p> <p>Если значение &lt; 2, то ошибка <a href="#">NRD235</a>.</p> <p>Если значение &gt; 200, то комментарий в RM006.</p>	
8.	<b>Анкета опциона на облигацию (CM044 – bondOption)</b>	
8.1	<p>Проверить значение параметра:</p> <p>strikePercentage</p> <p>Если значение &lt; 2, то ошибка <a href="#">NRD235</a>.</p> <p>Если значение &gt; 200, то комментарий в RM006.</p>	
9	<b>Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (CM045 – bondBasketOption)</b>	

9.1	<p>Проверить значение параметра:  <math>0 \leq \text{basketPercentage} \leq 1</math>          Если значение <math>&lt; 0</math> или <math>&gt; 1</math>, то ошибка <a href="#">NRD234</a>.</p>	
9.2	<p>Проверить значение параметра:  <code>strikePercentage</code>          Если значение <math>&lt; 2</math>, то ошибка <a href="#">NRD235</a>.          Если значение <math>&gt; 200</math>, то комментарий в RM006.</p>	
10.	<b>Анкета свопа дохода на облигацию (CM061 – bondSwap)</b>	
10.1	<p>Проверить значения параметров:  <code>floatingRateCalculation/initialRate</code>  <code>floatingRateCalculation/capRateSchedule/initialValue</code>  <code>floatingRateCalculation/floorRateSchedule/initialValue</code>  <code>fixedRate</code>          Если значение <math>&lt; -2</math> или <math>&gt; 2</math>, то ошибка <a href="#">NRD234</a>.          Если значение <math>&lt; -1</math> или <math>&gt; 1</math>, то комментарий в RM006.</p>	
10.2	<p>Проверить значение параметра:  <math>0 \leq \text{basketPercentage} \leq 1</math>          Если значение <math>&lt; 0</math> или <math>&gt; 1</math>, то ошибка <a href="#">NRD234</a>.</p>	
11.	<b>Анкета свопа дохода на акцию (CM062 – equitySwapTransactionSupplement)</b>	
11.1	<p>Проверить значения параметров:  <code>floatingRateCalculation/initialRate</code>  <code>floatingRateCalculation/capRateSchedule/initialValue</code>  <code>floatingRateCalculation/floorRateSchedule/initialValue</code>  <code>fixedRate</code>          Если значение <math>&lt; -2</math> или <math>&gt; 2</math>, то ошибка <a href="#">NRD234</a>.          Если значение <math>&lt; -1</math> или <math>&gt; 1</math>, то комментарий в RM006.</p>	
11.2	<p>Проверить значение параметра:  <math>0 \leq \text{basketPercentage} \leq 1</math>          Если значение <math>&lt; 0</math> или <math>&gt; 1</math>, то ошибка <a href="#">NRD234</a>.</p>	
12.	<b>Анкета кредитного дефолтного свопа (CM071 – creditDefaultSwap)</b>	
12.1	<p>Проверить значение параметра:  <code>fixedRate</code>          Если значение <math>&lt; -2</math> или <math>&gt; 2</math>, то ошибка <a href="#">NRD234</a>.          Если значение <math>&lt; -1</math> или <math>&gt; 1</math>, то комментарий в RM006.</p>	
12.2	<p>Проверить значение параметра:  <math>0 \leq \text{basketPercentage} \leq 1</math>          Если значение <math>&lt; 0</math> или <math>&gt; 1</math>, то ошибка <a href="#">NRD234</a>.</p>	

13.	<b>Анкета кредитного дефолтного свопциона (CM072 – creditDefaultSwapOption)</b>	
13.1	Проверить значение параметра: fixedRate Если значение < -2 или > 2, то ошибка <a href="#">NRD234</a> . Если значение < -1 или > 1, то комментарий в RM006.	
13.2	Проверить значение параметра: 0 <= basketPercentage <= 1 Если значение < 0 или > 1, то ошибка <a href="#">NRD234</a> .	

### 1.2.8. Проверка отклонения цены ценной бумаги от рыночной котировки.

Контроль направлен на проверку значения цены базового актива, которая сравнивается с его рыночной котировкой. Выполняется только в отношении акций и облигаций, учитываемых в НРД. Допустимый процент отклонения цены может быть изменен по требованию клиентов.

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1.	<b>Анкета договора купли-продажи облигации (CM042 – bondSimpleTransaction)</b>	" <a href="#">NRW014</a> – Возможная ошибка: цена базового актива отклоняется от рыночной на 20%" и более
1.1	<b>Указанная цена (в %)</b> – cleanPrice. <b>Текущая цена (в %)</b> – поиск котировки в корпоративной базе данных НРД на дату est_date по идентификатору instrumentId. Если инструмент не найден, проверка не выполняется. Если отклонение в процентах $ ((\text{указанная цена} - \text{текущая цена})/\text{текущая цена}) * 100  = > 20\%$ , то комментарий в RM006.	
2.	<b>Анкета форварда на облигацию или индекс (CM043 bondForward)</b>	
2.1	<b>Указанная цена (в валюте)</b> – forwardPricePerBond. <b>Текущая цена (в валюте)</b> – поиск котировки в корпоративной базе данных НРД на дату est_date по идентификатору instrumentId. Если инструмент не найден, проверка не выполняется. Если валюта указанной цены отличается от валюты текущей цены, то значение указанной цены переводится в валюту текущей цены по официальному курсу Банка России на дату сделки. Если отклонение в процентах $ ((\text{указанная цена} - \text{текущая цена})/\text{текущая цена}) * 100  = > 20\%$ , то комментарий в RM006.	
2.2	<b>Указанная цена (в %)</b> – forwardPricePercentage. <b>Текущая цена (в %)</b> – поиск котировки в корпоративной базе данных НРД на дату est_date по идентификатору instrumentId. Если инструмент не найден, проверка не выполняется. Если отклонение в процентах $ ((\text{указанная цена} - \text{текущая цена})/\text{текущая цена}) * 100  = > 20\%$ то комментарий в RM006.	
3.	<b>Анкета опциона на облигацию (CM044 – bondOption)</b>	

3.1	<p><b>Указанная цена (в валюте)</b> – strikePrice.</p> <p><b>Текущая цена (в валюте)</b> – поиск котировки в корпоративной базе данных НРД по идентификатору <i>instrumentId</i>. Если инструмент не найден, проверка не выполняется.</p> <p>Если отклонение в процентах <math> ((\text{указанная цена} - \text{текущая цена})/\text{текущая цена}) * 100  = &gt; 20\%</math>, то комментарий в RM006.</p>	
3.2	<p><b>Указанная цена (в %)</b> – strikePercentage.</p> <p><b>Текущая цена (в %)</b> – поиск котировки в корпоративной базе данных НРД на дату <i>est_date</i> по идентификатору <i>instrumentId</i>. Если инструмент не найден, проверка не выполняется.</p> <p>Если отклонение в процентах <math> ((\text{указанная цена} - \text{текущая цена})/\text{текущая цена}) * 100  = &gt; 20\%</math> то комментарий в RM006.</p>	
4	<b>Анкета договора купли-продажи акции (CM046 – equitySimpleTransaction)</b>	
4.1	<p><b>Указанная цена</b> – unitPrice.</p> <p><b>Текущая цена</b> – поиск котировки в корпоративной базе данных НРД на дату <i>est_date</i> по идентификатору <i>instrumentId</i>. Если инструмент не найден, проверка не выполняется.</p> <p>Если отклонение в процентах <math> ((\text{указанная цена} - \text{текущая цена})/\text{текущая цена}) * 100  = &gt; 20\%</math>, то комментарий в RM006.</p>	
5.	<b>Анкета форварда на акцию (CM047 – equityForward)</b>	
5.1	<p><b>Указанная цена</b> – forwardPrice.</p> <p><b>Текущая цена</b> – поиск котировки в корпоративной базе данных НРД на дату <i>est_date</i> по идентификатору <i>instrumentId</i>. Если инструмент не найден, проверка не выполняется.</p> <p>Если отклонение в процентах <math> ((\text{указанная цена} - \text{текущая цена})/\text{текущая цена}) * 100  = &gt; 20\%</math>, то комментарий в RM006.</p>	
6.	<b>Анкета опциона на акцию (CM048 equityOption)</b>	
6.1	<p><b>Указанная цена</b> – strikePrice.</p> <p><b>Текущая цена</b> – поиск котировки в корпоративной базе данных НРД на дату <i>est_date</i> по идентификатору <i>instrumentId</i>. Если инструмент не найден, проверка не выполняется.</p> <p>Если отклонение в процентах <math> ((\text{указанная цена} - \text{текущая цена})/\text{текущая цена}) * 100  = &gt; 20\%</math>, то комментарий в RM006.</p>	

### 1.2.9. Проверка даты расчетов относительно даты погашения облигации.

В случае, когда дата расчетов по договору превышает дату погашения облигации, Репозиторий направляет уведомление. Проверка выполняется только в отношении облигаций, учитываемых в НРД.

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1.	<b>Анкета договора РЕПО (CM041 - repo)</b>	



1.1	<p><b>Дата расчетов (поставки):</b> spotLeg/settlementDate spotLeg/deliveryDate forwardLeg/settlementDate forwardLeg/deliveryDate</p> <p><b>Дата окончания срока действия договора:</b> endAgreementDate.</p> <p><b>Дата погашения облигации (Maturity Date)</b> – поиск даты погашения в корпоративной базе данных НРД по идентификатору <i>instrumentId</i>. Если инструмент не найден, проверка не выполняется.</p> <p>Если Дата расчетов / окончания срока действия договора &gt; Дата погашения, то комментарий в RM006.</p>	"NRW015 - Возможная ошибка: дата окончания действия договора больше даты погашения облигации"
2.	<b>Анкета договора купли-продажи облигации (CM042 – bondSimpleTransaction)</b>	
2.1	<p><b>Дата расчетов:</b> settlementDate.</p> <p><b>Дата окончания срока действия договора:</b> endAgreementDate.</p> <p><b>Дата погашения облигации (Maturity Date)</b> – поиск даты погашения в корпоративной базе данных НРД по идентификатору <i>instrumentId</i>. Если инструмент не найден, проверка не выполняется.</p> <p>Если Дата расчетов / окончания срока действия договора &gt; Дата погашения, то комментарий в RM006.</p>	
3.	<b>Анкета форварда на облигацию или индекс (CM043 bondForward)</b>	
3.1	<p><b>Дата расчетов:</b> settlementDate.</p> <p><b>Дата окончания срока действия договора:</b> endAgreementDate.</p> <p><b>Дата погашения облигации (Maturity Date)</b> – поиск даты погашения в корпоративной базе данных НРД по идентификатору <i>instrumentId</i>. Если инструмент не найден, проверка не выполняется.</p> <p>Если Дата расчетов / окончания срока действия договора &gt; Дата погашения, то комментарий в RM006.</p>	
4	<b>Анкета опциона на облигацию (CM044 – bondOption)</b>	
4.1	<p><b>Дата исполнения:</b> americanExercise/expirationDate europeanExercise/expirationDate</p> <p><b>Дата окончания срока действия договора:</b> endAgreementDate.</p> <p><b>Дата погашения облигации (Maturity Date)</b> – поиск даты погашения в корпоративной базе данных по идентификатору <i>instrumentId</i>. Если инструмент не найден, то проверка не выполняется.</p> <p>Если Дата исполнения / окончания срока действия договора &gt; Дата погашения, то комментарий в RM006.</p>	

### 1.3. Проверка на дубликат сообщения.

Для предотвращения повторной регистрации анкеты договора или генерального соглашения, Репозиторий, в дополнение к текущей проверке по уникальному коду UTI, вводит дополнительную проверку на дубликат договора или генерального соглашения, ранее зарегистрированного в реестре.

На первом этапе проверяется, что для нового сообщения нет повторного сообщения, находящегося в **состоянии ожидания согласования** анкеты со стороны контрагента. Если повторное сообщение найдено, участник получит уведомление о возможном дубликате.

На втором этапе проверяется, что для нового сообщения нет ранее зарегистрированного договора или генерального соглашения в **реестре договоров**. Если подобная информация будет найдена в реестре, участник получит уведомление о возможном дубликате.

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1.	<b>Все анкеты, кроме bulk-отчетов CM083, CM084, CM085</b>	"NRW018 -
1.1	<p><b>Этап 1. Поиск повторного сообщения, находящегося в режиме ожидания.</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Формируется список ранее полученных сообщений.</li> <li>2. Выбираются все анкеты генеральных соглашений и договоров, находящиеся в стадии ожидания, полученные от того же отправителя, с теми же сторонами соглашения или договора, что и у нового сообщения. Создается первичный список сообщений-кандидатов.</li> <li>3. Если сообщение на первичную регистрацию и клиентский номер со стороны отправителя не заполнен (пуст или NONREF), то из списка сообщений-кандидатов отбираются сообщения, у которых не заполнен клиентский номер сделки отправителя.</li> <li>4. Для каждого сообщения из полученного списка необходимо обратиться к справочной таблице (в <a href="#">Приложении 3</a>) полей поиска и по списку полей для генерального соглашения и договора, провести сверку по всем полям на соответствие между новым сообщением и сообщением из списка кандидатов.</li> <li>5. Если в списке сообщение найдено – формируется уведомление RM006.</li> </ol>	<p>Возможен дубликат договора &lt;UTI старого договора&gt;, &lt;Реп.код договора сообщения&gt;"</p>
1.2	<p><b>Этап 2. Поиск ранее зарегистрированного договора/генерального соглашения.</b></p> <p>Этот алгоритм применяется только для анкет, поданных на первичную регистрацию.</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Формируется список ранее зарегистрированных договоров/генеральных соглашений – кандидатов на дубликат.</li> <li>2. Выбираются все ранее зарегистрированные за последние 4 операционных дня анкеты, со сторонами договора, что и в новом сообщении. Создается первичный список сообщений-кандидатов.</li> <li>3. Для каждого сообщения из полученного списка необходимо обратиться к справочной таблице (в <a href="#">Приложении 3</a>) полей поиска и по списку полей для генерального соглашения и договора, провести сверку по всем полям на соответствие между новым сообщением и сообщением из списка кандидатов.</li> <li>4. Если в списке сообщение найдено – формируется уведомление RM006.</li> </ol>	

## 1.4. Проверки соблюдения сроков предоставления отчетов CM093 и CM094.

Процедуры запускаются согласно расписанию в рамках регламентных процедур операционного дня.

### 1.4.1. Проверка сроков предоставления Анкеты о состоянии обязательств по договорам (CM093).

Процедура запускается ежедневно в рабочие дни для выявления просрочки отчетности по дерегистрации договоров, а также предупреждения о необходимости предоставления такой отчетности.

**Алгоритм работы процедуры:**

1. Производится выборка из реестра основных параметров (репозитарный номер договора, тип договора, Сторона1, Сторона2, дата окончания срока действия) по всем анкетам, которые удовлетворяют условиям:

- Тип договора: CM021-CM081.
- Дата окончания срока действия договора (см. [примечание 1](#)) + 3 рабочих дня <= текущая дата операционного дня.
- Договор открыт (Статус = 'C','E','O' или 'P').
- Флаг автоматического закрытия договора не установлен (CONTRACTS.AUTO\_EXECUTE != 'Y') или статус не равен 'O' (договор открыт).

2. Для каждого отобранного договора осуществляется поиск Информирующего лица для указанных сторон(ы).

3. Для каждого найденного Информирующего лица формируется сообщение (RM006) со списком договоров, которые могут быть просрочены завтра или уже просрочены:

"[NRW016](#) - Возможная просрочка отчетности обязательств по договорам <список договоров (репозитарный номер договора, дата окончания срока действия договора)>. Для закрытия договоров необходимо отправить CM093".

### 1.4.2. Проверка сроков предоставления Отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости (CM094).

Процедура запускается ежемесячно на 4-ый рабочий день месяца и направлена на предупреждение о необходимости предоставления отчетности по справедливой стоимости за предыдущий месяц.

#### Алгоритм работы процедуры:

1. Производится выборка из реестра основных параметров (репозитарный номер договора, тип договора, Сторона1, Сторона2, дата окончания срока действия договора) по всем анкетам договоров, удовлетворяющим следующим условиям:

- Тип договора: все анкеты договоров, кроме CM021(NonDerivative), CM022(Spot), CM041, CM042, CM046, CM083, CM084, CM085.
- Договор не отменен.
- Дата сделки < 1-го числа текущего месяца.
- Договор в статусе RERE, REGI ИЛИ договор в статусе DERI с <asOfDate> статуса => 1-го числа предыдущего месяца ИЛИ по договору имеется сообщение в статусе WAITCN в Журнале учета входящих сообщений.
- Дата окончания срока действия договора (см. [примечание 1](#))> Дата начала срока действия договора.
- Даты последней отчетности справедливой/оценочной стоимости по договору не установлены либо не попадают в отчетный период (< 1-го числа предыдущего месяца).

2. Для каждого отобранного договора осуществляется поиск Информирующего лица, наделенного на текущий момент полномочиями на регистрацию CM094 для указанных сторон(ы).

3. Для каждого найденного Информирующего лица формируется сообщение (RM006) со списком договоров, отчетность справедливой/оценочной стоимости по которым могла быть просрочена:

"[NRW017](#) - Возможная просрочка отчетности справедливой/оценочной стоимости по договорам. <список договоров (номер договора, дата окончания действия договора)>. Для закрытия договоров необходимо отправить CM094"

### Примечание 1: Алгоритм выбора даты окончания действия договора в зависимости от его типа

№	Тип договора	Поле, используемое для проверки
1	Анкета валютного свопа (CM021)	farLeg/valueDate

2.	Анкета валютного форварда (CM022)	valueDate
3.	Анкета валютного опциона (CM023)	expiryDate
4.	Анкета бинарного валютного опциона (CM024)	expiryDate
5.	Анкета соглашения о будущей процентной ставке (CM031)	paymentDate, adjustedTerminationDate
6.	Анкета процентного свопа (CM032)	terminationDate
7.	Анкета договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки (CM033)	terminationDate
8.	Анкета свопциона (CM034)	expirationDate, terminationDate
11.	Анкета форварда на облигацию или индекс (CM043)	settlementDate
12.	Анкета опциона на облигацию (CM044)	expirationDate
13.	Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (CM045)	expirationDate
15.	Анкета форварда на акцию (CM047)	expirationDate
16.	Анкета опциона на акцию (CM048)	expirationDate
17.	Анкета товарного форварда (CM051)	paymentDates, deliveryPeriods
18.	Анкета товарного опциона (CM052)	expirationDate
19.	Анкета товарного свопа (CM053)	terminationDate
20.	Анкета товарного свопциона (CM054)	expirationDate, expirationDates
21.	Анкета свопа дохода на облигацию (CM061)	interestLegPaymentDates, paymentDates
22.	Анкета свопа дохода на акцию (CM062)	interestLegPaymentDates, paymentDates
23.	Анкета кредитного дефолтного свопа (CM071)	scheduledTerminationDate
24.	Анкета кредитного дефолтного свопциона (CM072)	expirationDate
25.	Анкета иной сделки (CM081)	settlementDate

## 2. Проверки, вызывающие отказы в обработке сообщений

**Примечание:** проверка не выполняется в том случае, если указанный для проверки тэг отсутствует во входящем сообщении (при условии, что по xsd-схеме допускается отсутствие тэга и нет дополнительных проверок его обязательного заполнения).

## 2.1. Проверка наименования стороны по договору, не являющейся клиентом Репозитария НРД.

№	Описание проверки	Номер ошибки
1	partyName ≠ NONREF partyName ≠ NONAME partyName ≠ « » (пробел) Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD204</a>

## 2.2. Проверка корректного указания кода клиента стороны.

№	Описание проверки	Номер ошибки
1	Для классификатора и страны клиента стороны <b>P, RU</b> указывается код по маске <b>PASS_</b> или <b>SNILS_</b>	<a href="#">NRD143</a>
2	Для классификатора и страны и клиента стороны <b>L, F, RU</b> указывается код по маске <b>LEI_</b> или <b>INN_</b>	<a href="#">NRD143</a>
3	Для классификатора и страны клиента стороны <b>P, не RU</b> указывается код по маске <b>OWN_</b> или <b>PASS_</b>	<a href="#">NRD143</a>
4	Для классификатора и страны клиента стороны <b>L, F, не RU</b> указывается код по маске <b>LEI_</b> или <b>SWIFT_</b> или <b>BLOOM_</b> или <b>THRTR_</b> или <b>OWN_</b> или <b>INN_</b>	<a href="#">NRD143</a>

## 2.3. Проверка хронологии указания дат.

№	Описание проверки	Номер ошибки
<b>1</b>	<b>Для всех сделок</b>	
1.1	Дата сделки ≤ Дата регистрации сообщения в журнале входящих сообщений (текущая дата). tradeDate ≤ Reg_date Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
1.2	Дата сделки ≤ Дата совершения отчитываемого события. tradeDate ≤ asOfDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
1.3	Дата начала срока действия договора ≤ Дата окончания срока действия договора. startAgreementDate ≤ endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
<b>2</b>	<b>Анкета валютного свопа (CM021 – fxSwap)</b>	
2.1	Дата сделки ≤ Дата валютирования (1 части). tradeDate ≤ nearLeg/valueDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>

2.2	Дата валютирования (1 части) <= Дата валютирования (2 части). nearLeg/valueDate <= farLeg/valueDate. Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
2.3	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата валютирования (2 части) <= Дата окончания срока действия договора. farLeg/valueDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD226</a>
<b>3</b>	<b>Анкета конверсионной сделки (валютного форварда) (CM022 – fxSingleLeg)</b>	
3.1	Дата сделки <= Дата валютирования. tradeDate <= valueDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
3.2	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата валютирования <= Дата окончания срока действия договора. valueDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD226</a>
<b>4</b>	<b>Анкета валютного опциона (CM023 – fxOption)</b>	
4.1	Дата сделки <= Начальная дата <= Даты истечения американского/бермудского опциона <= Дата истечения. tradeDate <= americanExercise/commencementDate или americanExercise/bermudaExerciseDates <= americanExercise/expiryDate Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD201</a>
4.2	Дата сделки <= Дата истечения европейского опциона. tradeDate <= europeanExercise/expiryDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
4.3	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора. americanExercise/bermudaExerciseDates или americanExercise/expiryDate или europeanExercise/expiryDate <= endAgreementDate Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD226</a>
<b>5</b>	<b>Анкета бинарного валютного опциона (CM024 – fxDigitalOption)</b>	
5.1	Дата сделки <= Начальная дата <= Даты истечения <= Дата истечения. tradeDate <= americanExercise/commencementDate или americanExercise/bermudaExerciseDates <= americanExercise/expiryDate Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD201</a>
5.2	Дата сделки <= Дата истечения. tradeDate <= europeanExercise/expiryDate	<a href="#">NRD199</a>

	Если условие не выполняется – отказ.	
5.3	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора. americanExercise/bermudaExerciseDates/date или americanExercise/expiryDate или europeanExercise/expiryDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD226</a>
<b>6</b>	<b>Анкета соглашения о будущей процентной ставке (CM031 – fra)</b>	
6.1	Дата сделки <= Дата платежа tradeDate <= paymentDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD201</a>
6.2	Дата сделки <= Дата истечения срока. tradeDate <= adjustedTerminationDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD201</a>
6.3	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата платежа <= Дата окончания срока действия договора. paymentDate, adjustedTerminationDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD226</a>
<b>7</b>	<b>Анкета процентного свопа (CM032 – swap)</b>	
7.1	Дата сделки <= Дата истечения срока. tradeDate <= terminationDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD200</a>
7.2	Дата сделки <= Дата истечения срока. tradeDate <= terminationDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD200</a>
7.3	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения срока <= Дата окончания срока действия договора. terminationDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD226</a>
<b>8</b>	<b>Анкета договора фиксации максимальной/ минимальной процентной ставки (CM033 – capFloor)</b>	
8.1	Дата сделки <= Дата истечения срока. tradeDate <= terminationDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD200</a>
8.2	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения срока <= Дата окончания срока действия договора. terminationDate <= endAgreementDate	<a href="#">NRD226</a>

	Если условие не выполняется – отказ.	
<b>9</b>	<b>Анкета свопциона (СМ034 – swaption)</b>	
9.1	Дата сделки <= Начальная дата <= Дата истечения. tradeDate <= americanExercise/commencementDate <= americanExercise/expirationDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD200</a>
9.2	Дата сделки <= Даты истечения. tradeDate <= bermudaExercise/bermudaExerciseDates Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
9.3	Дата сделки <= Дата истечения. tradeDate <= europeanExercise/expirationDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
9.4	Дата сделки <= Дата истечения срока. tradeDate <= terminationDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD200</a>
9.6	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения срока <= Дата окончания срока действия договора americanExercise/expirationDate или bermudaExercise/bermudaExerciseDates или europeanExercise/expirationDate <= terminationDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD226</a>
<b>10</b>	<b>Анкета договора РЕПО (СМ041 - repo)</b>	
10.1	Дата сделки <= Дата расчетов (1 части). tradeDate <= spotLeg/settlementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
10.2	Дата расчетов (1 части) <= Дата расчетов (2 части) spotLeg/settlementDate <= forwardLeg/settlementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
10.3	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата расчетов (2 части) <= Дата окончания срока действия договора. forwardLeg/settlementDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD226</a>
10.4	Дата сделки <= Дата поставки (1 части). tradeDate <= spotLeg/deliveryDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
10.5	Дата поставки (1 части) <= Дата поставки (2 части).	<a href="#">NRD199</a>



	spotLeg/deliveryDate <= forwardLeg/deliveryDate Если условие не выполняется – отказ.	
<b>11</b>	<b>Анкета договора купли-продажи облигации (CM042 – bondSimpleTransaction)</b>	
11.1	Дата сделки <= Дата расчетов. tradeDate <= settlementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
11.2	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата расчетов <= Дата окончания срока действия договора. settlementDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD226</a>
11.3	Дата сделки <= Дата поставки. tradeDate <= deliveryDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
<b>12</b>	<b>Анкета форварда на облигацию или индекс (CM043 bondForward)</b>	
12.1	Дата сделки <= Дата расчетов. tradeDate <= settlementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
12.2	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата расчетов <= Дата окончания срока действия договора. settlementDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD226</a>
<b>13</b>	<b>Анкета опциона на облигацию (CM044 – bondOption)</b>	
13.1	Дата сделки <= Начальная дата <= Дата истечения. tradeDate <= americanExercise/commencementDate <= americanExercise/expirationDate Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD200</a>
13.2	Дата сделки <= Даты истечения. tradeDate <= bermudaExercise/bermudaExerciseDates Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
13.3	Дата сделки <= Дата истечения. tradeDate <= europeanExercise/expirationDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
13.4	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора.	<a href="#">NRD226</a>

	americanExercise/expirationDate или bermudaExercise/bermudaExerciseDates или europeanExercise/expirationDate <= endAgreementDate  Если условие не выполняется – отказ.	
<b>14</b>	<b>Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (CM045 – bondBasketOption)</b>	
14.1	Дата сделки <= Начальная дата <= Дата истечения. tradeDate <= americanExercise/commencementDate <= americanExercise/expirationDate  Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD200</a>
14.2	Дата сделки <= Даты истечения. tradeDate <= bermudaExercise/bermudaExerciseDates  Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
14.3	Дата сделки <= Дата истечения. tradeDate <= europeanExercise/expirationDate  Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
14.4	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора. americanExercise/expirationDate или bermudaExercise/bermudaExerciseDates или europeanExercise/expirationDate <= endAgreementDate  Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD226</a>
<b>15</b>	<b>Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (CM045 – bondBasketOption)</b>	
15.1	Дата сделки <= Дата расчетов tradeDate <= settlementDate  Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
15.2	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата расчетов <= Дата окончания срока действия договора. settlementDate <= endAgreementDate  Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD226</a>
15.3	Дата сделки <= Дата поставки. tradeDate <= deliveryDate  Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
<b>16</b>	<b>Анкета форварда на акцию (CM047 – equityForward)</b>	
16.1	Дата сделки <= Дата расчетов. tradeDate <= expirationDate  Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
16.2	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки:	<a href="#">NRD226</a>

	Дата расчетов <= Дата окончания срока действия договора. expirationDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ.	
<b>17</b>	<b>Анкета опциона на акцию (CM048 equityOption)</b>	
17.1	Дата сделки <= Начальная дата. <= Дата истечения. tradeDate <= equityAmericanExercise/commencementDate <= equityAmericanExercise/expirationDate Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD200</a>
17.2	Дата сделки <= Начальная дата <= Даты истечения <= Дата истечения. tradeDate <= equityBermudaExercise/commencementDate <= equityBermudaExercise/bermudaExerciseDates <= equityBermudaExercise/:expirationDate Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD201</a>
17.3	Дата сделки <= Дата истечения. tradeDate <= equityEuropeanExercise/expirationDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
17.4	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора. equityAmericanExercise/expirationDate или equityBermudaExercise/expirationDate или equityEuropeanExercise/expirationDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD226</a>
<b>18</b>	<b>Анкета товарного форварда (CM051 – commodityForward)</b>	
18.1	Дата сделки <= Даты платежей. tradeDate <= fixedLeg/paymentDates Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
18.2	Дата сделки <= Даты поставки. tradeDate <= commodityForwardPhysicalLeg/deliveryPeriods/periods Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
18.3	Дата сделки <= Даты платежей. tradeDate <= floatingForwardLeg/paymentDates Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
18.4	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Даты платежей <= Дата окончания срока действия договора. Max (fixedLeg/paymentDates, commodityForwardPhysicalLeg/deliveryPeriods/periods, floatingForwardLeg/paymentDates) <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD226</a>

<b>19</b>	<b>Анкета товарного опциона (CM052 – commodityOption)</b>	
19.1	Дата сделки <= Начальная дата <= Дата истечения. tradeDate <= americanExercise/exercisePeriod/commencementDate <= americanExercise/exercisePeriod/expirationDate Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD200</a>
19.2	Дата сделки <= Даты истечения. tradeDate <= europeanExercise/expirationDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
19.3	Дата сделки <= Даты платежей tradeDate <= paymentDates Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
19.4	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора. americanExercise/exercisePeriod/expirationDate или europeanExercise/expirationDate, paymentDates <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD226</a>
<b>20</b>	<b>Анкета товарного свопа (CM053 – commoditySwap)</b>	
20.1	Дата сделки <= Даты платежей tradeDate <= fixedLeg/paymentDates Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD201</a>
20.2	Дата сделки <= Дата истечения срока. tradeDate <= terminationDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD201</a>
20.3	Дата сделки <= Даты поставки tradeDate <= commoditySwapPhysicalLeg/deliveryPeriods/periods Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD201</a>
20.4	Дата сделки <= Дата истечения срока. tradeDate <= terminationDate Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD201</a>
20.5	Дата сделки <= Даты платежей tradeDate <= floatingLegNsd/paymentDates Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD201</a>
20.6	Дата сделки <= Дата истечения срока. tradeDate <= terminationDate Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD201</a>
20.4	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки:	<a href="#">NRD226</a>

	Дата истечения срока <= Дата окончания срока действия договора. terminationDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ.	
<b>21</b>	<b>Анкета товарного свопциона (CM054 – commoditySwaption)</b>	
21.1	Дата сделки <= Даты платежей tradeDate <= fixedLeg/paymentDates Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD201</a>
21.2	Дата сделки <= Дата истечения срока. tradeDate <= terminationDate Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD201</a>
21.3	Дата сделки <= Даты поставки tradeDate <= commoditySwapPhysicalLeg/deliveryPeriods/periods Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD201</a>
21.4	Дата сделки <= Дата истечения срока. tradeDate <= terminationDate Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD201</a>
21.5	Дата сделки <= Даты платежей tradeDate <= floatingLegNsd/paymentDates Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD201</a>
21.6	Дата сделки <= Дата истечения срока. tradeDate <= terminationDate Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD201</a>
21.7	Дата сделки <= Начальная дата <= Дата истечения. americanExercise/commencementDates <= americanExercise/expirationDates Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD200</a>
21.8	Дата сделки <= Дата истечения. tradeDate <= europeanExercise/expirationDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
21.9	Дата сделки <= Даты истечения. tradeDate <= europeanExercise/expirationDates Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
21.10	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора. americanExercise/expirationDates или europeanExercise/expirationDate или europeanExercise/expirationDates <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD226</a>

<b>22</b>	<b>Анкета свопа дохода на облигацию (CM061 – bondSwap)</b>	
22.1	Дата сделки <= Даты платежей. tradeDate <= bondReturn/paymentDates. Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
22.2	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Даты платежей <= Дата окончания срока действия договора. Max (interestLegPaymentDates, bondReturn/paymentDates) <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD226</a>
<b>23</b>	<b>Анкета свопа дохода на акцию (CM062 – equitySwapTransactionSupplement)</b>	
23.1	Дата сделки <= Дата платежа tradeDate <= rateOfReturn/paymentDates/paymentDateFinal Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
23.2	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата платежа <= Дата окончания срока действия договора. Max (interestLegPaymentDates, rateOfReturn/paymentDates/paymentDateFinal) <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD226</a>
<b>24</b>	<b>Анкета кредитного дефолтного свопа (CM071 – creditDefaultSwap)</b>	
24.1	Дата сделки <= Плановая дата окончания срока. tradeDate <= scheduledTerminationDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD200</a>
24.2	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Плановая дата окончания срока <= Дата окончания срока действия договора. scheduledTerminationDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD226</a>
<b>25</b>	<b>Анкета кредитного дефолтного свопциона (CM072 – creditDefaultSwapOption)</b>	
25.1	Дата сделки <= Дата истечения срока. tradeDate <= scheduledTerminationDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD200</a>
25.2	Дата сделки <= Начальная дата <= Дата истечения. tradeDate <= americanExercise/commencementDate <= americanExercise/expirationDate Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD200</a>

25.3	Дата сделки <= Даты истечения. tradeDate <= bermudaExercise/bermudaExerciseDates Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
25.4	Дата сделки <= Дата истечения. tradeDate <= europeanExercise/expirationDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
25.5	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора. americanExercise/expirationDate или bermudaExercise/bermudaExerciseDates или europeanExercise/expirationDate, scheduledTerminationDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется - отказ	<a href="#">NRD226</a>
<b>26</b>	<b>Анкета иной сделки (CM081 – generalProduct)</b>	
26.1	Дата сделки <= Даты платежей. tradeDate <= settlementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD199</a>
26.3	Если установлен флаг автоматического закрытия сделки: Даты платежей <= Дата окончания срока действия договора. settlementDate <= endAgreementDate Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD226</a>

#### 2.4. Проверка последовательности указания частей сделки/валюты (валютный своп).

При заполнении сведений о первой и второй частях сделки «валютный своп» выполняется проверка последовательности указания валют, проверка на указание одной и той же валютной пары в обеих частях сделки.

№	Описание проверки	Ошибка
	<b>Анкета валютного свопа (CM021 – fxSwap)</b>	
1	Currency1 = Currency1 <ul style="list-style-type: none"> <li>nearLeg/exchangedCurrency1/paymentAmount/currency = nearLeg/exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency1 = farLeg/exchangedCurrency1/paymentAmount/currency = farLeg/exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency1</li> </ul> Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD202</a>
2	Currency2 = Currency2 <ul style="list-style-type: none"> <li>nearLeg/exchangedCurrency2/paymentAmount/currency = nearLeg/exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency2 = farLeg/exchangedCurrency2/paymentAmount/currency = farLeg/exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency2</li> </ul> Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD202</a>

**2.5. Проверка на указание неотрицательного значения для полей типа «Количество» и «Номинальная сумма».**

№	Описание проверки	Ошибка
1	<b>Анкета валютного свопа (CM021 – fxSwap)</b>	
1.1	Проверить значения сумм: exchangedCurrency1/paymentAmount exchangedCurrency2/paymentAmount Если значение < 0, то отказ.	<a href="#">NRD233</a>
2	<b>Анкета конверсионной сделки (валютного форварда) (CM022 – fxSingleLeg)</b>	
2.1	Проверить значения сумм: exchangedCurrency1/paymentAmount exchangedCurrency2/paymentAmount Если значение < 0, то отказ.	<a href="#">NRD233</a>
3.	<b>Анкета валютного опциона (CM023 – fxOption)</b>	
3.1	Проверить значения сумм: putCurrencyAmount callCurrencyAmount premium/paymentAmount Если значение < 0, то отказ.	<a href="#">NRD233</a>
4.	<b>Анкета бинарного валютного опциона (CM024 – fxDigitalOption)</b>	
4.1	Проверить значения сумм: payout premium/paymentAmount Если значение < 0, то отказ.	<a href="#">NRD233</a>
5.	<b>Анкета соглашения о будущей процентной ставке (CM031 – fra)</b>	
5.1	Проверить значение суммы: notional Если значение < 0, то отказ.	<a href="#">NRD233</a>
6.	<b>Анкета процентного свопа (CM032 – swap)</b>	
6.1	Проверить значение суммы: notionalStepSchedule/initialValue knownAmountSchedule/initialValue Если значение < 0, то отказ.	<a href="#">NRD233</a>
7.	<b>Анкета договора фиксации максимальной/ минимальной процентной ставки (CM033 – capFloor)</b>	
7.1	Проверить значения сумм:	<a href="#">NRD233</a>



	notionalStepSchedule/initialValue premium/paymentAmount Если значение < 0, то отказ.	
8	<b>Анкета свопциона (CM034 – swaption)</b>	
8.1	Проверить значения сумм: notionalStepSchedule/initialValue knownAmountSchedule/initialValue premium/paymentAmount Если значение < 0, то отказ.	<a href="#">NRD233</a>
9.	<b>Анкета договора РЕПО (CM041 - repo)</b>	
9.1	Проверить значения: spotLeg/settlementAmount spotLeg/collateral/nominalAmount/amount* spotLeg/collateral/numberOfUnits* spotLeg/collateral/unitPrice/amount* forwardLeg/settlementAmount/amount Если значение < 0, то отказ. Поля блока <collateral> (отмечены *) не проверяются для сделок из шины СУО-Репозитарий.	<a href="#">NRD203</a>
10.	<b>Анкета договора купли-продажи облигации (CM042 – bondSimpleTransaction)</b>	
10.1	Проверить значения: notionalAmount price/cleanPrice Если значение < 0, то отказ.	<a href="#">NRD203</a>
11.	<b>Анкета форварда на облигацию или индекс (CM043 – bondForward)</b>	
11.1	Проверить значения: notionalAmount forwardPrice/forwardPricePercentage underlyer/singleUnderlyer/openUnits underlyer/basket/openUnits underlyer/basket/basketConstituent/constituentWeight/openUnits underlyer/basket/basketConstituent/constituentWeight/basketAmount Если значение < 0, то отказ.	<a href="#">NRD203</a>
12.	<b>Анкета опциона на облигацию (CM044 – bondOption)</b>	
12.1	Проверить значения: optionEntitlement numberOfOptions notionalAmount premium/paymentAmount strike/price/strikePrice strike/price/strikePercentage	<a href="#">NRD203</a>

	Если значение < 0, то отказ.	
13.	<b>Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (CM045 – bondBasketOption)</b>	
13.1	<p>Проверить значения:</p> <p>notionalAmount optionEntitlement numberOfOptions premium/paymentAmount strike/price/strikePrice strike/price/strikePercentage basket/openUnits basket/basketConstituent/constituentWeight/openUnits basket/basketConstituent/constituentWeight/basketAmount</p> <p>Если значение &lt; 0, то отказ.</p>	<a href="#">NRD203</a>
14.	<b>Анкета договора купли-продажи акции (CM046 – equitySimpleTransaction)</b>	
14.1	<p>Проверить значения:</p> <p>numberOfUnits unitPrice/amount</p> <p>Если значение &lt; 0, то отказ.</p>	<a href="#">NRD203</a>
15.	<b>Анкета форварда на акцию (CM047 – equityForward)</b>	
15.1	<p>Проверить значения:</p> <p>forwardPrice/amount underlyer/singleUnderlyer/openUnits underlyer/basket/openUnits underlyer/basket/basketConstituent/constituentWeight/openUnits underlyer/basket/basketConstituent/constituentWeight/basketAmount</p> <p>Если значение &lt; 0, то отказ.</p>	<a href="#">NRD203</a>
16.	<b>Анкета опциона на акцию (CM048 – equityOption)</b>	
16.1	<p>Проверить значения:</p> <p>numberOfOptions optionEntitlement underlyer/singleUnderlyer/openUnits underlyer/basket/openUnits underlyer/basket/basketConstituent/constituentWeight/openUnits underlyer/basket/basketConstituent/constituentWeight/basketAmount equityPremium/paymentAmount strike/strikePrice</p> <p>Если значение &lt; 0, то отказ.</p>	<a href="#">NRD203</a>
17.	<b>Анкета товарного форварда (CM051 – commodityForward)</b>	
17.1	<p>Проверить значения:</p> <p>floatingForwardLeg/totalNotionalQuantity commodityForwardPhysicalLeg/deliveryQuantity/totalPhysicalQuantity/quantity fixedLeg/totalPrice/amount</p>	<a href="#">NRD203</a>

	fixedLeg/fixedPrice/price Если значение < 0, то отказ.	
18.	<b>Анкета товарного опциона (CM052 – commodityOption)</b>	
18.1	Проверить значения: totalNotionalQuantity premium/paymentAmount weatherIndexStrikeLevel/quantity Если значение < 0, то отказ.	<a href="#">NRD203</a>
19.	<b>Анкета товарного свопа (CM053 – commoditySwap)</b>	
19.1	Проверить значения: floatingLegNsd/totalNotionalQuantity commoditySwapPhysicalLeg/deliveryQuantity/totalPhysicalQuantity/quantity fixedLeg/totalNotionalQuantity fixedLeg/totalPrice/amount floatingLegNsd/initialPrice weatherLeg/weatherIndexLevel/quantity Если значение < 0, то отказ.	<a href="#">NRD203</a>
20.	<b>Анкета товарного свопциона (CM054 – commoditySwaption)</b>	
20.1	Проверить значения: floatingLegNsd/totalNotionalQuantity commoditySwapPhysicalLeg/deliveryQuantity/totalPhysicalQuantity/quantity fixedLeg/totalNotionalQuantity fixedLeg/totalPrice/amount premium/paymentAmount floatingLegNsd/initialPrice weatherLeg/weatherIndexLevel/quantity Если значение < 0, то отказ.	<a href="#">NRD203</a>
21.	<b>Анкета свопа дохода на облигацию (CM061 – bondSwap)</b>	
21.1	Проверить значения: interestLeg/notional/notionalAmount/amount interestLeg/interestCalculation/floatingRateCalculation/initialRate interestLeg/interestCalculation/fixedRate bondReturnLeg/underlyer/singleUnderlyer/openUnits bondReturnLeg/underlyer/basket/openUnits bondReturnLeg/underlyer/basket/basketConstituent/constituentWeight/openUnits bondReturnLeg/underlyer/basket/basketConstituent/constituentWeight/basketAmount/amount bondReturnLeg/notionalAmount/amount Если значение < 0, то отказ.	<a href="#">NRD203</a>
22.	<b>Анкета свопа дохода на акцию (CM062 – equitySwapTransactionSupplement)</b>	
22.1	Проверить значения: interestLeg/notional/notionalAmount/amount interestLeg/interestCalculation/floatingRateCalculation/initialRate	<a href="#">NRD203</a>

	<p>interestLeg/interestCalculation/fixedRate  returnLeg/notional/notionalAmount/amount  returnLeg/underlyer/singleUnderlyer/openUnits  returnLeg/underlyer/basket/openUnits  returnLeg/underlyer/basket/basketConstituent/constituentWeight/openUnits  returnLeg/underlyer/basket/basketConstituent/constituentWeight/basketAmount/amount  returnLeg/rateOfReturn/initialPrice/netPrice/amount  returnLeg/rateOfReturn/valuationPriceFinal/netPrice/amount</p> <p>Если значение &lt; 0, то отказ.</p>	
23.	<b>Анкета кредитного дефолтного свопа (CM071 – creditDefaultSwap)</b>	
23.1	<p>Проверить значение суммы:  protectionTerms/calculationAmount</p> <p>Если значение &lt; 0, то отказ.</p>	<a href="#">NRD203</a>
24.	<b>Анкета кредитного дефолтного свопциона (CM072 – creditDefaultSwapOption)</b>	
24.1	<p>Проверить значения:  protectionTerms/calculationAmount/amount  premium/paymentAmount  notionalAmount/amount  strike/spread  strike/price</p> <p>Если значение &lt; 0, то отказ.</p>	<a href="#">NRD203</a>
25.	<b>Анкета иной сделки (CM081 – generalProduct)</b>	
25.1	<p>Проверить значения сумм:  party1Obligations/nominalAmount  party2Obligations/nominalAmount</p> <p>Если значение &lt; 0, то отказ.</p>	<a href="#">NRD203</a>

## 2.6. Проверка корректности заполнения типа продукта (productType) в зависимости от параметров сообщения.

№	Описание проверки	Номер ошибки
1	<b>Анкета валютного свопа (CM021 – fxSwap)</b>	
1.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>ForeignExchange:FXSwap  ForeignExchange:FXSwap:NonDerivative  ForeignExchange:FXSwap:Cash</p> <p>Иначе – отказ.</p>	<a href="#">NRD208</a>
1.2	<p>Проверить, что:</p> <p><b>для ForeignExchange:FXSwap</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Метод расчетов ≠ "С".</li> <li>• Код классификации ≠ "UKWN".</li> </ul>	<a href="#">NRD227</a>

	<p><b>для ForeignExchange:FXSwap:Cash</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Метод расчетов ≠ "P".</li> <li>• Код классификации ≠ "UKWN".</li> </ul> <p><b>для ForeignExchange:FXSwap:NonDerivative</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Метод расчетов ≠ "C".</li> <li>• Код классификации = "UKWN".</li> </ul> <p>Если условия не выполняются – отказ.</p>	
2	<b>Анкета конверсионной сделки (валютного форварда) (CM022 – fxSingleLeg)</b>	
2.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>ForeignExchange:Forward  ForeignExchange:NDF  ForeignExchange:Term  ForeignExchange:Spot</p> <p>Иначе – отказ.</p>	<a href="#">NRD208</a>
2.2	<p>Проверить, что:</p> <p><b>для ForeignExchange:Forward</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Метод расчетов ≠ "C".</li> <li>• Код классификации ≠ "UKWN".</li> </ul> <p><b>для ForeignExchange:NDF</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Метод расчетов ≠ "P".</li> <li>• Код классификации ≠ "UKWN".</li> </ul> <p><b>для ForeignExchange:Term</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Код классификации = "UKWN".</li> </ul> <p><b>для ForeignExchange:Spot</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Код классификации = "UKWN".</li> <li>• Разница между Датой валютирования и Датой сделки меньше 3-х рабочих дней.</li> </ul> <p>Если условия не выполняются – отказ.</p>	<a href="#">NRD227</a>
3.	<b>Анкета валютного опциона (CM023 – fxOption)</b>	
3.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>ForeignExchange:VanillaOption:American  ForeignExchange:VanillaOption:Bermuda  ForeignExchange:VanillaOption:European  ForeignExchange:CashOption:American  ForeignExchange:CashOption:Bermuda  ForeignExchange:NDO  ForeignExchange:SimpleExotic:Asian  ForeignExchange:SimpleExotic:Barrier  ForeignExchange:SimpleExotic:BarrierAsian</p> <p>Иначе – отказ.</p>	<a href="#">NRD208</a>
3.2	<p>Проверить, что:</p> <p><b>для ForeignExchange:VanillaOption:American</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Выбран «Американский стиль исполнения опциона».</li> </ul>	<a href="#">NRD227</a>

	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Метод расчетов ≠ "С".</li> </ul> <p><b>для ForeignExchange:VanillaOption:Bermuda</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Выбран «Бермудский стиль исполнения опциона».</li> <li>• Метод расчетов ≠ "С".</li> </ul> <p><b>для ForeignExchange:VanillaOption:European</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Выбран «Европейский стиль исполнения опциона».</li> <li>• Метод расчетов ≠ "С".</li> </ul> <p><b>для ForeignExchange:CashOption:American</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Выбран «Американский стиль исполнения опциона».</li> <li>• Метод расчетов ≠ "Р".</li> </ul> <p><b>для ForeignExchange:CashOption:Bermuda</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Выбран «Бермудский стиль исполнения опциона».</li> <li>• Метод расчетов ≠ "Р".</li> </ul> <p><b>для ForeignExchange:NDO</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Выбран «Европейский стиль исполнения опциона».</li> <li>• Метод расчетов ≠ "Р".</li> </ul> <p><b>для ForeignExchange:SimpleExotic:Asian</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Заполнено «Условия азиатского опциона».</li> <li>• Не заполнено «Условия барьерного опциона».</li> </ul> <p><b>для ForeignExchange:SimpleExotic:Barrier</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Не заполнено «Условия азиатского опциона».</li> <li>• Заполнено «Условия барьерного опциона».</li> </ul> <p><b>для ForeignExchange:SimpleExotic:BarrierAsian</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Заполнено «Условия азиатского опциона».</li> <li>• Заполнено «Условия барьерного опциона».</li> </ul> <p>Если условия не выполняются – отказ.</p>	
4.	<b>Анкета бинарного валютного опциона (CM024 – fxDigitalOption)</b>	
4.1	В качестве значения «Типа продукта» используется: ForeignExchange:SimpleExotic:Digital:American ForeignExchange:SimpleExotic:Digital:Bermuda ForeignExchange:SimpleExotic:Digital:European Иначе – отказ.	<a href="#">NRD208</a>
4.2	Проверить, что: <b>для ForeignExchange:SimpleExotic:Digital:American</b> выбран «Американский стиль и условия касания». <b>для ForeignExchange:SimpleExotic:Digital:European</b> выбран «Европейский стиль и условия касания». <b>для ForeignExchange:SimpleExotic:Digital:Bermuda</b> выбран «Бермудский стиль и условия касания». Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD227</a>
5.	<b>Анкета соглашения о будущей процентной ставке (CM031 – fra)</b>	
5.1	В качестве значения «Типа продукта» используется:	<a href="#">NRD208</a>

	InterestRate:FRA Иначе – отказ.	
6.	<b>Анкета процентного свопа (CM032 – swap)</b>	
6.1	В качестве значения «Типа продукта» используется: InterestRate:IRSwap:FixedFloat InterestRate:IRSwap:FixedFixed InterestRate:IRSwap:Basis InterestRate:IRSwap:OIS InterestRate:CrossCurrency:Basis InterestRate:CrossCurrency:FixedFloat InterestRate:CrossCurrency:FixedFixed Иначе – отказ.	<a href="#">NRD208</a>
6.2	Проверить, что: <b>Заполнены два блока «Платежи по свопу».</b> <b>для InterestRate:IRSwap:FixedFloat</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>Для одного платежа по свопу указан выбор «График фиксированной ставки», для другого – «Определение плавающей ставки».</li> <li>Валюта первого платежа = валюте второго платежа.</li> </ul> <b>для InterestRate:IRSwap:FixedFixed</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>Для двух платежей по свопу указан выбор «График фиксированной ставки».</li> <li>Валюта первого платежа = валюте второго платежа.</li> </ul> <b>для InterestRate:IRSwap:Basis</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>Для двух платежей по свопу указан выбор «Определение плавающей ставки».</li> <li>Валюта первого платежа = валюте второго платежа.</li> </ul> <b>для InterestRate:IRSwap:OIS</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>Для одного платежа по свопу указан выбор «График фиксированной ставки», для другого – «Определение плавающей ставки».</li> <li>Валюта первого платежа = валюте второго платежа.</li> </ul> <b>для InterestRate:CrossCurrency:Basis</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>Для двух платежей по свопу указан выбор «Определение плавающей ставки».</li> <li>Валюта первого платежа ≠ валюте второго платежа.</li> </ul> <b>для InterestRate:CrossCurrency:FixedFloat</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>Для одного платежа по свопу указан выбор «График фиксированной ставки», для другого – «Определение плавающей ставки».</li> <li>Валюта первого платежа ≠ валюте второго платежа.</li> </ul> <b>для InterestRate:CrossCurrency:FixedFixed</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>Для двух платежей по свопу указан выбор «График фиксированной ставки».</li> <li>Валюта первого платежа ≠ валюте второго платежа.</li> </ul> Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD227</a>
7.	<b>Анкета договора фиксации максимальной/ минимальной процентной ставки (CM033 – capFloor)</b>	

7.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>InterestRate:CapFloor:Cap  InterestRate:CapFloor:Floor  InterestRate:CapFloor:Collar  InterestRate:CapFloor:Straddle</p> <p>Иначе – отказ.</p>	<a href="#">NRD208</a>
7.2	<p>Проверить, что:</p> <p><b>Не заполнен выбор «График фиксированной ставки».</b></p> <p><b>для InterestRate:CapFloor:Cap</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Заполнено «График максимума ставки».</li> <li>• Не заполнено «График минимума ставки».</li> </ul> <p><b>для InterestRate:CapFloor:Floor</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Не заполнено «График максимума ставки».</li> <li>• Заполнено «График минимума ставки».</li> </ul> <p><b>для InterestRate:CapFloor:Collar</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Заполнено «График максимума ставки».</li> <li>• Заполнено «График минимума ставки».</li> </ul> <p><b>для InterestRate:CapFloor:Straddle</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Заполнено «График максимума ставки».</li> <li>• Заполнено «График минимума ставки».</li> </ul> <p>Если условия не выполняются – отказ.</p>	<a href="#">NRD227</a>
8	<b>Анкета свопциона (CM034 – swaption)</b>	
8.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» (productType и swap/productType – единый код) используется:</p> <p>InterestRate:Option:Swaption:American  InterestRate:Option:Swaption:European  InterestRate:Option:Swaption:Bermuda</p> <p>Иначе – отказ.</p>	<a href="#">NRD208</a>
8.2	<p>Проверить, что:</p> <p><b>для InterestRate:Option:Swaption:American</b> выбран «Американский стиль исполнения».</p> <p><b>для InterestRate:Option:Swaption:European</b> выбран «Европейский стиль исполнения».</p> <p><b>для InterestRate:Option:Swaption:Bermuda</b> выбран «Бермудский стиль исполнения».</p> <p>Если условия не выполняются – отказ.</p>	<a href="#">NRD227</a>
9.	<b>Анкета договора РЕПО (CM041 - repo)</b>	
9.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>CrossAsset:Repo:BasketRepo  InterestRate:Repo:BondRepo  Equity:Repo:EquityRepo</p> <p>Иначе – отказ.</p>	<a href="#">NRD208</a>



9.2	Проверить, заполнен ли тэг spotLeg/collateral (обеспечение по первой части РЕПО). Если не заполнен либо отсутствует – отказ.	<a href="#">NRD001</a>
9.3	Проверить, что для InterestRate:Repo:BondRepo указан идентификатор облигации bond/instrumentId (и только один); для Equity:Repo:EquityRepo указан идентификатор акции equity/instrumentId (и только один). Если условия не выполняются – отказ.	
10.	<b>Анкета договора купли-продажи облигации (CM042 – bondSimpleTransaction)</b>	
10.1	В качестве значения «Типа продукта» используется: InterestRate:Other:DebtSpot InterestRate:Other:DebtTerm Иначе – отказ.	<a href="#">NRD208</a>
10.2	Проверить, что <b>для InterestRate:Other:DebtSpot</b> разница между Датой расчетов и Датой сделки < 3-х рабочих дней; <b>для InterestRate:Other:DebtTerm</b> разница между Датой расчетов и Датой сделки >= 3 рабочих дней. Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD227</a>
11.	<b>Анкета форварда на облигацию или индекс (CM043 bondForward)</b>	
11.1	В качестве значения «Типа продукта» используется: InterestRate:Forward:DebtForward:SingleName InterestRate:Forward:DebtForward:SingleIndex InterestRate:Forward:DebtForward:Basket InterestRate:Forward:DebtForward:BasketIndex Иначе – отказ.	<a href="#">NRD208</a>
11.2	Проверить, что <b>для InterestRate:Forward:DebtForward:SingleName</b> в выборе «Единый базовый актив» указан базовый актив «Облигация»; <b>для InterestRate:Forward:DebtForward:SingleIndex</b> в выборе «Единый базовый актив» указан базовый актив «Индекс»; <b>для InterestRate:Forward:DebtForward:Basket</b> в выборе «Корзина базовый активов» указан базовый актив «Облигация», причем элемент «Идентификатор базового актива» имеет более одного значения; <b>для InterestRate:Forward:DebtForward:BasketIndex</b> в выборе «Корзина базовый активов» указан базовый актив «Индекс», причем элемент «Идентификатор базового актива» имеет более одного значения. Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD227</a>

12	<b>Анкета опциона на облигацию (CM044 – bondOption)</b>	
12.1	В качестве значения «Типа продукта» используется: InterestRate:Option:DebtOption:SingleName Иначе – отказ.	<a href="#">NRD208</a>
13	<b>Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (CM045 – bondBasketOption)</b>	
13.1	В качестве значения «Типа продукта» используется: InterestRate:Option:DebtOption:SingleIndex InterestRate:Option:DebtOption:Basket InterestRate:Option:DebtOption:BasketIndex Иначе – отказ.	<a href="#">NRD208</a>
13.2	Проверить, что: <b>для InterestRate:Option:DebtOption:SingleIndex</b> в выборе базового актива указан «Индекс»; <b>для InterestRate:Option:DebtOption:Basket</b> в выборе «Корзина» указан базовый актив «Облигация», причем элемент «Идентификатор базового актива» имеет более одного значения; <b>для InterestRate:Option:DebtOption:BasketIndex</b> в выборе «Корзина» указан базовый актив «Индекс», причем элемент «Идентификатор базового актива» имеет более одного значения. Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD227</a>
14.	<b>Анкета договора купли-продажи акции (CM046 – equitySimpleTransaction)</b>	
14.1	В качестве значения «Типа продукта» используется: Equity:Other:EquitySpot Equity:Other:EquityTerm Иначе – отказ.	<a href="#">NRD208</a>
14.2	Проверить, что <b>для Equity:Other:EquitySpot</b> разница между Датой расчетов и Датой сделки < 3-х рабочих дней; <b>для Equity:Other:EquityTerm</b> разница между Датой расчетов и Датой сделки >= 3 рабочих дней. Если условия не выполняются – отказ.	<a href="#">NRD227</a>
15.	<b>Анкета форварда на акцию (CM047 – equityForward)</b>	
15.1	В качестве значения «Типа продукта» используется: Equity:Forward:PriceReturnBasicPerformance:SingleName Equity:Forward:PriceReturnBasicPerformance:Basket Иначе – отказ.	<a href="#">NRD208</a>
15.2	Проверить, что:	<a href="#">NRD227</a>

	<p><b>для Equity:Forward:PriceReturnBasicPerformance:SingleName</b> в выборе «Единый базовый актив» указан базовый актив «Акция»;</p> <p><b>для Equity:Forward:PriceReturnBasicPerformance:Basket</b> в выборе «Корзина базовый активов» указан базовый актив «Акция», причем элемент «Идентификатор базового актива» имеет более одного значения. Если условия не выполняются – отказ.</p>	
16.	<b>Анкета опциона на акцию (CM048 equityOption)</b>	
16.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется: Equity:Option:PriceReturnBasicPerformance:SingleName Equity:Option:PriceReturnBasicPerformance:Basket Иначе – отказ.</p>	<a href="#">NRD208</a>
16.2	<p>Проверить, что:</p> <p><b>для Equity:Option:PriceReturnBasicPerformance:SingleName</b> в выборе «Единый базовый актив» указан базовый актив «Акция»;</p> <p><b>для Equity:Option:PriceReturnBasicPerformance:Basket</b> в выборе «Корзина базовый активов» указан базовый актив «Акция», причем элемент «Идентификатор базового актива» имеет более одного значения. Если условия не выполняются – отказ.</p>	<a href="#">NRD227</a>
17.	<b>Анкета товарного форварда (CM051 – commodityForward)</b>	
17.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется: Commodity:Forward:Physical Commodity:Forward:Cash Иначе – отказ.</p>	<a href="#">NRD208</a>
17.2	<p>Проверить, что:</p> <p><b>для Commodity:Forward:Physical</b> заполнено «Поставочная часть товарной сделки»;</p> <p><b>для Commodity:Forward:Cash</b> заполнено «Товарная часть расчетного форварда». Если условия не выполняются – отказ.</p>	<a href="#">NRD227</a>
18.	<b>Анкета товарного опциона (CM052 – commodityOption)</b>	
18.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется: Commodity:Option:American Commodity:Option:European Commodity:Option:Asian Commodity:Option:Weather:American Commodity:Option:Weather:European Иначе – отказ.</p>	<a href="#">NRD208</a>
18.2	Проверить, что:	<a href="#">NRD227</a>

	<p><b>для Commodity:Option:American</b> выбран тип «Товарный опцион» и «Американский стиль исполнения»;</p> <p><b>для Commodity:Option:European</b> выбран тип «Товарный опцион» и «Европейский стиль исполнения»;</p> <p><b>для Commodity:Option:Asian</b> в выборе способа определения расчетных периодов используется вариант выбора «Расчетные периоды»;</p> <p><b>для Commodity:Option:Weather:American</b> выбран тип «Погодный опцион» и «Американский стиль исполнения»;</p> <p><b>для Commodity:Option:Weather:European</b> выбран тип «Погодный опцион» и «Европейский стиль исполнения».</p> <p>Если условия не выполняются – отказ.</p>	
19.	<b>Анкета товарного свопа (CM053 – commoditySwap)</b>	
19.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>Commodity:Swap:Cash Commodity:Swap:Physical Commodity:Swap:Cash:Weather</p> <p>Иначе – отказ.</p>	<a href="#">NRD208</a>
19.2	<p>Проверить, что:</p> <p><b>для Commodity:Swap:Cash</b></p> <p>в выборе «Товарная часть контракта свопа» указаны две части свопа, одна из которых – «Часть сделки с фиксированной ценой», другая – «Часть сделки с плавающей ценой»;</p> <p><b>для Commodity:Swap:Physical</b></p> <p>в выборе «Товарная часть контракта свопа» указаны две части свопа, одна из которых – «Часть сделки с фиксированной ценой» или «Часть сделки с плавающей ценой», другая – «Поставочная часть товарной сделки»;</p> <p><b>для Commodity:Swap:Cash:Weather</b></p> <p>заполнен «Поток по сделке погодного свопа».</p> <p>Если условия не выполняются – отказ.</p>	<a href="#">NRD227</a>
20.	<b>Анкета товарного свопциона (CM054 – commoditySwaption)</b>	
20.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>Commodity:Swaption:American Commodity:Swaption:European</p> <p>Иначе – отказ.</p>	<a href="#">NRD208</a>
20.2	<p>Проверить, что</p> <p><b>для Commodity:Swaption:American</b> выбран «Американский стиль исполнения»;</p> <p><b>для Commodity:Swaption:European</b> выбран «Европейский стиль исполнения».</p> <p>Если условия не выполняются – отказ.</p>	<a href="#">NRD227</a>
21.	<b>Анкета свопа дохода на облигацию (CM061 – bondSwap)</b>	

21.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>InterestRate:Swap:BondSwap:SingleName InterestRate:Swap:BondSwap:SingleIndex InterestRate:Swap:BondSwap:Basket</p> <p>Иначе – отказ.</p>	<a href="#">NRD208</a>
21.2	<p>Проверить, что:</p> <p><b>Указаны два потока по свопу активов</b>, один из которых – «Суммы фиксированного дохода», другой – «Суммы дохода от облигации»;</p> <p><b>для InterestRate:Swap:BondSwap:SingleName</b></p> <p>В потоке «Суммы дохода от облигации» в выборе «Единичный базовый актив» указан базовый актив «Облигация»;</p> <p><b>для InterestRate:Swap:BondSwap:SingleIndex</b></p> <p>В потоке «Суммы дохода от облигации» в выборе «Единичный базовый актив» указан базовый актив «Индекс»;</p> <p><b>для InterestRate:Swap:BondSwap:Basket</b></p> <p>В потоке «Суммы дохода от облигации» в выборе «Корзина базовых активов» указан базовый актив «Облигация», причем элемент «Идентификатор базового актива» имеет более одного значения.</p> <p>Если условия не выполняются – отказ.</p>	<a href="#">NRD227</a>
22.	<b>Анкета свопа дохода на акцию (CM062 – equitySwapTransactionSupplement)</b>	
22.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>Equity:Swap:PriceReturnBasicPerformance:SingleName Equity:Swap:PriceReturnBasicPerformance:SingleIndex Equity:Swap:PriceReturnBasicPerformance:Basket</p> <p>Иначе – отказ.</p>	<a href="#">NRD208</a>
22.2	<p>Проверить, что:</p> <p><b>Указаны два потока по свопу активов</b>, один из которых – «Суммы фиксированного дохода», другой – «Суммы дохода от актива»;</p> <p><b>для Equity:Swap:PriceReturnBasicPerformance:SingleName</b></p> <p>В потоке «Суммы дохода от актива» в выборе «Единичный базовый актив» указан базовый актив «Акция»;</p> <p><b>для Equity:Swap:PriceReturnBasicPerformance:SingleIndex</b></p> <p>В потоке «Суммы дохода от актива» в выборе «Единичный базовый актив» указан базовый актив «Индекс»;</p> <p><b>для Equity:Swap:PriceReturnBasicPerformance:Basket</b></p> <p>в потоке «Суммы дохода от актива» в выборе «Корзина базовых активов» указан базовый актив «Акция», причем элемент «Идентификатор базового актива» имеет более одного значения.</p> <p>Если условия не выполняются – отказ.</p>	<a href="#">NRD227</a>
23.	<b>Анкета кредитного дефолтного свопа (CM071 – creditDefaultSwap)</b>	

23.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» используется:</p> <p>Credit:Swap:Index:Cash  Credit:Swap:SingleName:Cash  Credit:Swap:SingleName:Physical  Credit:Swap:MultipleName:Cash  Credit:Swap:MultipleName:Physical</p> <p>Иначе – отказ.</p>	<a href="#">NRD208</a>
23.2	<p>Проверить, что</p> <p><b>для Credit:Swap:Index:Cash</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>В выборе типа референсного обязательства указана «Референсная информация об индексе».</li> </ul> <p><b>для Credit:Swap:SingleName:Cash</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>В выборе типа референсного обязательства указана «Информация о референсном лице» и «Референсное обязательство».</li> <li>Метод расчетов ≠ "P".</li> </ul> <p><b>для Credit:Swap:SingleName:Physical</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>В выборе типа референсного обязательства указана «Информация о референсном лице» и «Референсное обязательство».</li> <li>Метод расчетов ≠ "C".</li> </ul> <p><b>для Credit:Swap:MultipleName:Cash</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>В выборе типа референсного обязательства указана «Референсная информация о корзине».</li> <li>Метод расчетов ≠ "P".</li> </ul> <p><b>для Credit:Swap:MultipleName:Physical</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>В выборе типа референсного обязательства указана «Референсная информация о корзине».</li> <li>Метод расчетов ≠ "C".</li> </ul> <p>Если условия не выполняются – отказ.</p>	<a href="#">NRD227</a>
24.	<b>Анкета кредитного дефолтного свопциона (CM072 – creditDefaultSwapOption)</b>	
24.1	<p>В качестве значения «Типа продукта» (productType и creditDefaultSwap/productType – единый код) используется:</p> <p>Credit:SwapOption:American  Credit:SwapOption:European  Credit:SwapOption:Bermuda</p> <p>Иначе – отказ.</p>	<a href="#">NRD208</a>
24.2	<p>Проверить, что</p> <p><b>для Credit:SwapOption:American</b> выбран «Американский стиль исполнения»;</p> <p><b>для Credit:SwapOption:European</b> выбран «Европейский стиль исполнения»;</p> <p><b>для Credit:SwapOption:Bermuda</b> выбран «Бермудский стиль исполнения».</p> <p>Если условия не выполняются – отказ.</p>	<a href="#">NRD227</a>
	<p><b>Отчет по сделкам репо (CM083)</b>  <b>Отчет по сделкам валютный своп (CM084)</b></p>	

	<b>Отчет по конверсионным сделкам (CM085)</b>	
25	В качестве значения «Типа продукта» используется: Other Иначе – отказ.	<a href="#">NRD208</a>

## 2.7. Проверка корректности указания покупателя/продавца и плательщика/покупателя по первой и второй частям договора РЕПО и валютного свопа.

№	Описание проверки	Номер ошибки
<b>1</b>	<b>Анкета договора РЕПО (CM041 - repo)</b>	
1.1	Проверить, что: <ul style="list-style-type: none"> <li>spotLeg/buyerPartyReference = forwardLeg/sellerPartyReference</li> <li>spotLeg/sellerPartyReference = forwardLeg/buyerPartyReference</li> </ul> Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD209</a>
<b>2</b>	<b>Анкета валютного свопа (CM021 – fxSwap)</b>	
2.1	Проверить, что: <ul style="list-style-type: none"> <li>nearLeg/exchangedCurrency1/payerPartyReference = nearLeg/exchangedCurrency2/receiverPartyReference = farLeg/exchangedCurrency1/receiverPartyReference = farLeg/exchangedCurrency2/payerPartyReference</li> <li>nearLeg/exchangedCurrency1/receiverPartyReference = nearLeg/exchangedCurrency2/payerPartyReference = farLeg/exchangedCurrency1/payerPartyReference = farLeg/exchangedCurrency2/receiverPartyReference</li> </ul> Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD209</a>

## 2.8. Контроль отсутствия неиспользуемых элементов.

№	Описание проверки	Номер ошибки
<b>1</b>	<b>Анкета договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки (CM033 – capFloor)</b>	
1.1	Проверить отсутствие элементов: calculation/fixRateSchedule knownAmountSchedule principalExchanges Если элемент присутствует – отказ.	<a href="#">NRD210</a>
<b>2</b>	<b>Анкета форварда на облигацию или индекс (CM043 bondForward)</b>	
2.1	Проверить отсутствие элементов: singleUnderlyer/basket singleUnderlyer/commodity singleUnderlyer/equity basket/basketConstituent/basket basket/basketConstituent/commodity	<a href="#">NRD210</a>

	<p>basket/basketConstituent/equity</p> <p>Если элемент присутствует – отказ.</p>	
<b>3</b>	<b>Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (CM045 – bondBasketOption)</b>	
3.1	<p>Проверить отсутствие элементов:</p> <p>basket/basketConstituent/basket</p> <p>basket/basketConstituent/commodity</p> <p>basket/basketConstituent/equity</p> <p>Если элемент присутствует – отказ.</p>	<a href="#">NRD210</a>
<b>4</b>	<b>Анкета форварда на акцию (CM047 – equityForward)</b>	
4.1	<p>Проверить отсутствие элементов:</p> <p>singleUnderlyer/basket</p> <p>singleUnderlyer/bond</p> <p>singleUnderlyer/commodity</p> <p>singleUnderlyer/index</p> <p>basket/basketConstituent/basket</p> <p>basket/basketConstituent/bond</p> <p>basket/basketConstituent/commodity</p> <p>basket/basketConstituent/index</p> <p>equityExercise/equityAmericanExercise</p> <p>equityExercise/equityBermudaExercise</p> <p>feature</p> <p>Если элемент присутствует – отказ.</p>	<a href="#">NRD210</a>
<b>5</b>	<b>Анкета опциона на акцию (CM048 equityOption)</b>	
5.1	<p>Проверить отсутствие элементов:</p> <p>singleUnderlyer/basket</p> <p>singleUnderlyer/bond</p> <p>singleUnderlyer/commodity</p> <p>singleUnderlyer/index</p> <p>basket/basketConstituent/basket</p> <p>basket/basketConstituent/bond</p> <p>basket/basketConstituent/commodity</p> <p>basket/basketConstituent/index</p> <p>Если элемент присутствует – отказ.</p>	<a href="#">NRD210</a>
<b>6</b>	<b>Анкета свопа дохода на облигацию (CM061 – bondSwap)</b>	
6.1	<p>Проверить отсутствие элементов:</p> <p>returnLeg</p> <p>bondReturnLeg/underlyer/singleUnderlyer/basket</p> <p>bondReturnLeg/underlyer/singleUnderlyer/commodity</p> <p>bondReturnLeg/underlyer/singleUnderlyer/equity</p> <p>bondReturnLeg/underlyer/basket/basketConstituent/basket</p> <p>bondReturnLeg/underlyer/basket/basketConstituent/commodity</p> <p>bondReturnLeg/underlyer/basket/basketConstituent/equity</p> <p>Если элемент присутствует – отказ.</p>	<a href="#">NRD210</a>



7	<b>Анкета свопа дохода на акцию (CM062 – equitySwapTransactionSupplement)</b>	
7.1	<p>Проверить отсутствие элементов:</p> <p>bondReturnLeg  returnLeg/underlyer/singleUnderlyer/basket  returnLeg/underlyer/singleUnderlyer/bond  returnLeg/underlyer/singleUnderlyer/commodity  returnLeg/underlyer/basket/basketConstituent/basket  returnLeg/underlyer/basket/basketConstituent/bond  returnLeg/underlyer/basket/basketConstituent/commodity</p> <p>Если элемент присутствует – отказ.</p>	<a href="#">NRD210</a>

## 2.9. Проверка кода классификации ПФИ и РЕПО.

№	Описание проверки	Номер ошибки
1.	<b>Для сообщений CM021, CM032, CM053, CM061, CM062, CM071, CM084</b>	
1.1	<p>Проверить заполнение Кода классификации ПФИ</p> <p>1) Если productId = 7 символов и</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 1-ый символ = 'S' и</li> <li>• 2-ой символ является одним из группы {'V','P','G','C','A','M'} и</li> <li>• 3-ий символ является одним из группы {'F','V','D','X'} и</li> <li>• 4-ый символ является одним из группы {'A','H','W','N','X'} и</li> <li>• 5-ый символ является одним из группы {'F','N'} и</li> <li>• 6-ой символ является одним из группы {'E','T','W','N'} и</li> <li>• 7-ой символ является одним из группы {'U','D','W','N'}</li> </ul> <p>2) Или (Метод расчетов = 'P' или 'E') и productId = 'UKWN'</p> <p>3) Или тип сообщения CM084 и productId = 'UKWN'</p> <p>– проверка пройдена, иначе отказ.</p>	<a href="#">NRD228</a>
2.	<b>Для сообщений CM023, CM024, CM034, CM044, CM045, CM048, CM052, CM054, CM072</b>	
2.1	<p>Проверить заполнение Кода классификации ПФИ:</p> <p>Если productId = 6 символов и</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 1-ый символ = 'O' и</li> <li>• 2-ой символ является одним из группы {'P','C','Z'} и</li> <li>• 3-ий символ является одним из группы {'A','E','B'} и</li> <li>• 4-ый символ является одним из группы {'F','L','X'} и</li> <li>• 5-ый символ является одним из группы {'N','B','D','M','X'} и</li> <li>• 6-ой символ является одним из группы {'E','D','C','V','A','X','M'}</li> </ul> <p>– проверка пройдена, иначе отказ.</p>	<a href="#">NRD228</a>
3.	<b>Для сообщений CM022, CM031, CM043, CM047, CM051, CM085</b>	
3.1	<p>Проверить заполнение Кода классификации ПФИ:</p> <p>1) Если productId = 5 символов и</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 1-ый символ = 'F' и</li> <li>• 2-ой символ является одним из группы {'E','D','C','V','A','X','M'} и</li> <li>• 3-ий символ является одним из группы {'O','W','S'} и</li> </ul>	<a href="#">NRD228</a>

	<ul style="list-style-type: none"> <li>4-ый символ является одним из группы {'F','L','R'} и</li> <li>5-ый символ является одним из группы {'E','N'}</li> </ul> <p>2) Или (Метод расчетов = 'P' или 'E') и productId = 'UKWN'</p> <p>3) Или тип сообщения CM022 или CM085 и productId = 'UKWN'</p> <p>– проверка пройдена, иначе отказ.</p>	
4.	<b>Для сообщений CM041, CM083</b>	
4.1	<p>Проверить заполнение Кода классификации договоров РЕПО:</p> <p>1) Если productId = 5 символов и</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>1-ый символ = 'R' и</li> <li>2-ой символ является одним из группы {'E','D','X'} и</li> <li>3-ий символ является одним из группы {'O','W','S'} и</li> <li>4-ый символ является одним из группы {'F','Z','L','R'} и</li> <li>5-ый символ является одним из группы {'F','E','O'}</li> </ul> <p>2) Или тип сообщения CM083 и productId = 'UKWN'</p> <p>– проверка пройдена, иначе отказ.</p>	<a href="#">NRD228</a>
5.	<b>Для сообщений CM042, CM046</b>	
5.1	<p>Проверить заполнение Кода классификации ПФИ:</p> <p>Если productId = 'UKWN' – проверка пройдена, иначе отказ.</p>	<a href="#">NRD228</a>
6.	<b>Для сообщений CM081</b>	
6.1	<p>Проверить заполнение Кода классификации ПФИ:</p> <p>Если productId содержит от 4 до 7 символов, либо 'UKWN', либо соответствует условиям, описанным в данной таблице в п. 1.1 либо 2.1 либо 3.1 либо 4.1 (в зависимости от 1-го символа кода 'S','O','F' или 'R') – проверка пройдена, иначе отказ.</p>	<a href="#">NRD228</a>
7.	<b>Для сообщений CM033</b>	
7.1	<p>Проверить заполнение Кода классификации ПФИ:</p> <p>Если productId соответствует условиям, описанным в данной таблице в п. 1.1 либо 2.1 либо 3.1 – проверка пройдена, иначе отказ.</p>	<a href="#">NRD228</a>

## 2.10. Проверка параметров, влияющих на расчет объема по сделке.

Проверки предназначены для выявления случаев, когда указанные в анкете параметры могут противоречить экономическому смыслу инструмента, что может повлиять на корректность расчета объема договора как на стороне Репозитария, так и на стороне Банка России.

Если сравниваемые суммы выражены в различных валютах, в процессе выполнения проверки они конвертируются в рубли по официальному курсу Банка России на дату сделки.

№	Описание проверки	Номер ошибки
1.	<b>Анкета валютного опциона (CM023 – fxOption)</b>	
1.1	<p>Проверить, что отношение номинальной суммы <i>putCurrencyAmount</i> к премии <i>premium/paymentAmount</i> =&gt; 1.</p> <p>Если значение &lt; 1, то отказ.</p>	<a href="#">NRD229</a>

	Если премия = 0, проверка не выполняется.	
2.	<b>Анкета бинарного валютного опциона (CM024 – fxDigitalOption)</b>	
2.1	Проверить, что отношение суммы выплаты <i>payout</i> к премии $premium/paymentAmount \Rightarrow 1$ . Если значение < 1, то отказ. Если премия = 0, проверка не выполняется.	<a href="#">NRD229</a>
3.	<b>Анкета договора фиксации максимальной/ минимальной процентной ставки (CM033 – capFloor)</b>	
3.1	Проверить, что отношение номинальной суммы $notionalStepSchedule/initialValue$ к премии $premium/paymentAmount \Rightarrow 1$ . Если значение < 1, то отказ. Если премия = 0, проверка не выполняется.	<a href="#">NRD229</a>
4	<b>Анкета свопциона (CM034 – swaption)</b>	
4.1	Проверить, что отношение номинальной суммы $notionalStepSchedule/initialValue$ или $knownAmountSchedule/initialValue$ к премии $premium/paymentAmount \Rightarrow 1$ . Если значение < 1, то отказ. Если премия = 0, проверка не выполняется.	<a href="#">NRD229</a>
5.	<b>Анкета опциона на облигацию (CM044 – bondOption)</b>	
5.1	Проверить, что отношение номинальной суммы <i>notionalAmount</i> к премии $premium/paymentAmount \Rightarrow 1$ . Если значение < 1, то отказ. Если премия = 0, проверка не выполняется.	<a href="#">NRD229</a>
6.	<b>Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (CM045 – bondBasketOption)</b>	
6.1	Проверить, что отношение номинальной суммы <i>notionalAmount</i> к премии $premium/paymentAmount \Rightarrow 1$ . Если значение < 1, то отказ. Если премия = 0, проверка не выполняется.	<a href="#">NRD229</a>
7.	<b>Анкета опциона на акцию (CM048 equityOption)</b>	
7.1	Проверить, что отношение совокупного количества базового актива по договору (определяется как произведение количества опционов <i>numberOfOptions</i> и объема опциона <i>optionEntitlement</i> ) к лоту актива <i>openUnits</i> = 1 (если частое от деления – дробное число, например, 0,99 или 1,01, то оно округляется до целого) Если условие не выполняется, то отказ.	<a href="#">NRD230</a>
7.2	Проверить, что отношение расчетной номинальной суммы (определяется как произведение количества опционов <i>numberOfOptions</i> , объема опциона <i>optionEntitlement</i> и цены исполнения <i>strikePrice</i> ) к премии $premium/paymentAmount \Rightarrow 1$ . Если значение < 1, то отказ. Если премия = 0, проверка не выполняется.	<a href="#">NRD229</a>
8.	<b>Анкета товарного опциона (CM052 – commodityOption)</b>	
8.1	Проверить, что отношение расчетной номинальной суммы (определяется как произведение общего номинального количества базового актива	<a href="#">NRD229</a>

	<i>totalNotionalQuantity</i> и цены исполнения <i>strikePricePerUnit</i> ) к премии <i>premium/paymentAmount</i> => 1. Если значение < 1, то отказ. Если премия = 0, проверка не выполняется.	
9.	<b>Анкета товарного свопциона (CM054 – commoditySwaption)</b>	
9.1	Проверить, что отношение расчетной номинальной суммы (определяется как произведение общего номинального количества базового актива <i>totalNotionalQuantity</i> либо <i>weatherNotionalAmount</i> и цены базового актива <i>initialPrice</i> либо <i>weatherIndexLevel</i> ) к премии <i>premium/paymentAmount</i> => 1. Если значение < 1, то отказ. Если премия = 0, проверка не выполняется.	<a href="#">NRD229</a>
10.	<b>Анкета кредитного дефолтного свопциона (CM072 – creditDefaultSwapOption)</b>	
10.1	Проверить, что отношение номинальной суммы <i>calculationAmount</i> к премии <i>premium/paymentAmount</i> => 1. Если значение < 1, то отказ. Если премия = 0, проверка не выполняется.	<a href="#">NRD229</a>

### 2.11. Логические проверки внутри сообщений.

№	Описание проверки	Номер ошибки
1.	<b>Анкета валютного свопа (CM021 – fxSwap)</b>	
1.1	Проверить, что Валюта 1 и Валюта 2 не совпадают: <ul style="list-style-type: none"> <li>• <math>\text{nearLeg/exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency1} \neq \text{nearLeg/exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency2}</math></li> <li>• <math>\text{farLeg/exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency1} \neq \text{farLeg/exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency2}</math></li> </ul> Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD232</a>
2.	<b>Анкета конверсионной сделки (валютного форварда) (CM022 – fxSingleLeg)</b>	
2.1	Проверить, что Валюта 1 и Валюта 2 не совпадают: <ul style="list-style-type: none"> <li>• <math>\text{exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency1} \neq \text{exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency2}</math></li> <li>• <math>\text{exchangedCurrency1/paymentAmount/currency} \neq \text{exchangedCurrency2/paymentAmount/currency}</math></li> </ul> Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD232</a>
3.	<b>Анкета валютного опциона (CM023 – fxOption)</b>	
3.1	Проверить, что Валюта на продажу и Валюта на покупку не совпадают: $\text{putCurrencyAmount/currency} \neq \text{callCurrencyAmount/currency}$ Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD232</a>
3.2	Проверить, что Валюта 1 и Валюта 2 не совпадают: $\text{features/barrier/quotedCurrencyPair/currency1} \neq \text{features/barrier/quotedCurrencyPair/currency2}$ Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD232</a>

3.3	<p>Проверить, что покупатель опциона является плательщиком премии, а продавец – получателем премии:</p> <p>buyerPartyReference = premium/payerPartyReference sellerPartyReference = premium/receiverPartyReference</p> <p>Если условие не выполняется – отказ.</p>	<a href="#">NRD232</a>
4.	<b>Анкета бинарного валютного опциона (CM024 – fxDigitalOption)</b>	
4.1	<p>Проверить, что Дата начала периода наблюдения меньше или равна Дате окончания периода наблюдения:</p> <p>touch/observationStartDate &lt; = touch/observationEndDate</p> <p>Если условие не выполняется – отказ.</p>	<a href="#">NRD232</a>
4.2	<p>Проверить, что покупатель опциона является плательщиком премии, а продавец – получателем премии:</p> <p>buyerPartyReference = premium/payerPartyReference sellerPartyReference = premium/receiverPartyReference</p> <p>Если условие не выполняется – отказ.</p>	<a href="#">NRD232</a>
5.	<b>Анкета договора фиксации максимальной/ минимальной процентной ставки (CM033 – capFloor)</b>	
5.1	<p>Проверить, что покупатель опциона является плательщиком премии, а продавец – получателем премии:</p> <p>capFloorStream/receiverPartyReference = premium/payerPartyReference capFloorStream/payerPartyReference = premium/receiverPartyReference</p> <p>Если условие не выполняется – отказ.</p>	<a href="#">NRD232</a>
6.	<b>Анкета свопциона (CM034 – swaption)</b>	
6.1	<p>Проверить, что покупатель опциона является плательщиком премии, а продавец – получателем премии:</p> <p>buyerPartyReference = premium/payerPartyReference sellerPartyReference = premium/receiverPartyReference</p> <p>Если условие не выполняется – отказ.</p>	<a href="#">NRD232</a>
7.	<b>Анкета договора РЕПО (CM041 - repo)</b>	
7.1	<p>Проверить, что валюты суммы расчетов по первой и второй частям РЕПО совпадают:</p> <p>spotLeg/settlementAmount/currency = forwardLeg/settlementAmount/currency</p> <p>Если условие не выполняется – отказ.</p>	<a href="#">NRD232</a>
8.	<b>Анкета опциона на облигацию (CM044 – bondOption)</b>	
8.1	<p>Проверить, что покупатель опциона является плательщиком премии, а продавец – получателем премии:</p> <p>buyerPartyReference = premium/payerPartyReference sellerPartyReference = premium/receiverPartyReference</p> <p>Если условие не выполняется – отказ.</p>	<a href="#">NRD232</a>

9.	<b>Анкета опциона на индекс или корзину облигаций (индексов) (CM045 – bondBasketOption)</b>	
9.1	<p>Проверить, что покупатель опциона является плательщиком премии, а продавец – получателем премии:</p> <p>buyerPartyReference = premium/payerPartyReference sellerPartyReference = premium/receiverPartyReference</p> <p>Если условие не выполняется – отказ.</p>	<a href="#">NRD232</a>
10.	<b>Анкета опциона на акцию (CM048 equityOption)</b>	
10.1	<p>Проверить, что покупатель опциона является плательщиком премии, а продавец – получателем премии:</p> <p>buyerPartyReference = equityPremium/payerPartyReference sellerPartyReference = equityPremium/receiverPartyReference</p> <p>Если условие не выполняется – отказ.</p>	<a href="#">NRD232</a>
11.	<b>Анкета товарного опциона (CM052 – commodityOption)</b>	
11.1	<p>Проверить, что покупатель опциона является плательщиком премии, а продавец – получателем премии:</p> <p>buyerPartyReference = premium/payerPartyReference sellerPartyReference = premium/receiverPartyReference</p> <p>Если условие не выполняется – отказ.</p>	<a href="#">NRD232</a>
12.	<b>Анкета товарного свопциона (CM054 – commoditySwaption)</b>	
12.1	<p>Проверить, что покупатель опциона является плательщиком премии, а продавец – получателем премии:</p> <p>buyerPartyReference = premium/payerPartyReference sellerPartyReference = premium/receiverPartyReference</p> <p>Если условие не выполняется – отказ.</p>	<a href="#">NRD232</a>
13	<b>Анкета кредитного дефолтного свопциона (CM072 – creditDefaultSwapOption)</b>	
13.1	<p>Проверить, что покупатель опциона является плательщиком премии, а продавец – получателем премии:</p> <p>buyerPartyReference = premium/payerPartyReference sellerPartyReference = premium/receiverPartyReference</p> <p>Если условие не выполняется – отказ.</p>	<a href="#">NRD232</a>

## 2.12. Общие проверки Репозитория

№	Описание проверки	Номер ошибки
1.	<b>Проверки заполнения документа перед регистрацией в журнале входящих сообщений</b>	
1.1	<p>Проверить сообщение на используемые namespace. Допустимы только nsdext:, fpmlext:. В случае использования иных namespace – отказ.</p>	<a href="#">NRD061</a>
1.2	<p>Если входящее сообщение начинается с nonpublicExecutionReport то: В нём обязательно должен быть блок header.</p>	<a href="#">NRD059</a>

	<p>В блоке header обязательно должен присутствовать тэг messageID</p> <p>В блоке header обязательно должен присутствовать тэг sentBy</p> <p>В блоке header обязательно должен присутствовать и только один тэг sendTo</p> <p>В блоке header обязательно должен присутствовать тэг creationTimestamp</p> <p>Если условие не выполняется – отказ.</p>	
1.3	<p>Если входящее сообщение начинается с nonpublicExecutionReport то:</p> <p>В нём обязательно должен быть и только один тэг CorrelationID</p> <p>Если условие не выполняется – отказ</p>	<a href="#">NRD001</a>
1.4	<p>Если входящее сообщение начинается с nonpublicExecutionReport то:</p> <p>Должен быть блок &lt;party id="TradeRepository"&gt;</p> <p>Должен быть блок &lt;party id="Party1"&gt;</p> <p>Должен быть блок &lt;party id="Party2"&gt;</p> <p>Должен быть блок &lt;party id="Sender"&gt;</p> <p>В каждом из блоков Party должно быть три обязательных тэга:</p> <p>один обязательный тэг partyID (Репозитарный код)</p> <p>один обязательный тэг partyID (Доп. код)</p> <p>один обязательный тэг partyName</p> <p>Так же в сообщении может быть блок &lt;party id="UTIGeneratingParty"&gt; (опционально).</p> <p>В случае его наличия, в этом блоке должно быть три обязательных тэга:</p> <p>один обязательный тэг partyID (Репозитарный код) – Может иметь значение NONREF</p> <p>один обязательный тэг partyID (Обязательно LEI код)</p> <p>один обязательный тэг partyName</p> <p>При этом блок &lt;party id="Sender"&gt;, в качестве дополнительного кода, должен иметь код LEI.</p> <p>В случае получения сообщения, CM002, сервер репозитария должен проверять только наличие реп. кода и LEI кода отправителя сообщения, и не проверять прочие поля в других блоках.</p>	<a href="#">NRD026</a>
1.5	<p>Если входящее сообщение начинается с nonpublicExecutionReport и в нём есть тэг trade, то</p> <p>В нём обязательно должен быть блок tradeHeader</p> <p>В блоке tradeHeader должны быть 3 обязательных блока partyTradeIdentifier</p> <p>В каждом из блоков должны быть</p> <p>один тэг partyReference</p> <p>один и только один тэг tradeID</p> <p>Должен быть блок, где для partyReference href=TradeRepository</p> <p>Должен быть блок, где для partyReference href=Party1</p> <p>Должен быть блок, где для partyReference href=Party2</p> <p>Может быть блок, где для partyReference href=UTIGeneratingParty</p> <p>Если условие не выполняется – отказ</p>	<a href="#">NRD061</a>
1.6	<p>Отправитель, определённый транспортной системой входит в картотеку участников репозитарной деятельности (проверяется наличие кода). А также, не является ли Отправитель Клиентом/Стороной, с которой расторгнуто репозитарное соглашение. Для выполнения проверки производится поиск кода клиента, указанный в транспортной подсистеме среди кодов соответствующего типа в Справочнике участников репозитарной деятельности.</p> <p>В случае отсутствия кода в «Справочнике участников репозитарной деятельности», либо определения Отправителя как Клиента/Сторону, с которой расторгнуто репозитарное соглашение – выдается отказ.</p>	<a href="#">NRD002</a>
1.7	<p>Проверить, что код, указанный header\sendBy соответствует коду, указанному в party[id="Sender"]/partyId</p> <p>В случае расхождения – ошибка.</p>	<a href="#">NRD027</a>
1.8	<p>Проверить, что для каждого блока party, код partyName соответствует в справочнике участников репозитарной деятельности краткому наименованию клиента, репозитарный код которого совпадает с partyID или с NOT_REPORTING_CLIENT_NAME (для дополнительного кода).</p> <p>В случае расхождения – отказ.</p>	<a href="#">NRD055</a>



	В случае, одностороннего репортинга, при указании тэгов <partyId> для информирующего лица со значением NONREF, допускается указание <partyName> со значением NONREF.	
1.9	Проверить, что в базе репозитория не существует не забракованного сообщения такого же типа с тем же значением в поле Код_взаимосвязи (CorrelaltionID) Параметры: 1. Краткое наименование отправителя найденного дубликата 2. Дата регистрации сообщения найденного дубликата	<a href="#">NRD034</a>
1.10	Проверить, что поле Код взаимосвязи (CorrelaltionID) заполнен в соответствии с правилами заполнения сообщений репозитория – соответствует маске '[%s]-[%s]-[%s]', где %s – произвольная строка, центральный элемент содержит 4 цифровых символа.	<a href="#">NRD063</a>
1.11	В случае, если головной тэг сообщения является тэгом 'nonpublicExecutionReport' проверить, что в поле Код взаимосвязи (CorrelaltionID) первый блок содержит значение, соответствующее полю 'header/sentBy' сообщения.	<a href="#">NRD063</a>
1.12	Проверяем соответствие Краткого наименования стороны, отправителя (для Репозитарного или Дополнительного кода) коду из Справочника участников репозитарной деятельности.	<a href="#">NRD055</a>
1.13	После определения корневого тэга, проверить, что присланная анкета имеет тип сообщения, поддерживаемый Репозитарием.	<a href="#">NRD162</a>
1.14	Проверить значение поля partyName для Отправителя на его соответствие значению указанного в Справочнике участников репозитарной деятельности.	<a href="#">NRD044</a>
2.	<b>Проверки полей анкеты генерального соглашения</b>	
2.1	Дата сообщения [Дата_формирования_сообщения] не может быть больше текущей календарной даты и меньше [текущая дата – 3 дня]. В противном случае считается, что дата сообщения указана не верно.	<a href="#">NRD014</a>
2.2	Соответствие Отправителя Анкеты [Код отправителя сообщения] и отправителя сообщения, указанного транспортной системой. Сверяется [Код отправителя сообщения] и значение ID_Sender в журнале учета сообщений. В случае, если поля совпадают, проверка считается пройденной успешно.	<a href="#">NRD015</a>
2.3	Проверяется наличие скана соглашения. Если с сообщением передан файл со сканом, в XML сообщении должно быть заполнено поле [Имя_файла_со_сканом], и наоборот, если заполнено поле [Имя_файла_со_сканом], должен присутствовать файл с XML	<a href="#">NRD003</a> <a href="#">NRD004</a>
2.4	Проверить, что заполнен регистрационный номер генерального соглашения, присвоенный репозитарием, и соответствующее ген соглашение действительно зарегистрировано в журнале учёта генеральных соглашений.	<a href="#">NRD017</a>
2.5	Проверить, что соответствующее генеральное соглашение на дату обработки сообщения обслуживается в репозитории. Для этого необходимо обратиться к журналу учёта генеральных соглашений и проверить поле, "Статус генерального соглашения ". Проверка считается пройденной, если генеральное соглашение не deregistrirvano, не отменено и не расторгнут соответствующий договор.	<a href="#">NRD016</a>
2.6	Проверить, что сторона, от имени которой направляется анкета соглашения, является действующими клиентами репозитория. Необходимо проверить в Справочнике участников репозитарной деятельности, что сторона ген соглашения входит в Справочник и у нее есть действующий договор. Договор считается действующим, если текущий операционный день репозитория больше или равен дате заключения договора и меньше либо равна дате закрытия.	<a href="#">NRD021</a>
2.7	Проверить, что указанные в анкете стороны ген соглашения соответствуют сторонам этого ген соглашения, зарегистрированного в журнале учёта договоров, и не нарушен порядок их указания.	<a href="#">NRD017</a>
2.8	Проверить, что в сообщении заполнен тэг correlationId, и он уникален для анкет генеральных соглашений	<a href="#">NRD034</a>



2.9	Проверить, что в сообщении есть блоки party с идентификаторами 'TradeRepository', 'Party1', 'Party2', 'Sender',	<a href="#">NRD026</a>
2.10	Проверить, что код, указанный в header\SentBy соответствует коду, указанному в блоке Party[id='Sender'].	<a href="#">NRD027</a>
2.11	Проверить, что код, указанный в header\sendTo соответствует коду, указанному в блоке Party[id='TradeRepository']	<a href="#">NRD028</a>
2.12	Проверить, что сообщение представлено активным ИЛом стороны, по которому имеются действующие на данный момент полномочия в справочнике полномочий ИЛ, для подачи соответствующей анкеты, включая соответствия дополнительным ограничениям, при их наличии (по номеру ГС/Контрагенту). Не осуществлять данную проверку, в случае если Отправитель = ИЛ-НРД (NSD000CBRBIL).	<a href="#">NRD032</a>
2.13	Для каждого блока party, в котором заполнен partyName, проверить по справочнику участников репозитарной деятельности соответствие краткого наименования и кода, указанного в partyId. В случае внесения изменений в ранее зарегистрированное ГС, при котором происходит изменение Доп. кода (2-го partyId) либо наименования (partyName) одной из сторон, проверить, что сторона, по которой производится такое изменение: либо не является действующим клиентом репозитария. Выполняется одно из условий: клиент найден в базе репозитария и дата расторжения договора с репозитарием <= текущей даты. Клиент не найден в базе репозитария. В случае если проверка пройдена, произвести изменение указанных реквизитов. Либо изменяемый реквизит отсутствует в базе репозитария. В случае прохождения проверки, допускать изменение реквизитов. В случае если проверка не пройдена – отказ.	<a href="#">NRD044</a>
2.14	При регистрации нового ГС, в случае наличия по какой либо из сторон реп. кода, проверить его дату расторжения репозитарного договора. В случае если клиент найден в базе репозитария и дата расторжения репозитарного договора <= текущей даты - отказ	<a href="#">NRD101</a>
2.15	В случае указания для стороны/ИЛа в блоке Party дополнительного тэга partyID (например, LEI/SNILS код), проверить данный код LEI/SNILS на соответствие маске {LEI_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX}{SNILS_XXXXXXXXXX}. Типов кодов больше.	<a href="#">NRD087</a>
2.16	В случае указания стороной/ИЛом в блоке Party дополнительного тэга partyID (например, LEI/SNILS код), проверить данный код LEI/SNILS на соответствие указанному репозитарному коду в Справочнике участников репозитарной деятельности. В случае наличия кодов LEI/SNILS в Справочнике и не соответствия кодов данного участника, указанным в анкете – формируем отказ	<a href="#">NRD149</a>
2.17	Проверить, что со стороной, от имени которой направлена, анкета не расторгнут репозитарный договор. В случае односторонней отчетности, при котором, с одной из сторон расторгнуто репозитарное соглашение: дата расторжения репозитарного договора <= текущей даты. Либо сторона отказалась от репортинга (признак NOT_REPORTING = 'Y') Необходимо проверить по Справочнику участников репозитарной деятельности, что стороны ген соглашения входят в Справочник и не имеют признаков, определяющих ее как участника с которым расторгнуто репозитарное соглашение/отказавшегося от репортинга.	<a href="#">NRD021</a>
2.18	Проверка для отправителя, уна казание 2-х идентификационных кодов (тэгов PartyID): Репозитарного кода и кода LEI. В случае если, у ИЛ отсутствует один из кодов - отказ.	<a href="#">NRD161</a>
2.19	Проверка для блока описывающего Сторону1/2, заполнение поля <Country> и соответствие значения справочнику «cs\iso3166».	<a href="#">NRD007</a>

	<p>В случае отсутствия данного поля – отказ</p> <p>В случае некорректного заполнения (значение, отсутствующее в справочнике) – отказ.</p>	
2.20	<p>Проверка для блока описывающего Сторону1/2 заполнение поля &lt;Classification&gt; и соответствие значения справочнику «cs\north-american-industry-classification-system(nsd)»</p> <p>В случае отсутствия данного поля – отказ</p> <p>В случае некорректного заполнения (значение, отсутствующее в справочнике) – отказ.</p>	<a href="#">NRD007</a>
2.21	<p>Проверка для блока описывающего Сторону1/2, заполнение поля &lt;organizationType&gt; и соответствие значения справочнику «cs\organization-type(nsd)».</p> <p>В случае отсутствия данного поля – отказ</p> <p>В случае некорректного заполнения (значение, отсутствующее в справочнике) – отказ.</p>	<a href="#">NRD007</a>
2.22	<p>Для Стороны, осуществляется проверка обязанности отчитываться в Репозиторий согласно указанным признакам.</p> <p>В случае если Сторона не обязана отчитываться в Репозиторий, допускается указание идентификационных кодов PartyID по вариантам, для неотчитывающейся стороны. Если в анкете отсутствует одно или оба поля идентификационных кодов (тэгов PartyID) - отказ.</p>	<a href="#">NRD161</a>
2.23	<p>Проверить, что в блоке, описывающем Сторону 1/2 присутствуют два тэга partyid.</p> <p>Если отсутствует один или оба тэга PartyID выдавать отказ.</p>	<a href="#">NRD161</a>
2.24	<p>В случае указания кода LEI/SNILS в блоке Party (описывающего Сторону), в анкете одной из Сторон, и отсутствие кода LEI/SNILS в соответствующем блоке Party в анкете другой стороны, проводится проверка Стороны (по которой в одной из анкет не указан код LEI/SNILS) на обязанность/не обязанность отчитываться в Репозиторий.</p> <p>По результатам проверки:</p> <p>если сторона не обязана отчитываться в Репозиторий – проверка пройдена, и в реестр заносится непустое значение поля partyID (Код LEI).</p> <p>если сторона обязана отчитываться в Репозиторий – отказ.</p>	<a href="#">NRD161</a>
2.25	<p>Для блока UTIGeneratingParty (код UTI), проверить наличие UTIGeneratingParty в блоке &lt;Party&gt;, а также в блоке &lt;Party&gt; проверить наличие тэга tradeId для UTIGeneratingParty (код UTI).</p>	<a href="#">NRD026</a>
2.26	<p>Для тэгов tradeId для UTIGeneratingParty, проверить количество символов.</p> <p>В случае, если количество символов &gt; 52 - отказ</p>	<a href="#">NRD179</a>
2.27	<p>Для тэга tradeId для UTIGeneratingParty, (UTI код) проверить указанный код, на уникальность, отсутствие ранее зарегистрированных анкет с данным кодом.</p> <p>Эта проверка не производится, в случае если подаваемая анкета является анкетой на изменение, и изменяемая анкета уже имеет такой же код.</p>	<a href="#">NRD179</a>
2.28	<p>В случае подачи анкеты на изменение, проверить значение кода tradeId для UTIGeneratingParty, если код отличается от исходной анкеты (за исключением случая отсутствия анкеты) – отказ.</p>	<a href="#">NRD179</a>
2.29	<p>Проверить, что не заполнен тэг &lt;fpml:trade/fpml:tradeHeader/fpml:partyTradeIdentifier/fpml:originatingTradeId&gt;</p> <p>Если тэг заполнен – отказ</p>	<a href="#">NRD001</a>
2.30	<p>Проверить, что не заполнен тэг &lt;fpml:trade/fpml:tradeHeader/fpml:partyTradeIdentifier/fpml:linkId&gt;</p> <p>Если тэг заполнен – отказ</p>	<a href="#">NRD001</a>

2.31	Только для сообщений, в которых tradeDate >= 01/07/16, Проверить наличие тэга tradeId для UTIGeneratingParty, в случае отсутствия тэга – отказ	<a href="#">NRD189</a>
2.32	Проверить, что в качестве UTIGeneratingParty не указан LEI код НРД, за исключением случаев отчетности сделок в рамках сервиса СУО (Отправитель ИЛ-НРД = NSD000CBRBIL). Если код LEI = LEI_253400M18U5TB02TW421 – отказ.	<a href="#">NRD194</a>
2.33	В случае указания для клиента стороны в блоке Client Details дополнительного тэга ID (LEI/SNILS/INN код), проверить данный код LEI/SNILS/INN на соответствие маске {LEI_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX}{SNILS_XXX-XXX-XXX XX}, {INN_XXXXXXXXXXXX}.	<a href="#">NRD087</a>
2.34	Для CM011 проверить, что номер генерального соглашения, указанный в тэге \\*\masterAgreementTermination\masterAgreementId существует в репозитории, и находится в одном из статусах: зарегистрировано/в ожидании.	<a href="#">NRD016</a>
2.35	Для CM011 проверить, что если ген соглашение закрывается по взаимному согласию клиентов (Причина закрытия 'Close' или 'Other' //*/nsdext:MasterAgreementTermination/nsdext:maTerminatingReason = 'Close'/'Other' ), все связанные с ген соглашением договора закрыты.	<a href="#">NRD053</a>
2.36	<b>Особенности изменения идентификационных кодов (partyId) Сторон, при внесении изменений в зарегистрированное генеральное соглашение/договор.</b> 1. Изменение доп. кода. Идентификаторы сторон (partyId), указанные реп. кодом (отличным от NONREF), не могут меняться при изменении генерального соглашения. Допускается изменение доп. кода, в случае наличия в зарегистрированном генеральном соглашении/договоре реп. кода, при этом осуществляется проверка нового доп. кода на соответствие «справочнику участников» по имеющемуся реп. коду. В случае отсутствия в справочнике нового доп. кода – отказ. 2. Добавление реп. кода (в случае его отсутствия/значения NONREF) В случае, отсутствия в ранее зарегистрированном генеральном соглашении/договоре реп. кода, либо значения NONREF, (Сторона по сделке – не клиент репозитария), при подачи изменения в генеральное соглашение, допускается добавление/изменение (с NONREF) идентификатора реп. кода в случае наличия в данном изменении доп.кода. При этом проверяется по данному участнику соответствие кодов: Реп.кода, старого доп. кода, нового доп. кода (в случае изменения в анкете ГС/договоре доп. кода) в «справочнике участников». В случае отсутствия/несоответствия в справочнике указанных кодов – отказ.	<a href="#">NRD178</a>
3.	<b>Проверка полей анкеты договора</b>	
3.1	Дата сообщения [Дата_формирования_сообщения] не может быть больше текущей календарной даты и меньше [текущая дата – 3 дня]. В противном случае считается, что дата сообщения указана не верно	<a href="#">NRD014</a>
3.2	Соответствие Отправителя Анкеты [Код отправителя сообщения] и отправителя сообщения, указанного транспортной системой. Сверяется [Код отправителя сообщения] и значение ID_Sender в журнале учета сообщений. В случае, если поля совпадают, проверка считается пройденной успешно.	<a href="#">NRD015</a>
3.3	Проверяется наличие скана договора. Если с договором передан файл со сканом, в XML сообщении должно быть заполнено поле [Имя_файла_со_сканом], и наоборот, если заполнено поле [Имя_файла_со_сканом], должен присутствовать файл с XML	<a href="#">NRD003</a> <a href="#">NRD004</a>
3.4	Проверить, что в сообщении заполнен тэг correlationId, и он уникален для анкет договоров.	<a href="#">NRD034</a>
3.5	Проверить, что в сообщении есть блоки party с идентификаторами 'TradeRepository', 'Party1', 'Party2', 'Sender'	<a href="#">NRD026</a>
3.6	В случае отсутствия тэга <nonStandardTerms> проверить, что заполнен регистрационный номер генерального соглашения, присвоенный	<a href="#">NRD017</a>

	репозитарием, и соответствующее ген соглашение действительно зарегистрировано в журнале учёта генеральных соглашений.	
3.7	В случае регистрации отчета договора в рамках ГС, проверить, что соответствующее генеральное соглашение на дату обработки сообщения обслуживается в репозитории. Для этого необходимо обратиться к журналу учёта генеральных соглашений и проверить поле, "Статус генерального соглашения ". Проверка считается пройденной, если генеральное соглашение не deregистровано, не отменено и не deregистрован соответствующий договор.	<a href="#">NRD016</a>
3.8	Проверить, что сообщение представлено активным ИЛом стороны, по которому имеются действующие на данный момент полномочия в справочнике полномочий ИЛ, для подачи соответствующей анкеты, включая соответствия дополнительным ограничениям, при их наличии (по номеру ГС/Контрагенту). Не осуществлять данную проверку, в случае если Отправитель ИЛ-НРД = NSD000CBRBIL.	<a href="#">NRD032</a>
3.9	Проверить, что указанные в анкете стороны договора соответствуют сторонам зарегистрированного ген соглашения (в случае анкеты в рамках ГС), и не нарушен порядок их указания.	<a href="#">NRD017</a>
3.10	В случае если в анкете на изменение договора вне ГС, одна из сторон не клиент/бывший клиент репозитария, и в качестве идентификатора <partyId1> данной стороны указан: реп. код, то данный код должен соответствовать коду в ранее зарегистрированной анкете договора. NONREF, соответствие с ранее зарегистрированной анкетой не проверяется. Если указанный реп. код не сходится ранее зарегистрированной анкетой – отказ.	<a href="#">NRD164</a>
3.11	Проверить, что стороны договора являются действующими клиентами репозитария. В случае одностороннего репортинга одна из сторон может не быть клиентом. Необходимо проверить по Справочнику участников репозитарной деятельности, что стороны договора входят в Справочник и у каждого есть действующий договор с репозитарием на обслуживание. Договор считается действующим, если текущий открытый опердень больше или равен дате заключения договора и меньше либо равен дате закрытия.	<a href="#">NRD021</a>
3.12	Проверить, что указанный присвоенный репозитарием номер договора на дату обработки сообщения обслуживается в репозитории. Для этого необходимо обратиться к журналу учёта договоров и проверить поле "Статус договора ". Проверка считается пройденной, если договор не deregистрован и не отменен.	<a href="#">NRD033</a>
3.13	В случае указания стороной/отправителем в блоке Party тэга partyID (LEI-код участника или СНИЛС или иной допустимый дополнительный код), проверить данный код на соответствие маске.	<a href="#">NRD087</a>
3.14	В случае указания стороной/отправителя в блоке Party тэга partyID (LEI/SNILS код), проверить данный код LEI/SNILS на соответствие указанному репозитарному коду в Справочнике участников репозитарной деятельности. В случае наличия кода LEI/SNILS в Справочнике участников репозитарной деятельности и не соответствие кодов данного участника указанному в анкете – отказ.	<a href="#">NRD149</a>
3.15	Проверить, что со стороны, от имени которой направлена анкета, не расторгнуто репозитарное соглашение.  В случае одностороннего репортинга, при котором, с одной из сторон расторгнуто репозитарное соглашение: дата расторжения репозитарного договора <= текущей даты. Либо сторона отказалась от репортинга (признак NOT_REPORTING = 'Y') Необходимо проверить по Справочнику участников репозитарной деятельности, что сторона ген соглашения входит в Справочник и не имеет	<a href="#">NRD021</a>

	соответствующих признаков, определяющих ее как участника, с которым расторгнуто репозитарное соглашение/отказавшегося от репортинга.	
3.16	В случае регистрации договора в рамках ГС, проверить наличие в ГС идентификационных кодов (PartyId) для блоков описывающих Стороны, в рамках которого регистрируется анкета договора. В случае если, в зарегистрированном ГС у Стороны1/Стороны2 присутствует LEI-код участника или СНИЛС или иной допустимый дополнительный код, проверить его наличие в анкете договора. Если кода нет – отказ. Если код указанный в анкете договора не совпадает с кодом, указанным в зарегистрированном ГС – отказ.	<a href="#">NRD164</a>
3.17	В случае одностороннего репортинга (если сторона, отказавшаяся от репортинга не являлась клиентом репозитария либо расторгла соглашение по CM014): дата расторжения репозитарного договора <= текущей даты. Сторона не являлась клиентом: нет репозитарного кода Для случая если клиент отказался от репортинга, но остался клиентом репозитария по CM012: признак NOT_REPORTING равен «Y». дата расторжения репозитарного договора отсутствует либо ее значение > текущей даты. Данная проверка не проводится.	<a href="#">NRD136</a>
3.18	В случае, если регистрируемая анкета является договором РЕПО (CM041 - repo) проверить, в блоке <fpml:spotLeg> отсутствие тэга <settlementCurrency>. Если тэг отсутствует, проверка пройдена. Если тэг присутствует – ошибка (с параметром #s = <settlementCurrency>). XPath тэга: fpml:nonpublicExecutionReport/fpml:trade/fpml:repo/fpml:spotLeg/fpml:settlementCurrency	<a href="#">NRD001</a>
3.19	В случае, если регистрируемая анкета является договором СВОП (CM021 - fxSwap) проверить, что значение тэга <dealtCurrency> блока <nearLeg> равно значению тэга <dealtCurrency> блока <farLeg>. Если значения равны, то проверка пройдена. Если значения не равны - ошибка (с параметром #s = <dealtCurrency>).  XPath тэгов: fpml:nonpublicExecutionReport/fpml:trade/fpml:fxSwap/fpml:nearLeg/fpml:dealtCurrency  fpml:nonpublicExecutionReport/fpml:trade/fpml:fxSwap/fpml:farLeg/fpml:dealtCurrency	<a href="#">NRD001</a>
3.20	Проверить, что Сторона, направившая анкету, указана в одном из полей servicingParty блока ClientDetails, и выбрано одно из следующих значений: 1) ownTrade – в собственных интересах 2) type, id, name, country - в интересах клиента Не производить данную проверку для сообщений CM015.	<a href="#">NRD001</a>
3.21	В случае одностороннего репортинга (Сторона1/2 в таблице MEMBERS.NOT_REPORTING = 'Y' или Сторона1/2 не активный клиент репозитария), либо если ИЛ1=ИЛ2, проверить, что блок ClientDetails, указан 2-а раза, и выбраны соответствующие значения из допустимых для данного блока: 1) ownTrade – в собственных интересах. 2) type, id, name, country - в интересах клиента 3) noInformation – неизвестно в чьих интересах заключен договор. Не производить данную проверку для сообщений.	<a href="#">NRD001</a>
3.22	Для Стороны1/2 проверять значение нового тэга (noInformation) в блоке ClientDetails (признак sfr). Если тэг отсутствует – проверка пройдена. В случае, если тэг присутствует (имеет значение «true»), то необходимо проверить по справочнику участников (MEMBERS), что для данной Стороны	<a href="#">NRD001</a>

	<p>признак NOT_REPORTING = 'Y', либо данная Сторона не является активным клиентом репозитария. Иначе – отказ. Не производить данную проверку для сообщений CM015.</p>	
3.23	<p>Проверка для блока описывающего Сторону1/2, заполнение поля &lt;Country&gt;, а также соответствие его значения справочнику «cs\iso3166» и значению указанному в ГС.</p> <p>В случае отсутствия данного поля – отказ В случае некорректного заполнения (значение, отсутствующее в справочнике) – отказ. В случае, несоответствия значения указанного в договоре (если договор в рамках ГС), значению в ГС – отказ.</p>	<a href="#">NRD001/NRDO07</a>
3.24	<p>Проверка для блока описывающего Сторону1/2 заполнение поля &lt;Classification&gt;, а также соответствие его значения справочнику «cs\north-american-industry-classification-system(nsd)» и значению указанного в ГС.</p> <p>В случае отсутствия данного поля – отказ В случае некорректного заполнения (значение, отсутствующее в справочнике) – отказ.</p> <p>В случае, если значение поля, указанное в ГС = «Other», а значение поля указанное в анкете договора (если договор в рамках ГС) отлично от «Other» - отказ. В других случаях проверка считается пройденной.</p>	<a href="#">NRD001/NRDO07</a>
3.25	<p>Проверка для блока описывающего Сторону1/2, заполнение поля &lt;organizationType&gt;, а также соответствие его значения справочнику «cs\organization-type(nsd)», и значению указанного в ГС.</p> <p>В случае отсутствия данного поля – отказ В случае некорректного заполнения (значение, отсутствующее в справочнике) – отказ. В случае, несоответствия значения указанного в договоре (если договор в рамках ГС), значению в ГС – отказ.</p>	<a href="#">NRD001/NRDO07</a>
3.26	<p>Проверить, что тэг &lt;fpml:trade/fpml:tradeHeader/fpml:partyTradeIdentifier/fpml:linkId&gt; (Для TradeRepository) заполнен номером ГС, зарегистрированным в Репозитарии (если договор в рамках ГС).</p>	<a href="#">NRD039</a>
3.27	<p>Если для TradeRepository заполнен тэг &lt;fpml:trade/fpml:tradeHeader/fpml:partyTradeIdentifier/fpml:originatingTradeId&gt;, проверить имеется ли анкета CM015 с таким же tradeId (TradeRepository) в состоянии ожидания\ подтверждения или в реестре (зарегистрирована или deregистрирована).</p> <p>В случае если помимо tradeId за TradeRepository, указаны tradeId (отличны от NONREF) за Party1/Party2 их также необходимо проверить в указанной CM015.</p> <p>Если не найдена анкета с указанным tradeId для 'TradeRepository' – отказ. Если указанные tradeId за Party1/Party2 не сходятся с зарегистрированной анкетой CM015 – отказ.</p>	<a href="#">NRD185</a>
3.28	<p>Если для одной из сторон (Party1/Party2) заполнен тэг &lt;fpml:trade/fpml:tradeHeader/fpml:partyTradeIdentifier/fpml:originatingTradeId&gt;, наличие этого тэга для второй стороны обязательно, при этом допускается значение NONREF. Отсутствие тэга за вторую сторону - отказ</p>	<a href="#">NRD001</a>
3.29	<p>Если при регистрации нового договора в рамках ГС в нем отсутствует ссылка на репозитарный номер ГС ('TradeRepository' linkId = 'NONREF') - отказ</p>	<a href="#">NRD102</a>
3.30	<p>Если при регистрации договора присутствует ссылка на репозитарный номер ГС ('TradeRepository' linkId не равен NONREF), и ссылка на номер CM015</p>	<a href="#">NRD102</a>



	(‘TradeRepository’ originatingTradeId не равен NONREF), проверить, что анкета CM015 зарегистрирована в рамках того же ГС, что и подаваемая анкета договора.	
3.31	Если для сообщения CM015 заполнен тэг <fpml:trade/fpml:tradeHeader/fpml:partyTradeIdentifier/fpml:originatingTradeId> - отказ	<a href="#">NRD001</a>
3.32	Для tradeId по UTIGenetatingParty (код UTI), проверить наличие UTIGenetatingParty в блоке <Party>, а также в блоке <Party> проверить наличие тэга tradeId для UTIGenetatingParty (код UTI). Проверка действует с 01/07/2016.	<a href="#">NRD026</a>
3.33	Если linkId/originatingTradeId для UTIGenetatingParty присутствует - отказ	<a href="#">NRD001</a>
3.34	Для тэгов tradeId для UTIGeneratingParty, и его значение не равно NONREF, проверить количество символов. Если количество символов > 52 – отказ.	<a href="#">NRD179</a>
3.35	Для тэга tradeId для UTIGeneratingParty, (UTI код) проверить указанный код, на уникальность, отсутствие ранее зарегистрированных анкет с данным кодом. Эта проверка не производится, в случае если подаваемая анкета является анкетой на изменение, и изменяемая анкета уже имеет такой же код.	<a href="#">NRD179</a>
3.36	В случае подачи анкеты на изменение, проверить значение кода tradeId для UTIGeneratingParty, если код отличается от исходной анкеты – отказ.	<a href="#">NRD179</a>
3.37	Если linkId для Party1/Party2 присутствует – отказ	<a href="#">NRD001</a>
3.38	В случае указания тэга <automaticExecution> проверить наличие тэгов <startAgreementDate> и <endAgreementDate>	<a href="#">NRD187</a>
3.39	Проверить наличие тэга <nonStandardTerms>, если тэг отсутствует и присутствует тэг <linkId> для ‘TradeRepository’, проверка пройдена. Если одновременно присутствуют оба тэга и <nonStandardTerms> и <linkId>	<a href="#">NRD188</a>
3.40	В случае если договор заключен вне ГС (наличие тэга <nonStandardTerms>), проверить наличие клиентского идентификатора для стороны за которую направляется отчет (Party1/Party2), и то, что это значение не равно NONREF, иначе – отказ.	<a href="#">NRD120</a>
3.41	Только для сообщений с tradeDate >= 01/07/16, Проверить наличие тэга tradeId для UTIGeneratingParty, в случае отсутствия тэга – отказ	<a href="#">NRD007</a>
3.42	Проверить что тэг <nonStandartTerm> указан 1 раз, иначе отказ	<a href="#">NRD001</a>
3.43	В случае наличия тэга <partiesAreAffiliated>, проверить значение тэга <nonStandartTerm>. В случае, если <nonStandartTerm> = true, проверка пройдена. В случае, если <nonStandartTerm> = false, либо тэг отсутствует – отказ.	<a href="#">NRD239</a>
3.44	Проверить, что в случае присутствия в анкетах CM051-CM054 блока //<commodity>, тип данного элемента должен быть type="nsdext:CommodityBasket" Иначе в текст ошибки выводить тэг <nsdext:commodity xsi:type="nsdext:CommodityBasket" id="">	<a href="#">NRD001</a>
3.45	В случае двухстороннего репортига - ИЛ1<>ИЛ2, проверить, что признак автозакрытия договора не установлен (<automaticExecution>!=true). Если заполнен – отказ.	<a href="#">NRD221</a>
3.46	Для анкет договоров, направленных не ИЛом – НРД (отправитель не NSD000CBRIL) проверить в анкете поле «Статус СУО» при изменении договора/статуса договора. Если текущий Статус СУО = “Active” – отказ.	<a href="#">NRD225</a>
3.47	В случае указания для клиента стороны в блоке Client Details дополнительного тэга ID (например, LEI/SNILS/INN код), проверить данный код LEI/SNILS/INN на соответствие маске {LEI_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX}{SNILS_XXX-XXX-XXX XX}, {INN_XXXXXXXXXX}.	<a href="#">NRD087</a>
4.	<b>Особенности проверки полей анкеты CM092 (Отчет об уплате маржевых сумм - TransfersAndExecution)</b>	

4.1	Проверить что элемент transfersAndExecution/ reportIdentifier/linkId (Идентификатор ГС, в рамках которого направляется отчет), указан для partyReference = 'Trade repository' и его значение равно номеру ГС, зарегистрированному в реестре.	<a href="#">NRD089</a>
4.2	Проверить, что отчет направляется в рамках одного ГС \\*\transfersAndExecution \reportIdentifier\linkId (одно значение для блока reportIdentifire с partyReference = 'Trade repository').	<a href="#">NRD165</a>
4.3	Проверить, что сообщение представлено активным ИЛом стороны, указанной в \\*\transfersAndExecution \reportParty, (Party1/Party2/All) по ГС указанному в \\*\transfersAndExecution\reportIdentifier\linkid, по которому имеются действующие на данный момент полномочия в справочнике полномочий ИЛ, для подачи соответствующей анкеты, включая соответствия дополнительным ограничениям, при их наличии (по номеру ГС/Контрагенту). Не осуществлять данную проверку, в случае если Отправитель равен ИЛ-НРД (NSD000CBRBIL).	<a href="#">NRD032</a>
4.4	Проверить, что Party1 (в CM092) равен Party1(в ген соглашении на которое ссылается CM092) Party2 (в CM092) равен Party2 (в ген соглашении на которое ссылается CM092) Ген. соглашение, указанное в \\*\transfersAndExecution\reportIdentifier\linkid	<a href="#">NRD026</a>
4.5	Проверить, что для ГС, указанного в \\*\transfersAndExecution\reportIdentifier\linkid  Сторонами по договорам являются стороны, указанные в блоках Party id= Party1; id=Party2	<a href="#">NRD017</a>
4.6	Проверить наличие в Анкете ГС/договоров реп. кодов, для блоков описывающих Стороны, в рамках которого регистрируется анкета CM092. В случае если реп.код присутствует, проверить его соответствие реп. кодом указанным в анкете CM092 Если реп.коды не сходятся – отказ.  В случае если, в Анкете ГС/договоров у Стороны1/Стороны2 присутствует только доп. код (реп. код = NONREF, доп. код = значение из допустимых кодов), проверить его наличие и соответствие коду указанному в анкете CM092. Если код указанный в анкете не совпадает с кодом, указанным в зарегистрированном договоре – отказ.  В случае если, в зарегистрированном Договоре у Стороны1/Стороны2 отсутствует код LEI, наличие этого кода в анкете CM092 определяется в соответствии с процедурой.  В случае если анкета CM092 подается по ранее зарегистрированной анкеты договора/договоров, которые в настоящий момент не поддерживаются репозитарием, данная проверка по таким договорам не проводится.	<a href="#">NRD164</a>
4.7	В случае если, сообщение было подано на изменение ранее зарегистрированной анкеты, проверить соответствие номера ГС в анкете изменения номеру ГС \\*\transfersAndExecution\reportIdentifier\linkid в ранее зарегистрированной анкете. В случае расхождения – отказ В случае если, сообщение на изменение было подано по анкете CM092, зарегистрированной до 01.10.2015, не проверять наличие и соответствие генерального соглашения в ранее зарегистрированной анкете.	<a href="#">NRD166</a>
4.8	Проверить, что год и месяц в значении поля asOfDate равны году и месяцу в значениях полей valuationDate (для всех блоков creditSupportInformation).	<a href="#">NRD169</a>
4.9	Если присутствует ссылка на репозитарный номер ГС ('TradeRepository' linkId не равен NONREF), и ссылка на номер CM015 ('TradeRepository'	<a href="#">NRD102</a>



	originatingTradeId не равен NONREF), проверить, что анкета CM015 зарегистрирована в рамках того же ГС, что и подаваемая анкета является CM092.	
4.10	Проверить, что в полномочиях ИЛа, представившего отчет, значение признака <transfersAndExecution>: Если признак = 'false' проверить присутствует ли в перечне полномочий тип документа = <transfersAndExecution>, не учитывая ALLD. Если тип документа присутствует – проверка пройдена, иначе - отказ. Если признак = 'true' – проверка пройдена.	<a href="#">NRD080</a>
4.11	<b>Особенность указания tradeId при регистрации отчета (в целях избежания дублирования сообщений).</b> Для поиска дубликата проверяем список сообщений на соответствие полей tradeId тем, что указаны в новом сообщении. Допускается указание любого значения tradeId за Party1/Party2, если ранее не было зарегистрировано отчета с таким же значением tradeId за сторону указанную в поле reportParty (в случае 'All' – за обе стороны) и таким же значением поля valuationDate в любом из блоков creditSupportInformation (CM092)/markToMarketValuation (CM094), иначе – отказ.	<a href="#">NRD176</a>
5.	<b>Особенности проверки полей анкеты CM094 (Отчет о расчете справедливой (оценочной) стоимости - markToMarketValuation)</b>	
5.1	Проверить, что сообщение представлено активным ИЛом стороны, указанной в \\*\ markToMarketValuation \reportParty, (Party1/Party2/All) по ГС в рамках которого, указан договор/договоры \\*\ markToMarketValuation \MarkToMarketDetails \MarkToMarketInformation \trade Id (При этом договора могут еще не быть зарегистрированы в реестре, но могут быть зарегистрированы в журнале входящих сообщений, это не должно влиять на регистрацию отчета), по которому имеются действующие на данный момент полномочия в справочнике полномочий ИЛ, для подачи соответствующей анкеты, включая соответствия дополнительным ограничениям, при их наличии (по номеру ГС/Контрагенту). Не осуществлять данную проверку, в случае если Отправитель = ИЛ-НРД (NSD000CBRIL).	<a href="#">NRD032</a>
5.2	Проверить, что Party1(в CM094) равно Party1(в ген соглашении, на которое ссылается CM094 (через договоры markToMarketValuation \MarkToMarketDetails \MarkToMarketInformation \tradeId)) Party2(в CM094) равно Party2(в ген соглашении на которое ссылается CM094 (через договоры markToMarketValuation \MarkToMarketDetails \MarkToMarketInformation \tradeId))	<a href="#">NRD026</a>
5.3	Проверить, что для всех договоров, указанных в markToMarketValuation \MarkToMarketDetails \MarkToMarketInformation \tradeId  Сторонами по договорам являются стороны, указанные в блоках Party с id= Party1 и id=Party2	<a href="#">NRD017</a>
5.4	Проверить, что не заполнен тэг <originatingTradeId> и <linkId> Если тэг заполнен – отказ	<a href="#">NRD001</a>
5.5	Проверить наличие в Анкете договора/договоров реп. кодов, для блоков описывающих Стороны, в рамках которого регистрируется анкета CM094. В случае если Реп.код присутствует, проверить его соответствие реп. коду указанному в анкете CM094 Если реп.код не сходится – отказ.  В случае если, в Анкете договора/договоров у Стороны1/Стороны2 присутствует только доп. код (реп. код = NONREF, доп. код = 1 из допустимых кодов), проверить его наличие и соответствие коду указанному в анкете CM094. Если код указанный в анкете не совпадает с кодом, указанным в зарегистрированном договоре – отказ.	<a href="#">NRD164</a>

	<p>В случае если, в зарегистрированном Договоре у Стороны1/Стороны2 отсутствует код LEI, наличие этого кода в анкете определяется в соответствии с процедурой.</p> <p>В случае, если анкета CM094 подается по ранее зарегистрированной анкеты договора/договоров, которые в настоящий момент не поддерживаются репозитарием, данная проверка по таким договорам не проводится.</p>	
5.6	<p>В случае указания нескольких договоров в \\*\markToMarketValuation\MarkToMarketDetails\MarkToMarketInformation\tradeId проверить, что все они зарегистрированы в рамках одного ГС.</p>	<a href="#">NRD164</a>
5.7	<p>В случае если, сообщение было подано на изменение ранее зарегистрированной анкеты, проверить соответствие номера ГС в анкете изменения номеру ГС для договоров указанных в \\*\transfersAndExecution\reportReferences ранее зарегистрированной Анкете. В случае расхождения - отказ</p>	<a href="#">NRD166</a>
5.8	<p>Проверить, что год и месяц в значении поля asOfDate равны году и месяцу в значениях полей valuationDate (для всех блоков MarkToMarketDetails).</p>	<a href="#">NRD169</a>
5.9	<p>Проверить, что в полномочиях ИЛа, представившего отчет, значение признака &lt;markToMarketValuation&gt;.</p> <p>Если признак = 'false': Проверить присутствует ли в перечне полномочий тип документа = &lt;markToMarketValuation&gt;, не учитывая ALLD. Если тип документа присутствует – проверка пройдена, иначе – отказ</p> <p>Если признак = 'true': Проверить тип сделки в перечне договоров, по которым направляется данный отчет. Если хотя бы по одному договору тип сделки не соответствует указанному в перечне полномочий данного ИЛа – отказ.</p>	<a href="#">NRD080</a>
5.10	<p><b>Особенность указания tradeId при регистрации отчета (в целях избежания дублирования сообщений).</b></p> <p>Для поиска дубликата проверяем список сообщений на соответствие полей tradeId тем, что указаны в новом сообщении. Допускается указание любого значения tradeId за Party1/Party2, если ранее не было зарегистрировано отчета с таким же значением tradeId за сторону указанную в поле reportParty (в случае 'All' – за обе стороны) и таким же значением поля valuationDate в любом из блоков creditSupportInformation (CM092)/markToMarketValuation (CM094), иначе – отказ.</p>	<a href="#">NRD176</a>
6.	<p><b>Особенности проверки полей анкеты CM093 (Анкета о состоянии обязательств по договорам - executionStatus)</b></p>	
6.1	<p>Проверить, что все генеральные соглашения, репозитарные номера которых указаны в блоках \\*\tradesWithStatus\reportReferences\masterAgreementId существуют, не закрыты и обслуживаются на момент обработки в репозитории. В случае, если анкета не содержит ни одной ссылки на ген соглашение, проверка пропускается.</p>	<a href="#">NRD016</a>
6.2	<p>Проверить, что все договора, репозитарные номера которых указаны в блоках \\*\tradesWithStatus\reportReferences\tradeId существуют, не закрыты и обслуживаются на момент обработки в репозитории. В случае, если анкета не содержит ни одной ссылки на договор, проверка пройдена.</p>	<a href="#">NRD033</a>
6.3	<p>Проверить, что отправитель сообщения входит в число ИЛов по каждой из сделок, указанных в блоках \\*\tradesWithStatus\reportReferences. При этом необходимо учитывать, что если в reportReferences содержится тэг masterAgreementId, то должны быть учтены все активные сделки в рамках указанного генерального соглашения. При этом:</p>	<a href="#">NRD046</a>

	не производить проверку полей PartyID по маске. проверять поля PartyID на соответствие значениям, указанным в зарегистрированном ГС.	
6.4	Проверить, что по всем сделкам, указанным в блоках \\*\tradesWithStatus\reportReferences, общее число ИЛов не больше 2-х. При этом необходимо учитывать, что если в reportReferences содержится тэг masterAgreementId, то должны быть учтены все активные сделки в рамках указанного генерального соглашения.	<a href="#">NRD047</a>
6.5	В случае если в анкете CM093 присутствует договора вне ГС, одна из сторон которого не клиент/бывший клиент репозитария, и в качестве идентификатора <partyId1> данной стороны указан: реп. код, то данный код должен соответствовать коду в зарегистрированной анкете договора. NONREF, соответствие с зарегистрированной анкетой не проверяется. Если указанный реп. код не сходится с зарегистрированной анкетой – отказ.	<a href="#">NRD164</a>
6.6	Проверить, что не заполнен тэг <fpml:trade/fpml:tradeHeader/fpml:partyTradeIdentifier/fpml:originatingTradeId> Если тэг заполнен – отказ	<a href="#">NRD001</a>
7.	<b>Этапы обработки сообщения, присланного на замену ранее предоставленной анкеты</b>	
7.1	Осуществляется поиск заменяемого документа. Если заменяемый документ найден: происходит проверка, что заменяемый документ находится в статусе ожидания. Если заменяемый документ не в статусе ожидания – отказ в обработке текущего сообщения.	<a href="#">NRD036</a>
7.2	Если заменяемый документ находится в статусе ожидания, документ переводится в статус – ожидание замены. Происходит проверка текущего документа в соответствии с процедурой обработки анкеты, предоставленной клиентом. Если в текущем документе найдены ошибки, отказываем по текущему сообщению и возвращаем заменяемый документ в статус ожидания. Формируется отказ по заменяемому сообщению с ошибкой.	<a href="#">NRD038</a>
7.3	В случае, если к моменту отмены, контрагенту по процессу регистрации уже был отправлен запрос на согласование параметров анкеты, необходимо сформировать сообщение об отмене запроса. Сообщение об отмене запроса полностью идентично извещению об отказе в регистрации отменяемого сообщения, кроме следующих элементов: Сообщение направляется получателю запроса на согласование. header/inReplayTo содержит номер запроса на согласование.	<a href="#">NRD062</a>
7.4	Если заменяемый документ не найден – отказ в обработке текущего сообщения с ошибкой.	<a href="#">NRD037</a>
7.5	Если в списке сообщений, находящихся в состоянии ожидания, найдено сообщение, которое нужно заменить на полученное. Для этого оформляется отказ по найденному в списке (формируется извещение об отказе в регистрации данных с ошибкой) и продолжается обработка полученного сообщения.	<a href="#">NRD025</a>
8.	<b>Особенности проверки полей анкет балк-отчетов</b> <b>CM083 - Отчет по сделкам репо repoBulkReport;</b> <b>CM084 - Отчет по сделкам валютный своп fxSwapBulkReport; CM085 - Отчет по конверсионным сделкам fxSingleLegBulkReport</b>	
8.1	Проверить, что длина идентификатора договора/сделки, присвоенного участником не должна превышать 35 символов. В случае превышения – отказ.	<a href="#">NRD093</a>
8.2	Проверка на уникальность идентификатор каждой сделки, присвоенный клиентом, в блоке nsdext:repoBulkReport/clientRepos/repoDetails nsdext:fxSwapBulkReport/clientSwaps/swapDetails nsdext:fxSingleLegBulkReport/clientsingleLeg/singleLegDetails	<a href="#">NRD172</a>

	В случае, если в блоке присутствуют сделки с одинаковым ID – отказ.	
8.3	Проверка, что клиентский идентификатор анкеты и перечня сделок nsdext:repoBulkReport/clientRepos/repoDetails nsdext:fxSwapBulkReport/clientSwaps/swapDetails nsdext:fxSingleLegBulkReport/clientsingleLeg/singleLegDetails не является пустым, и не имеет значение – NONREF.	<a href="#">NRD171</a>
8.4	Проверить признак, определяющий deregistrацию анкеты (TradeObligationStatus = T; SO; D). В случае его отсутствия, либо отличия значения от "T", "SO" или "D" – отказ.	<a href="#">NRD001</a>
8.5	Проверить наличие UTIGenetatingParty в блоке <Party>, а также проверить наличие тэга tradeId с атрибутом 'u' для UTIGenetatingParty (код UTI). Проверка начинает действовать с 01/07/2016.	<a href="#">NRD026</a>
8.6	Если linkId/originatingTradeId для UTIGenetatingParty присутствует - отказ	<a href="#">NRD001</a>
8.7	Для tradeId – атрибут 'u', и его значение не равно NONREF, проверить количество символов. Если количество символов > 52 – отказ.	<a href="#">NRD179</a>
8.8	Для тэга tradeId - атрибут 'u', (UTI код) проверить указанный код, на уникальность, в рамках всех сделок указанных в сообщении, и в ранее зарегистрированных анкет с данным кодом в реестре. Эта проверка не производится, в случае если подаваемая анкета является анкетой на изменение, и изменяемая анкета уже имеет такой же код.	<a href="#">NRD179</a>
8.9	Проверить наличие тэга tradeId с атрибутом 'u' для UTIGeneratingParty по всем сделкам в отчете, в случае отсутствия тэга – отказ	<a href="#">NRD007</a>
8.10	Проверить указание <PartyId> для блока описывающего контрагента \\<counterparty>. Если Party1 не равно Counterparty и первый <PartyId> = NONREF, второй <PartyId> = допустимый доп.код (в том числе PASS) – проверка пройдена. Если Party1 не равен Counterparty, и в качестве любого <PartyId> указан Rep. код – отказ Если Party1 равен Counterparty, поля <PartyId>, <PartyId>, <partyName> должны быть заполнены одинаково, иначе отказ.	<a href="#">NRD145</a>
8.11	Проверить, что Sender = ИЛ Party1 с типом отчетности в CM016 ALLD	<a href="#">NRD042</a>
8.12	В случае, если <nonStandardTerms> отсутствует проверить, что <Party2> равен <counterparty> и в анкете указан только один блок <counterparty>.	<a href="#">NRD237</a>
8.13	В случае, если <nonStandardTerms> присутствует со значением = true, проверить, что поля блока <Party2> - описывающего контрагента (отчет вне рамок ГС) присутствует, partyId1/ partyId2 со значением NONREF (classification, country, organizationType не заполняются).	<a href="#">NRD026</a>
8.14	В случае подачи анкеты с блоком <corrective>, проверить, совпадает ли количество сделок в новой анкете с количеством сделок в ранее зарегистрированной анкете. Если нет - отказ.	<a href="#">NRD215</a>
8.15	В случае подачи анкеты с блоком <corrective>, проверить, имеются ли в новой анкете значения атрибутов: r,u поля tradeId, в записях повторяющегося блока, которых нет в ранее зарегистрированной анкете. Если имеются – отказ.	<a href="#">NRD217</a>
8.16	В случае указания для клиента стороны в блоке Client Details дополнительного тэга ID (LEI/SNILS/INN код), проверить данный код LEI/SNILS/INN/PASS на соответствие маске {LEI_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX}, {SNILS_XXX-XXX-XXX XX}, {INN_XXXXXXXXXX} {PASS_X...X}.	<a href="#">NRD087</a>
9.	<b>Удаление просроченных сообщений, находящихся в статусе ожидания</b>	
9.1	Процедура удаления сообщений, находящихся в статусе ожидания (ожидания регистрации связной анкеты генерального соглашения) и в ожидание	<a href="#">NRD039</a>

	реакции контрагента длительное время. Входящим параметром процедуры является закрытый операционный день, за который производится обработка. Процедура для каждого из сообщений, находящихся в статусе ожидания, определяет операционный день, в который сообщение было принято. Если дата этого операционного дня меньше либо равна дате, заданной в параметре процедуры (для ожидания регистрации связного генерального соглашения – 1 опердень; для остальных – 30 календарных дней), по сообщению должен быть сформирован отказ.	
9.2	Если с момента регистрации сообщения в журнале входящих сообщений (рассматривается опердень входящего сообщения) до текущего времени прошло количество календарных дней большее, чем указано в справочнике (текущее значение – 30 календарных дней), сообщение считается просроченным – отказ.	<a href="#">NRD040</a>
10.	<b>Особенности проверки полей анкеты Заявления о назначении Информировующих лиц (CM016 - designationRA)</b>	
10.1	Дата сообщения [Дата_формирования_сообщения] не может быть больше текущей календарной даты и меньше [текущая дата – 3 дня]. В противном случае считается, что дата сообщения указана не верно	<a href="#">NRD014</a>
10.2	Соответствие Отправителя Анкеты [Код отправителя сообщения] и отправителя сообщения, указанного транспортной системой. Сверяется [Код отправителя сообщения] и значение ID_Sender в журнале входящих сообщений. В случае, если поля совпадают, проверка считается пройденной успешно.	<a href="#">NRD015</a>
10.3	Проверить, что <Sender> равен <AgreementParty>.	<a href="#">NRD042</a>
10.4	Проверить, что в сообщении есть блоки party с идентификаторами 'TradeRepository', 'agreementParty', 'Sender' И имеют структуру, в соответствии с блоком <Party>	<a href="#">NRD026</a>
10.5	Проверить, что указанные в полях <reportingAgent> ИЛ, не повторяются.	<a href="#">NRD180</a>
10.6	Проверить, что все указанные в анкете <reportingAgent>, указаны идентификаторами <partyId> (Реп. код), <partyId> (LEI код). В случае отсутствия – отказ.	<a href="#">NRD161</a>
10.7	В случае указания в блоке <Party>/<reportingAgent> тэга partyID (LEI-код участника или СНИЛС или иной допустимый дополнительный код), проверить данный код на соответствие маске.	<a href="#">NRD087</a>
10.8	В случае указания в блоке <Party>/<reportingAgent> тэга partyID (LEI/SNILS код), проверить данный код LEI/SNILS на соответствие указанному репозитарному коду в Справочнике участников репозитарной деятельности. В случае наличия кода LEI/SNILS в Справочнике участников репозитарной деятельности и не соответствие кодов данного участника, указанному в анкете – отказ.	<a href="#">NRD149</a>
10.9	Проверить, что ни с одним из участников, указанных в блоках <Party>/<reportingAgent> не расторгнуто репозитарное соглашение.	<a href="#">NRD021</a>
10.10	Проверить наличие в Анкете Заявления идентификационных кодов (PartyId) для блока описывающих Клиента (Party). В случае если, в справочнике участников репозитарной деятельности присутствует LEI-код участника или СНИЛС или иной допустимый дополнительный код, проверить его наличие в анкете. Если кода нет – отказ.	<a href="#">NRD161</a>
10.11	Для каждого блока <reportingAgent> проверить наличие и соответствие справочнику тэгов <partyName>, <PartyId> (Реп. код.), <PartyId> (LEI код)	<a href="#">NRD164</a>
10.12	В случае указания тэга <link ID> (номер Ген. соглашения) проверить наличие зарегистрированного в репозитории ГС. В случае если ГС отсутствует – Отказ	<a href="#">NRD089</a>
10.13	В случае, если по одному из ИЛ <reportingAgent> указан тэг <linkId>, то тэг <counterParty>, должен отсутствовать, иначе – отказ.	<a href="#">NRD007</a>



10.14	В случае если в сообщении по нескольким ИЛам <reportingAgent>, указано одинаковое значение тэга <DocumentType>, проверить значения тэгов: <linkId>/<counterParty> В случае наличия одинаковых значений (включая отсутствие) для всех тэгов: Пример - ошибка: ИЛ1: Тип документа = РЕПО, ГС = ГС1 ИЛ2: Тип документа = РЕПО, ГС = ГС1	<a href="#">NRD070</a>
10.15	По всем ИЛ, проверить значение тэгов <TransfersAndExecution> блока <ReportingType>, в случае значений «True» проверить для данного ИЛ наличие в списке документов <DocumentType> типов документов СМ010 или СМ015 или ALLD. Если документы отсутствуют – отказ.	<a href="#">NRD182</a>
11.	<b>Особенности обработки анкет на изменение и переоткрытие закрытых анкет (Все анкеты договоров, генсоглашений, отчеты СМ092, СМ094)</b>	
11.1	Для сообщений СМ093 и СМ011, подаваемых для переоткрытия или изменения статуса анкет договоров/ГС в статусе deregistrated/закрыто или договоров в статусе ошибка после подачи клиентом СМ093 с кодом состояния договора 'R', проверить что: Дата последней deregistrated каждой из анкет+ 3 рабочих дня >= даты регистрации входящего сообщения в ЖУВС. Если условие не выполняется – отказ.	<a href="#">NRD218</a>
11.2	Если в сообщениях присутствует блок <amendment>/<reportAmendment> с/без элемента <correctRegisteredInfo>, проверить что: отправителем данной анкеты является: либо действующий ИЛ стороны, от имени которой направляется анкета изменения, либо сторона <Party1>/<Party2>. Иначе – отказ.	<a href="#">NRD042</a>
11.3	Если в сообщениях присутствует элемент <correctRegisteredInfo> в конце блока <amendment>/<reportAmendment> и договор/ГС находятся в закрытом статусе или в статусе ошибка после подачи клиентом СМ093 с кодом состояния договора 'R', проверить что: Дата последней deregistrated + 3 рабочих дня >= даты регистрации входящего сообщения в ЖУВС. Иначе – отказ.	<a href="#">NRD214</a>
11.4	В случае переоткрытия договора в рамках ГС (СМ093), проверить, что соответствующее генеральное соглашение на дату обработки сообщения обслуживается в репозитории. Для этого необходимо обратиться к журналу учёта генеральных соглашений и проверить поле, "Статус генерального соглашения". Проверка считается пройденной, если генеральное соглашение не deregistrated, не отменено и не расторгнут соответствующий договор.	<a href="#">NRD055</a>
11.5	Для сообщений СМ093 проверить, что изменение в указанный статус возможно для данного типа договора: В балк-отчетах можно менять только один закрытый статус на другой закрытый и обратно. В не балк-отчетах возможны любые изменения. Иначе – отказ.	<a href="#">NRD219</a>
11.6	Если в сообщениях СМ092/СМ094 присутствует элемент <correctRegisteredInfo> в конце блока <reportAmendment> - отказ.	<a href="#">NRD222</a>
11.7	Если в сообщениях на изменение, т.е. без элемента <correctRegisteredInfo> в конце блока <reportAmendment> присутствует тэг <amendment xsi:type="nsdext:TradeAmendmentContent"> - отказ.	<a href="#">NRD223</a>

## ПРИЛОЖЕНИЕ 1

### Справочник кодов, используемых для направления Извещения о расхождении в рамках обработки ФЛК (RM006).

Код сообщения (внешний)	Код сообщения (внутренний)	Текст сообщения (рус.)	Текст сообщения (анг.)
NRW001	FLC2_CHK_PFI	Данный договор должен быть классифицирован как ПФИ	<The contract should be specified as a derivative in the Derivatives classification code>
NRW002	FLC2_CHK_INTEREST_RATE	Указанная процентная ставка отличается от вычисляемой ставки более чем на 0,001 (0,1%)	<Indicated interest rate deviates from the calculated rate by more than 0.001 (0.1%)>
NRW003	FLC2_CHK_FORMAT_INTEREST_RATE	Для целей отчетности в репозиторий ставка указывается в виде десятичной дроби с точностью до 7 знаков после запятой	<Interest rate should be indicated in decimal fraction format with up to 7 decimal characters>
NRW004	FLC_DIFFERENCE	Расхождения вызваны нарушением ФЛК	
NRW005	FLC2_CHK_REGISTRY	Информация, содержащая сведения о договоре, занесена в реестр репозитория позднее трех рабочих дней с даты заключения, изменения или прекращения указанного договора	<Information about the contract is entered into the Repository registry later than three working days from trade date, amendment or termination date of the contract>
NRW006	FLC2_CHK_CURRENCY_RATE	Указанный курс по сделке отклоняется от официального курса иностранной валюты, установленного Банком России, более чем на 10%	<Indicated currency rate deviates from the official exchange rate of the foreign currency set by the Central Bank of Russia by more than 10% >
NRW007	FLC2_CHK_INMESSAGE	Информация, содержащая сведения о договоре, занесена в журнал учета сообщений репозитория позднее трех рабочих дней с даты заключения, изменения или прекращения указанного договора	< Information about the contract is entered into the journal of messages of the Repository later than three working days from trade date, amendment or termination date of the contract >
NRW008	FLC2_CHK_QUANTITY1	В поле <название поля- xml тэг > ожидается положительное значение, отличное от 0	The field <field name-xml tag> is expected to have a positive value other than 0
NRW009	FLC2_CHK_QUANTITY2	Возможная ошибка: значение в <название поля – xml тэг> превышает значение 1 трлн. руб.	Possible error: the value in the <field name - xml tag> exceeds the value of 1 trillion rub
NRW010	FLC2_CHK_DATES	Возможно нарушена хронологическая последовательность дат в сообщении: <Дата окончания срока	Possible error: the chronological sequence of dates in the message might have been violated: <Contract

		действия договора> меньше <название поля>	expiration date> less than <field name>
NRW011	FLC2_CHK_OPTION_PREMIUM	Отношение суммы премии опциона к номинальной сумме валюты на продажу превышает 25%"	Possible error: the ratio of the premium amount to the nominal put currency amount of exceeds 25%
NRW012	FLC2_CHK_NOMINAL_AMNT	Указанная Номинальная сумма не соответствует рассчитанному значению <Описание условия>	Possible error: indicated nominal amount does not match the calculated value <Rule description>
NRW013	FLC2_CHK_INTEREST_RATE_LIMIT	Возможная ошибка: значение в <название поля – xml тэг> превышает 1 (100%)	Possible error: value in <field name - xml tag> exceeds value = 1 (100%)
NRW014	FLC2_CHK_MARKET_PRICE	Возможная ошибка: цена базового актива отклоняется от рыночной на 20%" и более	Possible error: price of the underlying asset deviates from the market price by 20% or more
NRW015	FLC2_CHK_MATURITY_DATE	Возможная ошибка: дата окончания действия договора больше даты погашения облигации	Possible error: the expiration date of the contract is longer than the bond maturity date
NRW016	FLC2_CHK_CM093	Возможная просрочка отчетности обязательств по договорам. <список договоров ( номер договора, дата окончания действия договора)>. Для закрытия договоров необходимо отправить CM093	Possible delay in reporting liabilities under contracts. <List of contracts (TR contract number, expiration date of the contract)>. For closing of contracts in the registry it is necessary to submit the CM093 to the Repository.
NRW017	FLC2_CHK_CM094	Возможная просрочка отчетности справедливой/оценочной стоимости по договорам. <список договоров ( номер договора, дата окончания действия договора)>. Для отчетности информации необходимо отправить CM094	Possible delay in reporting of Mark to Market information about contracts. <List of contracts (TR contract number, expiration date of the contract)>. For the reporting, it is necessary to submit the CM094 to the Repository.
NRW018	FLC2_CHK_CP_DUPLICATE	Возможен дубликат договора <UTI старого договора>, <Реп.код договора сообщения>	Possible agreement duplicate договора <UTI of old agreement>, <Repository code of the old agreement>



## ПРИЛОЖЕНИЕ 2

### Справочники кодов, используемых для формирования извещений и уведомлений репозитария (RM002/CM002).

Код типа отказа	Описание причины	Примечание
NEXS	Сообщение содержит сведения о договоре, заключенном на условиях генерального соглашения, которое не внесено в реестр договоров и не представлено одновременно с сообщением о договоре.	В соответствии с Указанием Банка России от 16 августа 2016 г. N 4104-У.
BSGN	Сообщение подписано не уполномоченным лицом.	
AEXS	Сведения о договоре, содержащиеся в сообщении, уже внесены в реестр договоров.	
BINF	Сообщение получено от лица, которое в соответствии с генеральным соглашением не определено в качестве информирующего.	
BFMT	Сообщение составлено с нарушением установленных требований.	
RCDP	Отказ контрагента в подтверждении договора.	В соответствии с правилами обмена сообщениями с Репозитарием
ICAG	Неверно указан контрагент: Идентификатор контрагента не распознан/отсутствует/ или Неверно указаны реквизиты контрагента.	
AEXS	Сведения о договоре, содержащиеся в сообщении, уже внесены в реестр договоров.	
NARR	Иная причина.	

## Справочник «Коды причин», для направления Извещения об отказе в исполнении/регистрации (RM002).

Описание ошибки может быть параметрическим – т.е. в описание могут встречаться параметры, на место которых должны быть подставлены значения, специфичные для места возникновения ошибки.

В качестве параметров в текстовку ошибки подставляются символы `#s`. Описание подставляемых параметров даётся в месте документа, описывающем возникновение ошибки.

Код причины (внешний)	Код причины (внутренний)	Описание причины (рус.)	Описание причины (анг.)	Тип причины
NRD001	INVALID_TAG	В сообщении клиента отсутствует или неверно заполнен ключевой элемент #s. Сообщение не может быть обработано в Репозитории	The core element #s is missing in the message or has the invalid value. The message can not be processed	BFMT
NRD002	IN_MSG_SENDER_NOTFOUND	Отправитель сообщения не зарегистрирован в Репозитории	Sender of the message is not registered in the repository	NARR
NRD003	FILE_ID_IS_NOT_SET	К сообщению не приложен файл со сканом документа	The file with a scanned document is not attached	NARR
NRD004	XML_FILE_NOT_FOUND	В сообщении не указано имя файла - приложения	The message does not contain the name of the attached file	NARR
NRD005	CONTRACT_FOR_ID_NOT_FOUND	Анкета договора с идентификационным номером #s не существует	The form with ID #s is not found	NARR
NRD006	CONTRACT_NOT_REGISTRED_YET	Анкета договора еще не зарегистрирована	The form has not been registered	NARR
NRD007	XSD_ERROR_VALIDATION	Ошибка валидации входящего сообщения: #s	Message validation error: #s	BFMT
NRD008	XML_SIGNER_NOT_FOUND	Сообщение не содержит подписанта	The message does not contain any signer	NARR
NRD009	CONTRACT_NOT_FOUND	Исходный документ не найден	The original document is not found	NARR
NRD010	CONTRACT_TYPE_NOT_EQUALS	Тип договора #s, указанный в сообщении не совпадает с типом договора #s для генерального соглашения с номером #s	The contract type #s indicated in the message does not coincide with the contract type #s indicated in the Master Agreement № #s	NARR
NRD011	CONTRACT_ALREADY_REGISTRED	Анкета договора уже зарегистрирована	The form is already registered	AEXS

NRD012	MA_ALREADY_REJECTED	По анкете генерального соглашения контрагентом направлен отказ	The counterparty has declined the Master Agreement form	NARR
NRD013	XML_ANKET_WITH_STATUS_NOT_FOUND	Не найдено первичной анкеты в статусе "ожидание реакции контрагента"	No initial message with the status "Pending" is found	NARR
NRD014	MSD_DATE_NOT_CORRECTED	С момента значения указанного в поле "Время создания сообщения" прошло более #s дней	More than #s days has passed since the date set in "Message creation time" field.	NARR
NRD015	IN_MSG_SENDER_NEQUAL_REAL	Указанный в сообщении отправитель не совпадает с реальным отправителем сообщения	The sender specified in the message does not coincide with the real sender of the message	BINF
NRD016	MA_NOT_SUPPORTED	Генеральное соглашение #s на текущую дату не обслуживается в Репозитории	There is no Master Agreement #s in the repository's register on a given date	NARR
NRD017	INVALID_MA_OR_SIDES	Неверно указан регистрационный номер или стороны генерального соглашения/договора	Master agreement registration number is not valid or Master agreement/contract parties are not correctly specified	NARR
NRD018	CONTRACT_ALREADY_REJECTED	Анкета договора уже отменена	The form of contract has already been rejected	NARR
NRD021	REPCONT_IS_NOT_REGISTRED	У клиента #s с кодом #s не заключено репозитарное соглашение.	The client #s with the code #s is not the repository's client.	ICAG
NRD022	SIDE_HAS_NOT_INFORMATOR	Сторона #s по генеральному соглашению не имеет информирующих лиц и не сможет отчитаться по договорам, заключенным в рамках генерального соглашения. Сообщение зарегистрировано в журнале входящих с номером №#s.	The party #s of the Master Agreement does not have Reporting Agents and cannot report trades under the Master Agreement. The message is registered in the Log with the number N#s.	ICAG
NRD023	SIDE_RT_HAS_NOT_INFORMATOR	У стороны #s присутствует ИЛ с типом договора #s, для стороны #s необходимо указать ИЛ с аналогичным типом договора.	The party #s has a Reporting agent for contract type #s. For the party #s a Reporting agent with the same contract type should be indicated.	BINF
NRD024	SIDE_HAS_TOO_MANY_INFORM	Сторона по генеральному соглашению имеет несколько информирующих лиц по типу договора, согласование договора с несколькими	The party has more than one Reporting Agent for the specified contract type. It is impossible to reconcile the	BINF

		информирующими лицами невозможно	Contract with different Reporting Agents.	
NRD025	GETTING_NEW_DATA_DOCUMENT	В сообщении #s получена анкета с новыми данными	A form with new parameters is received in the message #s	NARR
NRD026	PARTY_NOT_CORRECT	Заполнение блоков Party сообщения не соответствует правилам заполнения сообщений Репозитария	The block "party" should be filled out according to the rules of message creation	BFMT
NRD027	WRONG_SENDER	Отправитель, указанный в заголовке сообщения (header/sentBy) не соответствует отправителю, указанному в блоке party/[@id="Sender"]	The Sender defined in the header of a message (header/sentBy) doesn't match the sender in the <party/[@id="Sender"]> block	BFMT
NRD028	MSG_RECEIVER_IS_NOT_REPOSITORY	Получатель сообщения не является Репозитарием	The receiver of a message is not a Repository	NARR
NRD029	MA_ALREADY_REGISTERED	Анкета генерального соглашения с указанными сторонами за указанную дату уже зарегистрирована #s	The form of Master Agreement with specified parties for the date is already registered #s	NARR
NRD030	XML_DIFF_IN_CONTRACTS	По результатам сверки с анкетой контрагента выявлены расхождения, препятствующие регистрации вашей анкеты	There are differences found when comparing the counterparty's messages. The form cannot be registered.	NARR
NRD031	RF006_REASON	Отказ в регистрации анкеты №#s от клиента #s, поскольку #s отказал в согласовании анкеты, причина: #s	The form №#s sent on behalf of the client #s is not registered because the client #s has refused to confirm with the reason: #s	RCDP
NRD032	ANKET_SIDE_NOT_FOUND	Отправитель не является уполномоченным информирующим лицом для указанных(-ой) сторон(-ы).	The sender is not authorized a Reporting agent for the specified party(-ies).	NARR
NRD033	CONTRACT_NOT_SUPPORTED	В сообщении указан номер договора #s, не обслуживаемого в данный момент в Репозитории.	There is no Contract #s in the repository's register on a given date	NARR
NRD034	DUBPLICATE_CORRELATION_ID	В Репозитории уже существует входящее сообщение (in_msg_id = #s) с корреляционным идентификатором	The message (in_msg_id = #s) with <correlationId> from the sender #s has already been received by the Repository from the sender #s	NARR

		отправителя #s присланное от отправителя #s		
NRD035	MSD_FUTURE_DATE	В сообщении указана будущая дата отправки	The message contains a future send date	NARR
NRD036	BAD_STATUS_CANCEL_RPLC	Заменяемое/отменяемое сообщение находится в статусе #s. Замена/отмена невозможна	The message that should be replaced/cancelled has the status #s. It is impossible to make replacement/cancellation	NARR
NRD037	RPLC_CANCEL_NOT_FOUND	Заменяемое/отменяемое сообщение не найдено. Замена/отмена невозможна	The message that should be replaced/cancelled is not found. It is impossible to make replacement/cancellation	NEXS
NRD038	RPLC_MESSAGE	В сообщении #s получено требование о замене сообщения	Message #s has got replace request	NARR
NRD039	CONTRACT_NOT_REGISTERED	Указанное в анкете договора генеральное соглашение не зарегистрировано в Репозитории	The Master Agreement specified in the Contract registration form is not registered	NEXS
NRD040	EXPIRY_CANCELLATION	Истек срок исполнения документа	The report execution term has expired	NARR
NRD041	XML_MEMBER_NOT_REGISTERED	Участник с кодом #s типа #s не зарегистрирован в Репозитории.	Party with code #s and code type #s is not the repository's client.	ICAG
NRD042	CLIENT_IS_NOT_EQUAL_SENDER	Отправитель #s не имеет полномочий для подачи сообщения от имени клиента #s. Сообщение зарегистрировано в журнале входящих с номером №#s.	Sender #s has no right to submit messages on behalf of the client #s. The message is registered in the Log with the number N#s.	BINF
NRD043	REPORT_DATA_NOT_FOUND	По параметрам, указанным в запросе, не найдено данных в реестре договоров Репозитария	Messages with specified parameters are not found in the Contracts register	NARR
NRD044	XML_WRONG_SHORT_NAME	Краткое наименование контрагента #s с кодом #s и типом идентификационного кода #s не совпадает с данными в Репозитории	Short name of the party #s with code #s and code type #s does not coincide with the code from the NSD's base of clients.	NARR
NRD045	HREF_CONTAINS_SENDER	Аттрибут href не может содержать значение Sender	"href" attribute cannot have the value "Sender"	NARR
NRD046	SENDER_OF_CM092_IS_NOT_CORRECT	Отправитель сообщения не является информирующим лицом/базовым информирующим лицом по	The sender of the message is not a Reporting Agent/Principal reporting agent for one or multiple	NARR

		одному или нескольким указанным договорам/одному ГС в анкетах CM092/CM094. Невозможно согласовать анкету. Сообщение зарегистрировано в журнале входящих с номером №#s.	contracts/one Master agreement in the reporting forms CM092/CM094. Further processing is not possible.. The message is registered in the Log with the number N#s.	
NRD047	TWO_MANY_ILS	Невозможно однозначно определить информирующее лицо для стороны #s.	It is impossible to identify the Reporting Agent of the party #s	BINF
NRD048	PARTY_NOT_COMPLETE	Список блоков «Party» (блоков, описывающих участников сообщения) не полон. Не хватает блока с id=#s	The block "Party" is incomplete. It has no id=#s	BFMT
NRD049	MA_NOT_REGISTERED_YET	Анкета генерального соглашения еще не зарегистрирована	The Master Agreement form is not registered	NARR
NRD050	CONTRACT_ALREADY_DEREGISTERED	Анкета договора уже deregistered	The contract form has been deregistered	NARR
NRD051	MA_ALREADY_DEREGISTERED	Анкета генерального соглашения уже deregistered	The Master Agreement form has been deregistered	NARR
NRD052	CANC_MESSAGE	В сообщении #s получено требование об отмене сообщения	Message #s has got cancel request	NARR
NRD053	MA_DERI_CONTINUE_NOT_DERI	Невозможно закрыть генеральное соглашение, в рамках которого остаются открытые договоры	There is an attempt to terminate the Master agreement with open Contracts	NARR
NRD054	INCORRECT_SIDE_ORDER	Порядок сторон, указанный при регистрации анкеты договора, не соответствует порядку, указанному при изменении/дерегистрации анкеты договора	The order of the parties specified in the registered contract form does not match the order specified in the amendment/deregistration message	NARR
NRD055	MA_STATUS_DERIVED	Генеральное соглашение #s, указанное в анкете договора, отменено	The Master Agreement #s specified in the contract form was cancelled	NARR
NRD056	MA_STATUS_TERMINATED	Расторгнуто репозитарное соглашение по обслуживанию генерального соглашения #s, указанного в анкете договора	The Repository Services Agreement for the specified Master Agreement #s was terminated	NARR

NRD057	INFORMATOR_OF_CM092_IS_NOT_CORRECT	Указанная в сообщении согласующая сторона не является ни стороной, ни БИЛом, ни ИЛом по договорам, указанным в отчёте. Сообщение зарегистрировано в журнале входящих с номером №#s.	The receiver of a message is neither a party, nor a Principle Reporting Agent/Reporting Agent for defined contracts. The message is registered in the Log with the number N#s.	BINF
NRD058	CONTRACT_DONT_BELONGS_TO_MASTER	Договор с номером #s не принадлежит Генеральному соглашению с номером #s.	The Contract #s is not under the Master Agreement #s	NARR
NRD059	INVALID_BLOCK_HEADER	Заполнение блока «Header» сообщения не соответствует правилам заполнения сообщений Репозитория.	The block <header> does not comply with the rules of message creation	BFMT
NRD060	RIGHT_TYPE_EMPTY	Поле "Тип отчетности информирующего лица" должно быть заполнено	The field "Reporting party role type" should be filled out	NARR
NRD061	- XML_NO_VERSION_FORMAT_DICT	Сообщение не соответствует ни одному формату сообщений Репозитория	The message does not match any repository message format	NARR
NRD062	REQUEST_AGREEMENT_CANCEL	Запрос на согласование параметров анкеты с №#s отменён, поскольку клиент #s отменил/заменял свою анкету	The request for approval of the Reporting form №#s is cancelled because the Client #s has cancelled/replaced the Reporting form	NARR
NRD063	CORRELATION_NOT_MATCH_MASK	Поле <correlationId> не соответствует маске ввода	The field <correlationId> does not comply with the mask	BFMT
NRD064	RPLC_MSG_TYPE_S_IS_NOT_COMPATIBLE	Тип заменяемого сообщения #s с номером #s не соответствует типу сообщения замены #s с номером #s	The type #s of the message #s to be replaced does not correspond to the type #s of the replaceable message #s	NARR
NRD065	CONTRACT_WITH_NUM_ALREADY_DEREGISTRED	Анкета договора #s уже deregistered	The contract form #s has already been deregistered	NARR
NRD066	RIGHT_TYPE_NOT_EXISTS	Тип договора #s не найден в справочнике типов договоров	The contract type #s is not found in the Product Type reference guide	NARR
NRD067	BAD_CONSTANT_FOR_NOREPORTING	Неверная константа #s для идентификации стороны, не предоставляющей отчетность	The identifier of the party which does not report has invalid value #s	NARR
NRD069	INVALID_TRADERPOSITORY_PERSON	Сторона, указанная в блоке «Party» с атрибутом id =	The party with id = TradeRepository is not the Repository	NARR

		TradeRepository не является Репозитарием		
NRD070	TOO_MANY_RIGHT_TYPE_FOR_INFORMATION_SIDE	Для стороны #s указано несколько информирующих лиц с одинаковым типом прав #s	Several Reporting agents are indicated for the party #s with the same role type #s	NARR
NRD071	XML_WRONG_ADD_INFO	Неверное указание сотрудников, осуществивших ввод и сверку	The specified employee is not authorized to submit and reconcile messages	NARR
NRD072	MA_SIDES_MUST_DIFFERENCE	Стороны по генеральному соглашению не могут совпадать или должны быть указаны клиенты сторон	The Master Agreement should have two different parties or the clients of the parties should be specified.	NARR
NRD073	SIDE_HAS_NOT_PERMISSION	У стороны #s закончились полномочия на предоставление информации по договору #s. Сообщение зарегистрировано в журнале входящих с номером №#s.	The party #s has no right to submit information on the Contract #s. The message is registered in the Log with the number N#s.	NARR
NRD074	CANC_RPLC_NOT_SET	Не указано сообщение для отмены/замены	The message for replacement/cancellation is not specified	NARR
NRD075	BAD_DATE_CANC_RPLC	Дата, указанная для отменяемого сообщения, не совпадает с датой сообщения, найденного для отмены/замены	The date specified for the message to be cancelled does not coincide with the date of the message to cancel / replace	NARR
NRD076	BAD_MSG_ACTION_CANC_RPLC	Назначение, указанное для отменяемого сообщения, не совпадает с назначением сообщения, найденного для отмены/замены	The purpose of the message to be canceled does not coincide with the purpose of a message to cancel / replace	NARR
NRD077	CONTRACT_STATUS_NOT_FOUND	Статус с кодом #s не найден в справочнике состояний анкет договоров	The status #s is not found in the contract's forms status reference guide	NARR
NRD079	MATCH_METHOD_EMPTY	Поле «Способ сверки информации по договорам» имеет некорректное значение	The field "Contract parameters reconciliation type" has invalid value	NARR
NRD080	INFORMATOR_NOT_FOUND	Не удалось определить информирующее лицо по договору с типом #s для стороны #s	Unable to identify Reporting agent with contract type #s for the party #s	NARR
NRD081	NOT_FOUND_ACTIVE_CONTRACTS	По заданным параметрам не удалось найти ни одной анкеты активного договора	There is no active contract form with given parameters	NARR



NRD082	TWO_MANY_ILS_WITH_CONTRACT_TYPE	Для информирующего лица с типом договора #s и стороной #s не допускается наличие других информирующих лиц по данному типу договора	No other Reporting agents are allowed when Reporting agent is appointed for contract type #s and party #s	NARR
NRD083	TRADEREF_LEN_LIMIT	Значение идентификатора генерального соглашения/договора, присвоенного стороной #s, не может превышать длину 35 символов	The value of the field "Trade identifier" (tradeId) of the Master Agreement/contract assigned by the party #s should not be longer than 35 characters	NARR
NRD084	MEMBER_EQUAL_REPOSITORY	Недопустимо указывать в качестве #s персону: #s #s	It is impossible to indicate as #s: #s #s	NARR
NRD085	XSD_ERROR_VALIDATION_PREVIOUSERS	Репозиторий перешёл на новую версию форматов. Содержание вашего сообщения не соответствует новой версии. Ошибка валидации входящего сообщения: #s	The repository has moved to the new messages specification format. The submitted message does not correspond to the new format. Validation error of incoming message: #s	NARR
NRD086	INCORRECT_HREF_VALUES	В сообщении неверно заполнены «ссылка на участника, в отношении которого запрашивается отчет» или «ссылка на участника – контрагента»	The incorrect values for the href attributes or the fields «Party1» and «Party2» doesn't filled.	NARR
NRD087	INVALID_NOT_REPORTING_CODE	Значение кода #s не соответствует маске ввода	The specified partyID code #s doesn't match with a mask.	NARR
NRD088	IN_MSG_SENDER_MUST_BE_REPOSITORY	Отправитель сообщения должен являться Репозитарием	Only the repository can be a sender of the message	NARR
NRD089	MA_FOR_ID_NOT_FOUND	Генеральное соглашение с регистрационным номером #s не существует	Master Agreement with the number #s does not exist	NARR
NRD090	XML_DIFFERENCE	В результате сравнения xml документов были выявлены расхождения	There are differences found when comparing xml documents	NARR
NRD091	MA_SIDES_AND_CLIENTS_MUST_DIFFERENCE	Стороны по генеральному соглашению и их клиенты не могут совпадать	Master Agreement parties cannot be the same as their clients	NARR
NRD092	MA_TRADEREF_LEN_LIMIT	Значение идентификатора генерального соглашения, присвоенного стороной #s, не может превышать длину 35 символов	The identifier of the Master Agreement (tradeId) assigned by the party #s can be no longer than 35 characters	NARR

NRD093	CONT_TRADEREF_LEN_LIMIT	Значение идентификатора договора, присвоенного стороной #s, не может превышать длину 35 символов	The identifier of the contract (tradeId) assigned by the party #s can be no longer than 35 characters	NARR
NRD094	RECONCILIATION_TYPE_EMPTY	Поле «Условия согласования параметров договора» должно быть заполнено	"Trade parameters reconciliation type" should be filled out	NARR
NRD095	MSG_CANCREPL_ITSELF	Сообщение не может отменить/заменить само себя	The message cannot be cancelled/replaced by the same message	NARR
NRD096	CORREL_MEMBER_CODE_NOT_EQUAL_SENDBY	Код клиента из поля «correlationId» #s не соответствует коду отправителя #s	The code specified in correlationId #s does not match the sender's code #s	NARR
NRD097	REPORTING_TYPE_MUST_BE_ALL	Поле «Тип отчетности информирующего лица» для стороны #s должно быть #s	The field "Reporting party role type" for the party #s should have the value #s	NARR
NRD098	XML_ANCKET_SIDE_S_NOT_COMP_WITH_SENDER	Ни одна из сторон договора не связана с отправителем сообщения	Neither party is associated with the sender of the message	NARR
NRD099	XML_INFORMATOR_IS_NOT_FOUND	Не удалось определить информирующее лицо стороны #s по коду #s.	The Reporting agent of the party #s cannot be identified by the code #s	NARR
NRD100	AGREEMENT_DATE_IS_NOT_COMING	Для участника "#s" еще не наступила дата заключения Репозитарного соглашения. Сообщение зарегистрировано в журнале входящих с номером №#s.	The repository service agreement with the participant #s has not been concluded yet. The message is registered in the Log with the number N#s.	NARR
NRD101	AGREEMENT_CANCEL_DATE_IS_COMING	Для участника "#s" наступила дата завершения репозитарного соглашения. Недопустимо указывать репозитарный код отличный от NONREF.	The repository service agreement with the participant #s has been terminated. It is incorrect to specify the repository's code other than NONREF.	NARR
NRD102	XML_CONTRACT_NOT_FOUND	Невозможно определить генеральное соглашение, соответствующее присланной информации по договору	Unable to find the Master agreement corresponding to the received contract data	NARR
NRD103	BAD_CONTRACT_LINK	Неверно указана ссылка на сообщение для регистрации генерального соглашения	Wrong link to the corresponding Master Agreement form	NARR

NRD104	CONTRACT_LING_PROCESS_DENIED	В анкете договора присутствует ссылка на сообщение с анкетой генерального соглашения, в обработке которого отказано	The contract form refers to the Master Agreement form which was rejected	NARR
NRD105	CONTRACT_DEREGISTERED	Договор deregistered. Внесение изменений невозможно.	The contract is deregistered. The amendment is impossible.	NARR
NRD106	Duplicate_Msg_Id	В Репозитории уже существует входящее сообщение (in_msg_id = #s) с идентификатором отправителя #s присланное от отправителя #s	The message (in_msg_id = #s) with the sender's #s ID received from the sender #s already exists	NARR
NRD107	FIELD_MUST_NOT_BE_EMPTY	Поле #s должно быть заполнено	The field #s must be filled out	NARR
NRD108	TWO_MANY_ILS_FOR_CONTRACT	Невозможно однозначно определить информирующее лицо для типа договора #s.	It is impossible to identify the Reporting Agent of the party #s	NARR
NRD109	NON_REPO_CODE_IS_NOT_EMPTY	Код клиента #s, не предоставляющего отчетность, не должен быть пустым	The code of the client #s which is not obliged to report should be specified	NARR
NRD110	INVALID_NON_REPORTING_VALUE	Некорректное значение поля «Сторона, не обязанный предоставлять информацию в Репозиторий» для клиента #s - #s	Invalid value for the field <Unwillingreportingparty> for the client #s - #s	NARR
NRD111	INVALID_NON_REPORTING_FOR_RESIDENT	Клиент #s - #s не может быть указан в поле «Сторона, не обязанный предоставлять информацию в Репозиторий», т.к. он является резидентом	Invalid value for the field <Unwillingreportingparty> because the client #s - #s is the Russian entity	NARR
NRD112	NON_REPORTING_CLIENT_NOT_EQUAL_INF	Для стороны #s, указанной в поле «Сторона, не обязанный предоставлять информацию в Репозиторий», БИЛ должен совпадать с данной стороной	The party #s which is indicated in the field <Unwillingreportingparty> should have the same Principle Reporting Agent	NARR
NRD113	NON_REPORTING_INF_EQUAL_NONREF	Для стороны #s, указанной в поле «Сторона, не обязанный предоставлять информацию в Репозиторий» код БИЛа должен быть равен NONREF	The Principle Reporting Agent of the party #s which is indicated in the field <Unwillingreportingparty> should be defined as NONREF	NARR
NRD114	INCORRECT_ILL_PARTY_SIDE	Некорректное значение поля «Сторона Генерального соглашения» = #s в блоке информирующих лиц, в случае если сторона #s	Invalid value for the field <masterAgreementParty> #s if the party #s is not willing to report	NARR

		отказалась предоставлять отчетность		
NRD115	INCORRECT_ILL_CODE	Код информирующего лица, поданного от стороны #s должен быть #s	The code of the Reporting Agent of the party #s should be defined as #s	NARR
NRD116	CONTRAGENT_IL_NOT_FOUND	ИЛ #s - #s стороны #s, отказавшейся от предоставления отчетности, должен совпадать с ИЛОм противоположной стороны (иметь тот же код и наименование)	The Reporting Agent #s - #s of the party #s which is not willing to report should coincide with the Reporting Agent of its counterparty (should have the same code and name).	NARR
NRD117	XML_NO_VERSION	Сообщение не содержит указания на версию формата	The version of the format is not defined in the message	NARR
NRD118	XML_NO_ACTION	Сообщение не содержит указания на действие	The message does not contain the action	NARR
NRD119	XML_NO_INCOMING	Сообщение такого типа не может быть входящим для Репозитария	Invalid type of incoming message	NARR
NRD120	XML_NARRATIVE_DENIED_FOR_ID	Для идентификатора с типом #s не допускается заполнение поля значением <NONREF>	In case of ID with type #s the field with <NONREF> value should not be filled	NARR
NRD121	XML_NARRATIVE_MANDATORY_FOR_ID	Для идентификатора с типом #s поле <narrative> должно быть заполнено	In case of ID with type #s the field <narrative> should be filled	NARR
NRD122	XML_MEMBER_TO_MANY_REGISTERED	Для участника с кодом #s типа #s существует несколько записей в Репозитарии	There are several entries in the repository for the party with code #s and code type #s	NARR
NRD123	XML_MEMBER_NOT_FOUND	По указанным идентификаторам не удалось определить клиента Репозитария	No client found for given parameters	NARR
NRD124	ID_TYPE_NOT_FOUND	Тип кода #s отсутствует в справочнике типов кодов	Code type #s is not found in the reference guide	NARR
NRD125	XML_BAD_LINK_ON_OUT_MESSAGES	В сообщении указана ссылка на несуществующий связанный документ	The message contains a link to the nonexistent related document	NARR
NRD126	XML_NOT_FOUND_LINK_ON_OUT_MESSAGES	В сообщении не указана ссылка на связанный документ	The message should contain a link to the related document	NARR
NRD127	XML_BAD_LINK_DOCUMENT	Указан некорректный связанный документ	Invalid related document	NARR

NRD128	BAD_CONTRACT_NUMBER	В сообщении на регистрацию анкеты генерального соглашения/договора номер Генерального соглашения/договора должен быть указан как NONREF	The Master Agreement/contract ID must be defined as NONREF	NARR
NRD129	ABORTED_MSG_HAS_INVALID_STATE	Отменяемое сообщение уже исполнено/отменено	It is impossible to cancel a message that has been executed/cancelled	NARR
NRD130	SAME_MA_ALREADY_REGISTER	В регистрации анкеты генерального соглашения отказано, т.к. ранее, сообщением № #s, была зарегистрирована анкета генерального соглашения № #s, совпадающая с предоставленной по ключевым полям или клиентским номерам	The message cannot be registered because in previous message № #s the Master Agreement form № #s with the same parameters and client IDs has been registered	NARR
NRD131	SAME_CONTRACT_ALREADY_REGISTER	В регистрации анкеты договора отказано, т.к. ранее сообщением № #s была зарегистрирована анкета договора № #s совпадающая с предоставленной по ключевым полям или клиентским номерам	The message cannot be registered because in previous message № #s the Contract № #s with the same parameters and client IDs has been registered	NARR
NRD132	COUNTRY_CODE_MUST_BE_FILLED	Поле "Код страны" должно быть заполнено	The field "Country code" should be filled out	NARR
NRD133	COUNTRY_CODE_INVALID_VALUE	Поле "Код страны" содержит некорректное значение #s	Invalid value of the field "Country code" #s	NARR
NRD134	INVALID_AGENT_FOR_NON_REPORTING_SIDE	При изменении генерального соглашения: ИЛ не отчитывающейся стороны должен быть либо равен ИЛу отчитывающейся стороны, либо оставаться, как в зарегистрированном генеральном соглашении, при условии, что данный ИЛ имеет действующее репозитарное соглашение.	The Reporting Agent for Unwilling reporting party should be set as Reporting Agent for reporting party, or remain unchanged, if Reporting Agent still a repository's client, while changing Master Agreement	NARR
NRD135	FORBIDDEN_NON_REPORTING_FOR_CLIENT	Указанный для контрагента #s ИЛ #s не может являться стороной, отказавшейся от предоставления сведений в Репозитарий.	The counterparty #s with the Reporting Agent #s couldn't be as Unwilling reporting party	NARR
NRD136	INCORRECT_PAYER_SIDE	Сторона #s #s, отказавшейся от предоставления сведений в Репозитарий, не может быть плательщиком, т.к.	The Unwilling reporting party #s #s couldn't be specified as a payer. Only	NARR

		только сторона предоставляющая отчетность, может оплачивать услуги Репозитария в случае одностороннего репортинга.	the reporting party could be as a payer.	
NRD137	ED_CONTRACT_FOR_COUNTERPARTY_NOT_FOUND	У ИЛа согласующей стороны #s нет анкеты ЭДО, сообщение #s, #s.	The Principle Reporting Agent/Reporting Agent #s doesn't have EDT profile. The message #s, #s.	NARR
NRD138	PERO_CODE_NEEDED_FOR_REPOSITORY_CLIENT	#s является клиентом Репозитария. Для идентификации стороны генерального соглашения /договора требуется указание репозитарного кода #s	#s is a repository's client. To identify the side of the Master Agreement/Contracts required repository's code #s.	NARR
NRD139	LEI_CLIENT_WITH_SEVERAL_REPOSITORY_CODES	Код LEI #s - #s является клиентом Репозитария и имеет несколько репозитарных кодов. Для идентификации участника также требуется указание репозитарного кода	The client with LEI code #s and short name #s has more than one repository's code. To identify the side required specified the repository's code too.	NARR
NRD140	CODE_TYPE_NOT_FOUND_IN_XML_BLOCK	В XML блоке не найден код с типом #s, XML блок: #s	In the XML block cannot find a code with type #s, XML block: #s	NARR
NRD141	TOO_MANY_CODES_TYPE_IN_XML_BLOCK	В XML блоке содержится несколько кодов с типом #s, XML блок: #s	The XML block contains several codes with type #s, XML block: #s	NARR
NRD142	INVALID_CHECK_ADD_CODE	Код #s, указанный в тэге partyId не совпадает с типом кода #s у участника #s #s.	The ID #s, specified in partyId tag, doesn't match with type of ID #s for party #s #s	NARR
NRD143	INVALID_ADD_CODE_FOR_MEMBER	Для участника/клиента стороны #s #s указан недопустимый код #s.	For the party/party's client #s #s specified an invalid ID #s	NARR
NRD144	INVALID_ADD_CODE_FOR_PARTY_ID	В XML блоке указан недопустимый для идентификации участника код #s. XML блок #s.	In the XML unit specified an invalid ID #s for Party identification. XML unit #s.	NARR
NRD145	INVALID_PARTYID_VALUES	В XML блоке указаны некорректные значения элементов partyId. XML блок: #s	The incorrect partyId element's values specified in the XML unit. XML unit: #s	NARR
NRD146	MANDATORY_TYPE_CODE_NOT_SPECIFIED	В XML блоке, в элементе partyId отсутствует	A required type of ID #s is missing in the element	NARR

		обязательный тип кода: #s. XML блок: #s	partyId of the XML unit. XML unit: #s	
NRD147	INVALID_COUNT RYCODE_AND_RE SIDENT	Для клиента #s #s, являющегося #s указан некорректный код страны #s	For the Client #s #s, who specified as #s, found an incorrect country code #s	NARR
NRD148	INVALID_COUNT RYCODE_AND_CL IENTCODE	Для кода клиента #s указан некорректный код страны #s	For the client ID #s, specified an incorrect country code #s	NARR
NRD149	LEI_CODE_NOT MATCH_WITH_RE P_CODE	Указанный в анкете код LEI/SNILS #s, не соответствует указанному репозитарному коду #s, для участника s#.	The specified LEI code #s don't match with repository's code #s, for party #s.	NARR
NRD150	NAME_SPACE_PR EFIX_MUST_BE_I N_ROOT_TAG	Некорректный формат. Префикс пространства имен #s не содержится в корневом тэге	The wrong format. Root tag does not contain the prefix #s	NARR
NRD151	INVALID_BLOCK_ TRADEHEADER	Заполнение блока TradeHeader сообщения не соответствует правилам заполнения сообщений репозитария	The block <TradeHeader> does not comply with the rules of message creation	NARR
NRD152	DOCUMENT_ALRE ADY_CONFIRMED	Документ уже подтвержден	The document has already been confirmed	NARR
NRD153	CONTRACT_SIDE S_NOT_COMPARE _ANKET_SIDES	Стороны договора не соответствуют сторонам генерального соглашения	Parties of the Contract don't correspond to the parties specified in the Master Agreement	NARR
NRD154	MEMBER_NOT_E QUAL_SIDES	Контрагент с кодом #s, указанный в анкете, не соответствует ни одной из сторон из списка указанных в сообщении сделок	The counterparty with code #s does not match any party of the contract	NARR
NRD155	PARTY_NAME_MU ST_BE_EMPTY_F OR_NONREF	Поле #s должно быть пустым для кода со значением = NONREF	The #s field should be left blank, for the code value = NONREF	NARR
NRD156	MSG_TYPE_NOT_ FOUND	Тип сообщения #s отсутствует в справочнике типов сообщений	The message type #s is missing in reference message types	NARR
NRD157	MSG_TYPE_NOT_ DEFINE	Сообщение с корневым тэгом #s не поддерживается системой	A message with the root tag #s not supported	NARR
NRD158	CME_CSV_IS_NO T_SET	К сообщению не приложен файл с отчетом для CME ETR	The report file for CME ETR is not attached	NARR

NRD159	XML_CME_CSV_NOT_FOUND	В сообщении не указано имя файла – отчета для CME ETR	The message does not contain the name of the report file for CME ETR	NARR
NRD160	THE_RULE_SENDING_TO_CME_NOT_SET	В сообщении не установлено правило отправки сообщения в CME ETR	The message does not contain the rule of sending report for CME ETR	NARR
NRD161	LEI_CODE_MUST_NOT_BE_EMPTY	В анкете отсутствует один или оба элемента partyId для участника #s. Указание 2-х элементов partyId (Репозитарный код и код LEI), для участника обязанного предоставлять отчетность в Репозитарий является обязательным.	One or both of the partyId elements for Party #s is missing (Repository's code and LEI code), but it should be mandatory specified for Party who are obligated to submit reports.	ICAG
NRD162	DOC_TYPE_NOT_DEFINE	Тип документа #s не поддерживается системой	A document type #s not supported	NARR
NRD164	INCORRECT_PARTY_ID	Указанный идентификатор <partyId> для участника #s не соответствует идентификатору, указанному в ранее зарегистрированной Анкете договора/ГС.	The identifier <partyId> for Party #s does not match the identifiers specified in the registered Trade/ Master agreement	BFMT
NRD165	INVALID_CONTRACTS	Неверный перечень договоров. Все указанные в Анкете договоры, должны быть зарегистрированы в рамках одного генерального соглашения	An Incorrect contracts list. All specified contracts must be registered under same master agreement.	BFMT
NRD166	INCORRECT_MASTER_FOR_AMMENDMENT	Номер генерального соглашения по договорам указанный в анкете на изменение отличается от номера генерального соглашения указанного в ранее зарегистрированной анкете.	The Master Agreement number of contracts specified in the amendment form doesn't match with the Master Agreement number of the previously registered form.	BFMT
NRD167	INCORRECT_REPORT_PARTY	Сторона, указанная в блоке #s, не соответствует стороне, от имени которой было направлена сообщение.	The reporting party specified in the block #s doesn't match with the Party's name from whose side the message was sent.	BFMT
NRD168	DUBPLICATE_TRADEID	Указание нескольких договоров с одинаковым номером, недопустимо.	It is unacceptable to specify the multiple contracts with the same number.	BFMT
NRD169	INCORRECT_AS_OF_DATE_FOR_CM092_CM094	Указано некорректное значение для поля <asOfDate>/<valuationDate>. Регистрация/внесение	Specified an incorrect value for the field <asOfDate>/<valuationDate>. Registrations/Amendments	BFMT



		изменений в анкету отчета CM092/CM094 допускается только в одном отчетном периоде.	for the form of report CM092/CM094 is only allowed in one reporting period.	
NRD170	REACH_LIMIT_MESSAGE	Размер сообщения превышает максимально допустимый размер (15 мегабайт). Пожалуйста, удалите из XML сообщения лишние символы между полями (пробелы, переводы строк, и т.п.) или разделите сообщение на несколько.	A Message size reached the maximum allowed limit (15 mb). Please remove excess characters between fields (spaces, line breaks, etc.) from the XML file, or separate the message on several parts.	BFMT
NRD171	INCORRECT_NONREF_FOR_TRADEID	Клиентский идентификатор сообщения/сделки отсутствует, или имеет значение NONREF.	The client's identifier for the message/trades is missing or has an invalid value (NONREF).	BFMT
NRD172	DUBPLICATE_ROWS_FOR_CM082	В пакет сделок сообщения присутствуют один или несколько одинаковых идентификаторов сделок. Список сделок: #s	There are one or several duplicates of trade identifiers. List of duplicates: #s	BFMT
NRD173	INVALID_SENDER_CM082	Отправитель #s не имеет полномочий для подачи сообщений по форме #s.	Sender #s has no right to submit messages with #s form.	BFMT
NRD174	REPORT_MSGDATA_NOT_FOUND	По параметрам, указанным в запросе, не найдено данных в журнале учета входящих сообщений Репозитория	Messages with specified parameters are not found in the Messages register	NARR
NRD175	INVALID_PERIOD	В запросе на выписку указан недопустимый период.	An Invalid period for the statement request.	BFMT
NRD176	SAME_REPORT_ALREADY_REGISTERED	В регистрации анкеты отчета отказано, т.к. ранее сообщением № #s была зарегистрирована анкета отчета № #s совпадающая с предоставленной по дате событий и клиентским номерам.	The message cannot be registered because in previous message № #s the form of report № #s with the same valuation dates and client IDs has been registered	NARR
NRD177	INCORRECT_VALUATIONDATE_FOR_CM092_CM094	Недопускается указание несколько одинаковых значений для полей <valuationDate> в одной анкете отчета CM092/CM094.	Do not allow to specify multiple same values for the field <valuation Date> in the one form of report CM092 / CM094.	BFMT
NRD178	INCORRECT_ADDITIONAL_CODE_FOR_PARTYID	Дополнительный идентификатор участника #s, указанный в ранее зарегистрированной анкете, не соответствует	Additional Identifier #s, specified in the previously registered form does not match with the ID in the database #s, for the	BFMT

		идентификатору в базе репозитория #s, для участника с репозитарным кодом #s.	member with repository's identifier #s.	
NRD179	UTI_INCORRECT_VALUE	Указано некорректное значение кода UTI (#s). Возможные причины: превышен лимит символов (52), в репозитории уже имеется сообщение с таким кодом, по коду не найдена связанная анкета.	Specified an incorrect UTI code (#s). Possible causes: exceeded the limit of 52 characters, in the Repository already exists a message with the code, not found a related document by the code.	NARR
NRD180	RA_DUPLICATE	Указанные в анкете информирующие лица не могут повторяться.	The specified Reporting Agents may not be duplicated.	NARR
NRD181	FORM_CM016_DUPLICATE	Заявление о назначении информирующих лиц от участника #s уже зарегистрировано в Репозитории. Для внесения изменений по информирующим лицам необходимо подать изменение к имеющейся анкете.	A form of Reporting Agents assignment for the Client #s already registered in the Repository. To make changes, please submit an amendment to an existing form.	
NRD182	TRANSF_AND_EXECUT_ERROR	Указано некорректное значение поля <TransfersAndExecution>, при определении функций ИЛ для участника - #s. Значение «true» может быть установлено, только если в полномочия ИЛ так же входит отчетность по типам документов CM010 или CM015.	Specified an incorrect value of the field <Transfers And Execution>, during determination the functions of Reporting Agent - #s. The value «true» may be specified only if the reporting authority also cover document types like CM010 or CM015.	NARR
NRD184	MARK_TO_MARKET_ERROR	Указано некорректное значение поля <MarkToMarketValuation>, при определении функций ИЛ для участника - #s. Значение «true» может быть установлено, только если в полномочия ИЛ не входит отчетность по типам документов CM010 или CM015.	Specified an incorrect value of the field <MarkToMarketValuation>, during determination the functions of Reporting Agent - #s. The value «true» may be specified only if the reporting authority exclude document types like CM010 or CM015.	NARR
NRD185	XML_CSA_NOT_FOUND	По указанному идентификатору #s не удалось найти зарегистрированной в репозитории анкеты договора, заключенного в	Registered CSA not found with specified repository's identifier.	NARR

		целях обеспечения исполнения обязательств..		
NRD186	INCORRECT_CSA PARTY_TRADEID	Указанный в анкете договора клиентский идентификатор договора заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств #s, не соответствует идентификатору в зарегистрированной анкете договора заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств.	The specified client's identifier in the contract form for the report #s does not match with the identifier in the registered CSA.	NARR
NRD187	INVALID_AUTOEX ECUTION	Для возможности автоматического закрытия договора необходимо указать значения для полей <startAgreementDate> и <endAgreementDate>	To enable the automatic execution report option of the contract, must specify values for the fields <startAgreementDate> and <endAgreementDate>	NARR
NRD188	SINGLE_CONTRA CT_TAG_INCORR ECT	Одновременное указание признака <nonStandardTerms> и ссылки на генеральное соглашение не допускается.	Simultaneous specify <nonStandardTerms> field and link for Master Agreement is not allowed	NARR
NRD189	UTI_MANDATORY	Указание кода UTI является обязательным для данного типа продукта.	Specifying UTI code is required for this type of product.	NARR
NRD190	AUTHORITY_DUB LICATES	Некорректно указаны полномочия для одного или нескольких информирующих лиц: #s	Specified an incorrect authority for one or several Reporting Agents: #s	NARR
NRD191	INCORRECT_INF ORMER	Участник #s не является информирующим лицом для стороны #s	The member #s is not Reporting Agent for the Party #s	NARR
NRD192	INITIAL_MSG_NO T_FOUND	По входящему сообщению с номером #s и типом #s не удалось найти данных об информирующем лице.	Could not find any information about Reporting Agent, by an incoming message with the number #s and type #s	NARR
NRD193	REQUEST_ALREA DY_REGISTR	Подтверждение/отказ по запросу на согласование полномочий информирующего лица с кодом #s для клиента с кодом #s уже зарегистрировано.	Confirmation / rejection of a request for approval of authority Reporting Agent with code #s for the client with code #s has already been registered.	NARR
NRD194	INCORRECT_UTI_ PARTY	Недопустимое значение LEI кода для стороны формирующей код UTI	Invalid LEI for UTI generating party	NARR

NRD195	NOT_REPORTING_PARTY_ERROR	Указанные в анкете стороны, обе отказались представлять отчетность в Репозиторий. Информация не может быть зарегистрирована.	Specified in the form Parties, both not willing to report in the Repository. Information can not be registered.	NARR
NRD196	INCORRECT_PERMISSION_FOR_SENDER	Отправитель не является уполномоченным информирующим лицом по договору #s.	The sender is not authorized a Reporting agent for the contract #s.	NARR
NRD197	CONFIRMATION_INFORMER_NOT_FOUND	По договору #s, не удалось определить согласующее информирующее лицо.	Could not find authorized confirmation Reporting agent for the contract #s.	NARR
NRD198	CONFIRMATION_INFORMER_MORE_THAN_ONE	Не удалось однозначно определить согласующее информирующее лицо.	Could not uniquely identify authorized confirmation Reporting agent.	NARR
NRD199	FLC_WRONG_RELATIONS_VALUES_2	ФЛК. Неверная хронологическая последовательность дат. Корректные значения должны соответствовать правилу: #s <= #s	FLC. Invalid chronological dates sequence. Valid values must conform to the rule: #s <= #s	BFMT
NRD200	FLC_WRONG_RELATIONS_VALUES_3	ФЛК. Неверная хронологическая последовательность дат. Корректные значения должны соответствовать правилу: #s <= #s <= #s	FLC. Invalid chronological dates sequence. Valid values must conform to the rule: #s <= #s <= #s	BFMT
NRD201	FLC_WRONG_RELATIONS_VALUES_4	ФЛК. Неверная хронологическая последовательность дат. Корректные значения должны соответствовать правилу: #s <= #s <= #s <= #s	FLC. Invalid chronological dates sequence. Valid values must conform to the rule: #s <= #s <= #s <= #s	BFMT
NRD202	FLC_WRONG_CURRENCY	ФЛК. Некорректный тип валюты, либо последовательность её указания для первой или второй части сделки.	FLC. Incorrect currency types or their specific sequence for the first or second part of the deal.	BFMT

NRD203	FLC_POSITIVE_V ALUE	ФЛК. Значение поля #s должно быть положительным.	FLC. The value for the field #s should be positive.	BFMT
NRD204	INVALID_PARTYN AME_	ФЛК. Не допускается указание NONREF для поля <partyName>.	FLC. It is not allowed to specify NONREF for the <partyName>.	BFMT
NRD205	FLC_ALREADY_C ONNECTED	Для участника – #s - #s, сервис ФЛК уже подключен.	The FLC service already has been connected for the party - #s - #s.	BFMT
NRD206	FLC_ALREADY_DI SCONNECTED	Для участника – #s - #s, отсутствует подключенный сервис ФЛК.	There's not connected FLC service for the party – #s - #s,	BFMT
NRD207	FLC_RATE_DELTA	ФЛК. Указанная ставка #s, не соответствует ставке, рассчитанной по суммам валют платежей.	FLC. The specified rate #s does not match with the calculated rate by payment currency amounts.	BFMT
NRD208	FLC_INVALID_PR ODUCT_TYPE	ФЛК. Указан недопустимый тип продукта #s для данного типа сообщения.	FLC. Specified an invalid product type #s for that message type.	BFMT
NRD209	FLC_INCORRECT_ BUYERSELLER_	ФЛК. Ошибка в указании покупателя/продавца либо плательщика/получателя платежа.	FLC. There is an error in the specification of buyer/seller, or payer/reciever.	BFMT
NRD210	FLC_INVALID_ELE MENT	ФЛК. Указанный элемент: #s не используется в формате сообщений Репозитория	FLC. The specified element: #s is not used in the Repository's message format	BFMT
NRD211	UTI_INVALID_SI MBOLS	При указании кода UTI -#s, были использованы недопустимые символы.	An invalid symbols was specified in UTI code – #s.	BFMT

NRD212	CORRCTION_NOT_CLOSE_FORM	Указанный в анкете тип изменения «коррекция» возможен только для закрытых анкет.	Specified «correction» type is possible only for closed report forms.	BFMT
NRD213	AMENDMENT_NOT_OPEN_FORM	Указанный в анкете тип изменения «редактирование» возможен только для открытых анкет.	Specified «amendment» type is possible only for open report forms.	BFMT
NRD214	INVALID_DATE_FOR_CORR	Превышен допустимый период (#s дня с даты закрытия), для внесения корректировок по закрытым анкетам.	Exceeded the permissible period (#s days from deregistration date), for making corrections to deregistered forms.	BFMT
NRD215	INVALID_CORRECTION	В анкете балк-отчета были изменены общие для всех сделок поля:#s. При внесении таких изменений, перечень сделок должен соответствовать тому, что был зарегистрирован ранее.	The bulk-report form contain changes in main fields: #s. it is only possible if the list of deals is the same like in previously registered form	BFMT
NRD216	CONT_ADDCODE_LEN_LIMIT	Значение дополнительного кода стороны #s, не может превышать длину #s символов.	The value of additional code specified for the party #s can be no longer than #s characters	NARR
NRD217	BULK_TRADE_NOT_FOUND	Сделка с UTI кодом #s не найдена в изменяемом сообщении. При изменении балк-отчета перечень сделок должен соответствовать тому, что был зарегистрирован ранее.	The deal with UTI = #s has not been found in the original bulk-report. It's only possible to correct bulk-report if the list of deals is the same as in the previously registered form.	BFMT
NRD218	INVALID_DATE_FOR_STATUS	Превышен допустимый период (#s дня с даты закрытия), для изменения статуса по закрытым анкетам.	Exceeded the permissible period (#s days from deregistration date), for status change in deregistered forms.	BFMT
NRD219	BAD_STATUS_CHANGE	Указан некорректный статус #s для данного сообщения. Изменение на указанный статус невозможно	The status #s is incorrect for the current message. It is impossible to set the status	BFMT

NRD220	STATMNT_RQST_BAD_PARAMETER_S	Для выписки указан некорректный набор параметров в statementDetails	The parameters in StatementDetails section are not correct for the statement request	BFMT
NRD221	AUTO_EXECUTION_REJECT	Не допускается указание элемента для автоматической deregistration договора (automaticExecution = Y) при двухстороннем согласовании сообщения	Not permitted to indicate the element for the automatic deregistration of the contract (automaticExecution = Y) in case of two-side matching process	BFMT
NRD222	CORR_NOT_ALLOWED	Внесение корректирующей записи для анкеты CM092/CM094 не предусмотрено	Specified «correction» type is not allowed for CM092/CM094	BFMT
NRD223	INVALID_TAG_FOR_AMENDMENT	В сообщении на изменение анкеты запрещено указывать атрибут xsi:type="TradeAmendmentContent" в тэге amendment	Not permitted to use xsi:type="TradeAmendmentContent" element in the amendment tag	BFMT
NRD224	STATMNT_RQST_INVALID_TYPE	Для выписки указан некорректный statement type	The statement type is invalid for the statement request	BFMT
NRD225	CONTRACT_IN_SUO_RJCT	Договор находится на учете в СУО. Изменение возможно только через web-кабинет СУО	The contract is registered in SUO It's only possible to update it through SUO web-cabinet	NARR
NRD226	FLC_WRONG_ENDDATE_VALUES_2	ФЛК. Неверная хронологическая последовательность дат. Корректные значения должны соответствовать правилу: #s <= #s при заполненном automaticExecution = Y	FLC. Invalid chronological dates sequence. Valid values must conform to the rule: #s <= #s when automaticExecution = Y	BFMT
NRD227	FLC_WRONG_PRODUCT_TYPE	ФЛК. Договор не может быть классифицирован как #s	FLC. It's not correct to classify this type of contract as #s	BFMT

NRD228	FLC_WRONG_PFI	ФЛК. Неверно заполнен Код классификации ПФИ	FLC. PFI classification code is incorrect	BFMT
NRD229	FLC_WRONG_PFI	ФЛК. Значение премии опциона не может превышать номинальную сумму договора	FLC. Option's premium value exceeds the trade amount	BFMT
NRD230	FLC_WRONG_EQUITIES_QUANTITY	ФЛК. Неверно указано количество акций #s	FLC. The quantity of equities is incorrect	BFMT
NRD231	FLC_WRONG_NOMINAL_QUANTITY	ФЛК. Указанная номинальная сумма не соответствует рассчитанному значению #s	FLC. Nominal quantity does not match with the calculated value #s	BFMT
NRD232	FLC_WRONG_VALUE_CB	ФЛК. "Значение не соответствует условию #s	FLC. The equation is incorrect #s	BFMT
NRD233	FLC_ZERO_VALUE	ФЛК. В поле #s ожидается положительное значение, отличное от 0	FLC. A value higher than 0 is expected in #s field	BFMT
NRD234	FLC_WRONG_PERCENTAGE_RATE	ФЛК. Указано некорректное значение в поле #s : требуется указать значение в виде десятичной дроби, например 10% = 0.1, или значение превышает - 2 (200%)	FLC. Not correct value in #s field: a decimal rate not higher than 2 (200%) is expected, e.g. 0,1 for 10%	BFMT
NRD235	FLC_WRONG_DECIMAL_RATE	ФЛК. Указано некорректное значение в поле #s : требуется указать значение в процентном выражении, например, 100% = 100	FLC. The value is not correct in #s field: a percentage is expected, for example 100% =100	BFMT



NRD236	MSG_VS_CONTRACT_DIFF	В сообщении не совпадают параметры #s с параметрами в зарегистрированной анкете ГС	The elements #s do not correspond with the same element in the registered Master Agreement.	BFMT
NRD237	BULK_UNIQUE_ELEMENTS_CHK	В сообщениях CM083-CM085 для договоров в рамках генеральных соглашений значение для #s заполняется один раз	In the messages CM083-CM085 the element #s for the contracts under MA should be populated only once.	BFMT
NRD238	CONTRACTS_UNIQUE_ELEMENTS_CHK	В сообщении заполнение элемента #s допускается один раз.	The element #s should be populated in the message only once	BFMT
NRD239	AFFILIATED_PARTIES_TAG_INCORRECT	В сообщении с признаком nonStandartTerm = false или null не должен быть заполнен элемент partiesAreAffiliated.	The element partiesAreAffiliated should not be populated in a message with nonStandartTerm flag = false or empty.	BFMT
NRD240	CONTRACT_MA_REFERENCE_INCORRECT	Анкета генсоглашения с указанным референсом в #s не найдена в реестре	MA with the indicated reference in #s was not found in the register.	BFMT

## **ПРИЛОЖЕНИЕ 3.**

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

#### **СМ010. Анкета Генерального соглашения**

1. Дата заключения генерального соглашения.
2. Дата совершения отчитываемого события.
3. Тип генерального соглашения.
4. Версия генерального соглашения.
5. Стороны генерального соглашения (коды сторон).

#### **СМ021. Анкета договора валютного свопа**

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

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

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

#### **СМ023. Анкета договора валютного опциона**

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

2. Дата совершения отчитываемого события.
3. Классификационный тип продукта.
4. Дата начала и окончания срока осуществления права на исполнение либо Дата исполнения опциона.
5. Сумма и валюта на продажу.
6. Сумма и валюта на покупку.
7. Оговоренный тип опциона.
8. Цена исполнения (Обменный курс и Базис котировки цены исполнения).
9. Сумма и валюта премии по опциону.
10. Назначение предоставления анкеты договора валютного опциона.

#### **СМ024. Анкета договора валютного бинарного опциона**

3. Номер генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с генеральным соглашением.
4. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
5. Дата сделки (дата заключения договора).
6. Дата совершения отчитываемого события.
7. Классификационный тип продукта.
8. Дата начала и окончания срока осуществления права на исполнение либо Дата исполнения опциона.
9. Условие касания либо Триггерное условие (Базис котировки и Триггерный курс).
10. Сумма и валюта выплаты по бинарному опциону.
11. Сумма и валюта премии по опциону.
12. Назначение предоставления анкеты договора валютного бинарного опциона.

#### **СМ031. Анкета соглашения о будущей процентной ставке**

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

#### **СМ032. Анкета договора процентного свопа**

1. Номер генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора).
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Дата начала и истечения срока.
7. Начальное значение номинальной суммы по первой части договора.
8. Индекс плавающей ставки либо начальное значение фиксированной процентной ставки первой части договора.
9. Начальное значение номинальной суммы по второй части договора.
10. Индекс плавающей ставки либо начальное значение фиксированной процентной ставки второй части договора.
11. Назначение предоставления анкеты договора процентного свопа.

### **СМ033. Анкета договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки**

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

### **СМ034. Анкета договора свопциона**

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

### **СМ041. Анкета договора репо**

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

#### **СМ042. Анкета договора купли-продажи облигации**

1. Номер генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Сумма и валюта номинальной суммы по договору.
7. Чистая цена облигации.
8. Идентификатор базового актива (облигации).
9. Дата расчетов/поставки по договору.
10. Назначение предоставления анкеты договора купли-продажи облигации.

#### **СМ043. Анкета форварда на облигацию или индекс**

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

#### **СМ044. Анкета опциона на облигацию**

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

#### **СМ045. Анкета опциона на индекс и корзину облигаций**

1. Номер генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.

5. Классификационный тип продукта.
6. Тип опциона.
7. Сумма и валюта премии по договору.
8. Дата начала и окончания срока осуществления права на исполнение либо Дата (Даты) исполнения опциона.
9. Сумма и валюта номинальной суммы по договору.
10. Цена исполнения (в валюте либо в процентах).
11. Облигации/индексы, являющиеся предметом договора (Код и количество базового актива).
12. Назначение предоставления анкеты опциона на корзину облигаций.

#### **СМ046. Анкета договора купли-продажи акции**

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

#### **СМ047. Анкета форварда на акцию**

1. Номер генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;
  - покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Акции/индексы, являющиеся предметом договора (Код и количество базового актива).
7. Дата окончания срока действия договора.
8. Сумма и валюта форвардной цены по договору.
9. Назначение предоставления анкеты форварда на акции.

#### **СМ048. Анкета опциона на акцию**

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

### **СМ051. Анкета товарного форварда**

1. Номер генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора).
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Сумма и валюта форвардной цены по договору (цена за единицу товара и общая сумма).
7. Даты платежей/поставки по договору.
8. Идентификатор базового актива (товара).
9. Единица измерения и количество поставляемого товара.
10. Назначение предоставления анкеты товарного форварда.

### **СМ052. Анкета товарного опциона**

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

### **СМ053. Анкета товарного свопа**

1. Номер генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора).
3. Дата сделки (дата заключения договора).
4. Дата совершения отчитываемого события.
5. Классификационный тип продукта.
6. Дата начала и истечения срока свопа.
7. Расчетные даты и даты платежей/поставки.
8. Сумма и валюта всех фиксированных платежей.
9. Идентификатор базового актива (товара).
10. Единица измерения и количество поставляемого товара.
11. Первоначальная цена единицы товарного актива.
12. Уровень погодного индекса (Количество пунктов и пункт индекса).
13. Номинальная сумма погодного контракта (сумма и валюта).
14. Назначение предоставления анкеты товарного свопа.

### **СМ054. Анкета товарного свопциона**

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

#### **СМ061. Анкета свопа дохода на облигации**

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

#### **СМ062. Анкета свопа дохода на акции**

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

#### **СМ071. Анкета кредитного дефолтного свопа**

1. Номер генерального соглашения, присвоенный репозитарием. Не применяется в случае первичного направления для регистрации совместно с генеральным соглашением.
2. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора):
  - продавец;



- покупатель.
3. Дата сделки (дата заключения договора).
  4. Дата совершения отчитываемого события.
  5. Классификационный тип продукта.
  6. Дата начала и истечения срока свопа.
  7. Идентификатор референсного лица.
  8. Облигации/индексы, являющиеся предметом договора (Код и количество базового актива).
  9. Сумма и валюта номинальной суммы покрытия защиты.
  10. Назначение предоставления анкеты кредитного дефолтного свопа.

#### **СМ072. Анкета кредитного свопциона**

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

#### **СМ081. Анкета иной сделки**

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

#### **СМ092. Отчет об уплате маржевых сумм**

1. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора).
2. Дата совершения отчитываемого события.
3. Перечень сделок для отчета (Идентификаторы сделок либо Идентификационный номер генерального соглашения).
4. Дата расчета маржевой суммы.
5. Назначение предоставления отчета об уплате маржевых сумм.

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

1. Стороны договора (идентификационные коды сторон договора).
2. Дата совершения отчитываемого события.
3. Перечень сделок для отчета (Идентификаторы сделок либо Идентификационный номер генерального соглашения).
4. Дата оценки.
5. Тип оценки стоимости.

6. Назначение предоставления отчета о расчете справедливой (оценочной) стоимости.

**СМ093. Анкета о состоянии обязательств по договорам**

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