



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

июль 2015

Репозиторий:
Новая версия спецификация
электронных сообщений версии 3.7

ИЗМЕНЕНИЯ В АНКЕТАХ ДОГОВОРОВ (I)

БЛОК PARTY

<partyName> – Наименование стороны

Добавляется признак обязательного заполнения (mre).

Указывается Краткое наименование юридического лица или фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица (на русском или английском языке). Для **Стороны-Клиента** репозитария НРД **указывается Краткое наименование из Справочника участников** Репозитария. Квитовка русского и английского наименований обеспечивается в случае, если они указаны из Справочника участников Репозитария.

<partyId > – Идентификатор участника

Добавляется признак уникальности (umf).

Поля, определяющие уникальность анкеты – поля, обеспечивающие уникальность регистрируемых анкет генеральных соглашений, договоров и иных отчетов и поиск встречных анкет при квитовке сообщений (**umf – unique matching field**).

<Classification> – Вид экономической деятельности

Меняется признаки на maxOcc=1.

В соответствии со схемой frm1 данное поле может быть заполнено несколько раз. Но мы ограничиваем его до максимального числа вхождений в сообщение, равное 1.



ИЗМЕНЕНИЯ В АНКЕТАХ ДОГОВОРОВ (II)

БЛОК NSD-SPECIFIC-FIELDS (ОСОБЫЕ ПАРАМЕТРЫ СДЕЛКИ)

<partiesAreAffiliated> (1,1,mre,mfr) – Признак связанности стороны 1 и стороны 2
Перенесен из блока nsd-specific-fields в masterAgreementTerms

Y - стороны являются аффилированными;
N - стороны не являются аффилированными

<reportingBrokerID> (0,1,mfr) – Код голосового брокера

Если сделка заключена при посредничестве брокера, и брокер не является стороной сделки, указывается международный код идентификации юридического лица – брокера.
Если не применимо, поле остается пустым.

<cleared> (1,1,mre,mfr) – Обязанность централизованного клиринга:

Y - договор подлежит обязательному централизованному клирингу;
N - договор не подлежит обязательному централизованному клирингу

Выбор типа клиринга (0,1)

Ветка 1 «CS - расчёты по результатам простого клиринга»

<clearingOrganizationCode> (1,1,mre,mfr) - Код клиринговой организации.

<clearedDate> (1,1,mre,mfr) - Дата включения обязательств из договора в клиринговый пул

<clearingDateTime> (0,1,mfr) - Дата и время клиринга

Ветка 2 «CCP - расчёты по результатам централизованного клиринга»

<clearingCentralCounterpartyCode> (1,1,mre,mfr) - Код центрального контрагента.

<clearingMemberID> (1,1,mre,mfr) - Код участника клиринга

<clearedDate> (1,1,mre,mfr) - Дата включения обязательств из договора в клиринговый пул

<clearingDateTime> (0,1,mfr) - Дата и время клиринга



ИЗМЕНЕНИЯ В АНКЕТАХ ДОГОВОРОВ (III) БЛОК COLLATERAL (ОБЕСПЕЧЕНИЕ ПО СДЕЛКЕ)

collateral (1;1) – Обеспечение по сделке

Группа элементов, определяющих основные сведения об обеспечении по договору. Данный элемент используется в соответствии с требованиями Указания Банка России для отражения информации о Договоре о порядке уплаты плавающих маржевых сумм.

<marginType> (1,1,mre,mfr) – Тип обеспечения по договору:

FC - полное обеспечение (используется одновременно **первоначальная и плавающая маржевая сумма**);
PC - частичное обеспечение (используется только **плавающая маржевая сумма**);
OC - одностороннее обеспечение (**первоначальная и (или) плавающая маржевая сумма** вносится только одной стороной);
U - **договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм не заключен.**

<collateralForm> (1,1,mre,mfr) Форма обеспечения:

T - обязательства по данному договору обеспечиваются индивидуально;
G - обязательства по данному договору обеспечиваются совокупно с обязательствами по иным заключенным договорам в составе портфеля (кумулятивное обеспечение);
U - **договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм не заключен.**

Необязательные поля:

<csaId> (0,1,mfr) *Идентификационный код договора о порядке уплаты маржевых сумм*
<dateTradeIncludedIntoPortfolio> (0,1,mfr) *Дата включения договора в портфель*
<dateTradeExcludedFromPortfolio> (0,1,mfr) *Дата исключения договора из портфеля*

ИЗМЕНЕНИЯ В АНКЕТЕ CM092

TRANSFERS AND EXECUTION

reportIdentifier (1;3) Идентификатор отчета, присвоенный стороной

- **<partyReference>** (1,1,mre,mfr) *Участник.*
- **<tradeId>** (1,1,mre,sfr) *Идентификатор договора.*

reportReferences (1;1) Перечень сделок для отчета.

Выбор типов идентификаторов.

- **<tradeId>** (1,∞,mre,mfr) *Идентификатор сделки.*
- **<masterAgreementId>** (1,1,mre,mfr) *Идентификационный номер генерального соглашения.*

Конец выбора

Обязательные поля:

- ~~**<reportConfirmationParty>** (1,1,mre,mfr) *Подтверждающая отчет сторона.* — Удалено из схемы~~
- **<valuationDate>** (1,1,mre,mfr) *Дата расчета маржевой суммы*

creditSupportInformation (1;2) Обеспечение исполнения обязательств.

<reportParty> (1,1,mre,sfr) *Сторона, от имени которой направлено сообщение (All; Party 1; Party 2)*

creditSupportAmount (0;1) *Общая маржевая сумма*

creditSupportBalance (1;1) *Накопленная маржевая сумма*

independentAmount (1;1) *Начальная маржевая сумма*

creditSupportObligations (1;1) *Плавающая маржевая сумма*



НОВАЯ АНКЕТА CM094

MARK TO MARKET VALUATION

reportIdentifier (1;3) Идентификатор отчета, присвоенный стороной

- **<partyReference>** (1,1,mre,mfr) *Участник.*
- **<tradeId>** (1,1,mre,Sfr) *Идентификатор договора.*

reportReferences (1;1) Перечень сделок для отчета.

Выбор типов идентификаторов.

- **<tradeId>** (1, ∞,mre,mfr) *Идентификатор сделки.*
- **<masterAgreementId>** (1,1,mre,mfr) *Идентификационный номер генерального соглашения.*

Конец выбора

Обязательные поля:

- ~~**<reportConfirmationParty>** (1,1,mre,mfr) *Подтверждающая отчет сторона.*~~ — Удалено из схемы
- **<valuationMethod >** (1,1,mre,mfr) *Тип оценки стоимости (M; O; A) A - Accounting - по бухучету*
- **<valuationDate>** (1,1,mre,mfr) *Дата оценки – Добавлен новый элемент*
- **<valuationDateTime>** (0,1,af) *Дата и время оценки – Изменены признаки заполнения и сверки*

markToMarketDetails (1;2) Справедливая/оценочная стоимость

- **<reportParty>** (1,1,mre,sfr) *Сторона, от имени которой направлено сообщение (All; Party 1; Party 2)*
- **<amount>** (1,1,mre,sfr) *Справедливая/оценочная стоимость*
- **<currency>** (1,1,mre,sfr) *Валюта справедливой/оценочной стоимости*

СОГЛАСОВАНИЕ АНКЕТ СМ092 И СМ094 (I) ПРИ ОДНОСТОРОННЕЙ ОТЧЕТНОСТИ

Если ИЛ1/БИЛ1 является ИЛом/БИЛом только Стороны1 (Сторона2 – не клиент репозитария):

```
<markToMarketDetails>  
  <reportParty>Party1</reportParty>  
  <amount>100</amount>  
  <currency>RUB</currency>  
</markToMarketDetails>
```

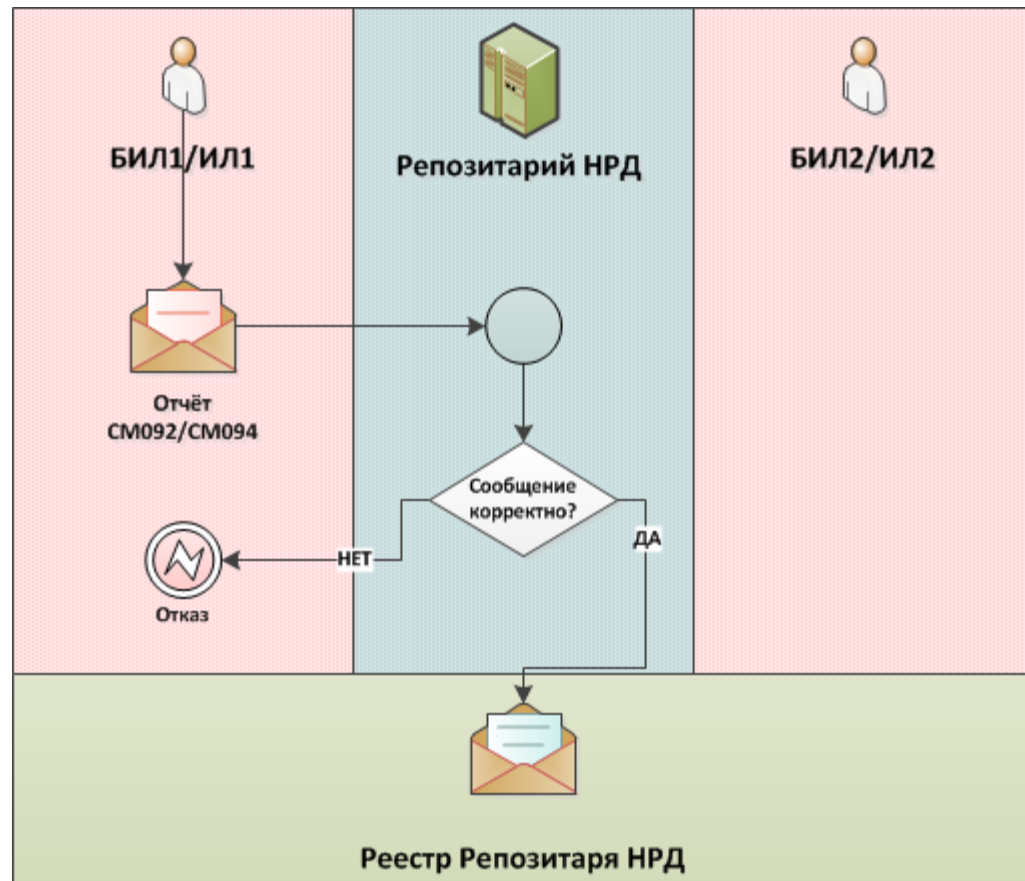
Если ИЛ1/БИЛ1 является ИЛом/БИЛом для обеих Сторон (Сторона1 и Сторона2 клиенты репозитария),

И данные совпадают:

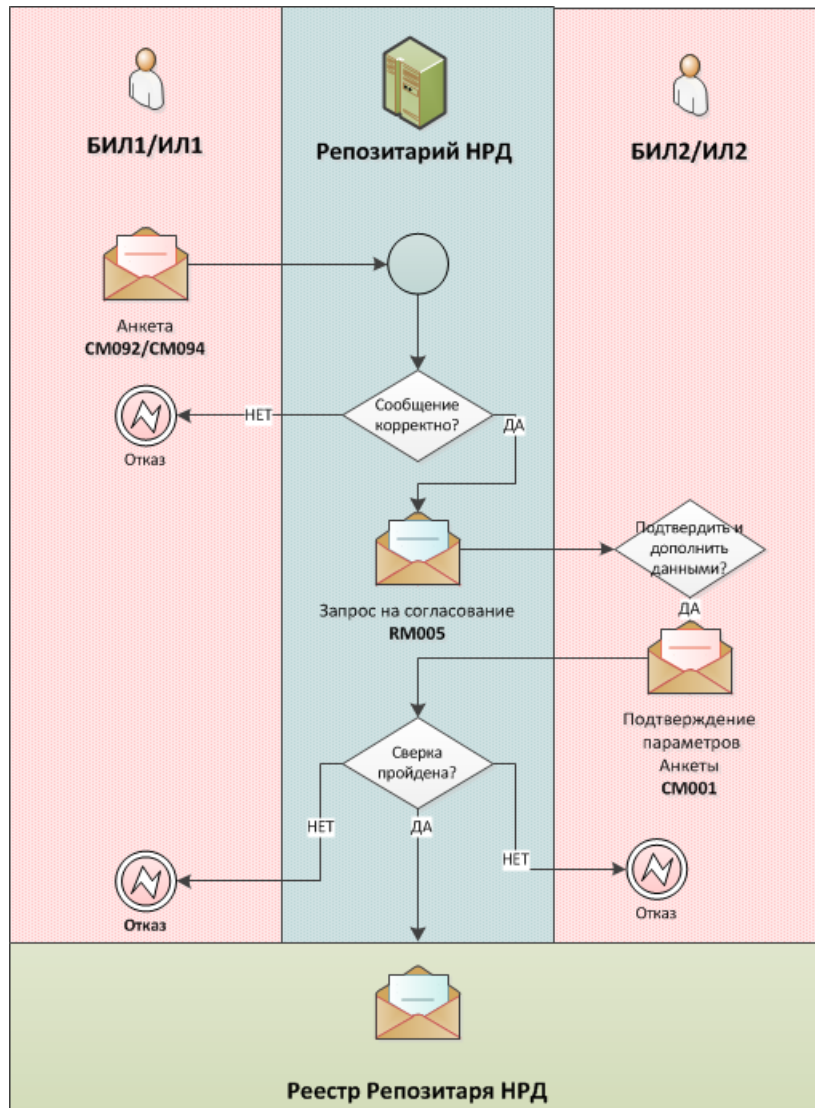
```
<markToMarketDetails>  
  <reportParty>all</reportParty>  
  <amount>100</amount>  
  <currency>RUB</currency>  
</markToMarketDetails>
```

Но данные не совпадают:

```
<markToMarketDetails>  
  <reportParty>Party1</reportParty>  
  <amount>100</amount>  
  <currency>RUB</currency>  
</markToMarketDetails>  
<markToMarketDetails>  
  <reportParty>Party2</reportParty>  
  <amount>101</amount>  
  <currency>RUB</currency>  
</markToMarketDetails>
```



СОГЛАСОВАНИЕ АНКЕТ СМ092 И СМ094 (II) ПРИ ПОСЛЕДОВАТЕЛЬНОМ ПОДТВЕРЖДЕНИИ



ИЛ1/БИЛ1 является ИЛом/БИЛом только Стороны1, отправляет сообщение с данными:

```

<markToMarketDetails>
  <reportParty>Party1</reportParty>
  <amount>100</amount>
  <currency>RUB</currency>
</markToMarketDetails>
  
```

ИЛ2/БИЛ2 является ИЛом/БИЛом для Стороны2, дополняет полученное сообщение своим блоком данных:

```

<markToMarketDetails>
  <reportParty>Party1</reportParty>
  <amount>100</amount>
  <currency>RUB</currency>
</markToMarketDetails>
<markToMarketDetails>
  <reportParty>Party2</reportParty>
  <amount>101</amount>
  <currency>RUB</currency>
</markToMarketDetails>
  
```


СОГЛАСОВАНИЕ АНКЕТ СМ092 И СМ094 (III) ПРИ ВСТРЕЧНОМ ПОДТВЕРЖДЕНИИ

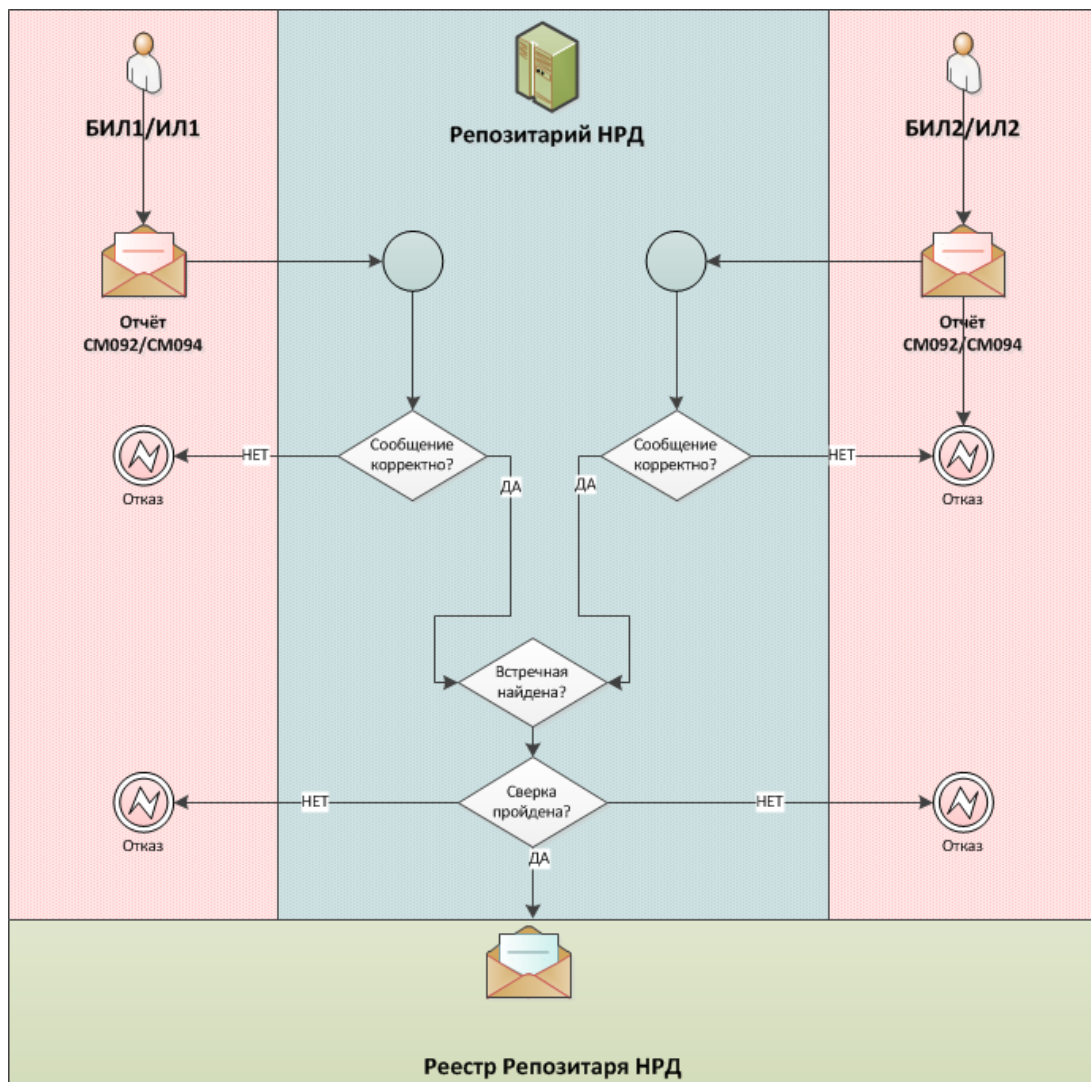
Каждый ИЛ/БИЛ заполняет блок 1 раз за себя:

ИЛ1/БИЛ1 является ИЛом/БИЛом только Стороны1, отправляет сообщение с данными:

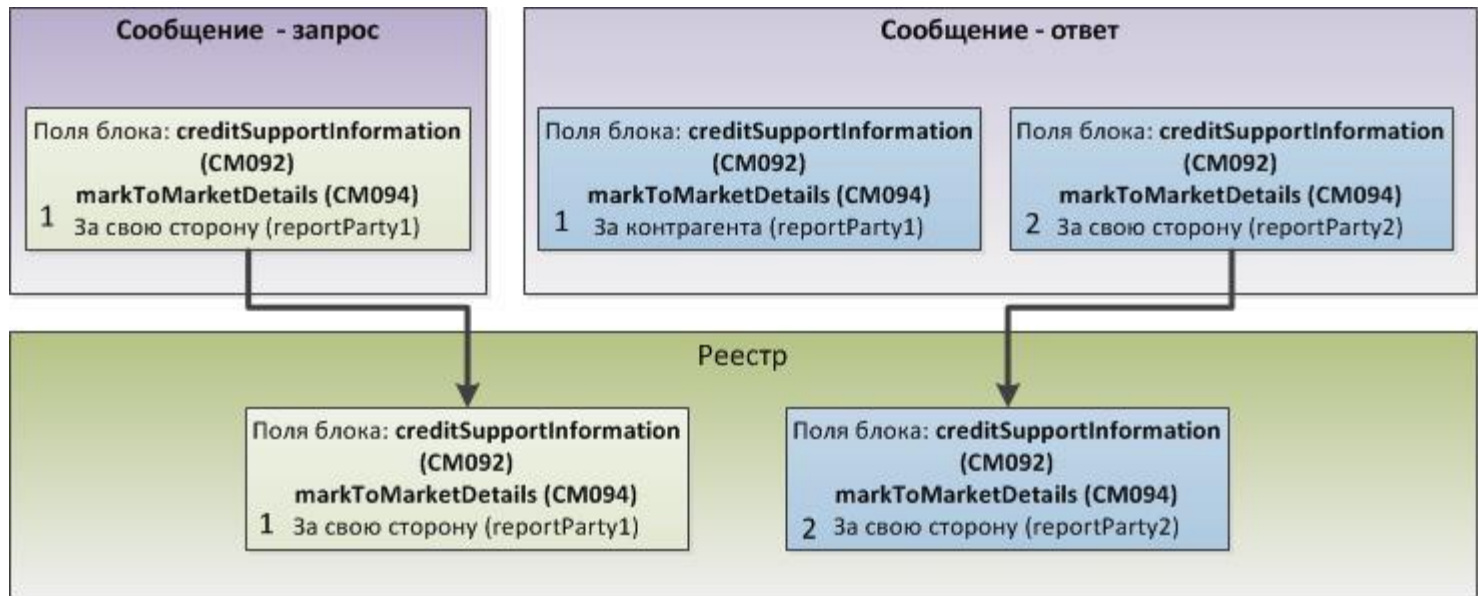
```
<markToMarketDetails>  
<reportParty>Party1</reportParty>  
<amount>100</amount>  
<currency>RUB</currency>  
</markToMarketDetails>
```

ИЛ2/БИЛ2 является ИЛом/БИЛом для Стороны2, отправляет сообщение с данными:

```
<markToMarketDetails>  
<reportParty>Party2</reportParty>  
<amount>101</amount>  
<currency>RUB</currency>  
</markToMarketDetails>
```



ОСОБЕННОСТЬ ВНЕСЕНИЯ В РЕЕСТР ЗНАЧЕНИЙ ПОЛЕЙ АНКЕТ СМ092 И СМ094 ПРИ ВСТРЕЧНОМ/ПОСЛЕДОВАТЕЛЬНОМ ПОДТВЕРЖДЕНИИ



ИЗМЕНЕНИЯ В СООБЩЕНИЯХ CM004 И RM004

STATEMENTREQUEST (ЗАПРОС НА ВЫПИСКУ CM004)

StatementType	Тип запрашиваемой в выписке информации	Ответ на запрос
MAGR	Генеральное соглашение	RM004
DEAL	Сделка	RM004
BRUP	Предоставление документов, связанное с процедурой банкротства	RM004
ALLD	Все зарегистрированные договоры	RM004
MSGS	Все зарегистрированные договоры в журнале входящих сообщений	RM009
CSA	Обеспечение и исполнение обязательств	RM004
MTM	Сведения о справедливой/оценочной стоимости	RM004

STATEMENT REPORT (ВЫПИСКА RM004)

masterAgreementEvents	MasterAgreementEvents	Список событий, зарегистрированных в привязке к конкретному генеральному соглашению.
transfersAndExecutionEvent	TradeLifeCycleEvent	Список событий, зарегистрированных в привязке к Договору о передаче маржевых сумм.
markToMarketEvent	TradeLifeCycleEvent	Список событий, зарегистрированных в привязке к Договору о справедливой/оценочной стоимости

**СПАСИБО
ЗА ВНИМАНИЕ!**



**НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ**
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

ПРАВОВАЯ ОГОВОРКА

- Настоящая презентация была подготовлена и выпущена НКО ЗАО НРД (далее – «Компания»). Если нет какой-либо оговорки об ином, то Компания считается источником всей информации, изложенной в настоящем документе. Данная информация предоставляется по состоянию на дату настоящего документа и может быть изменена без какого-либо уведомления.
- Данный документ не является, не формирует и не должен рассматриваться в качестве предложения или же приглашения для продажи или участия в подписке, или же, как побуждение к приобретению или же к подписке на какие-либо ценные бумаги, а также этот документ или его часть или же факт его распространения не являются основанием и на них нельзя полагаться в связи с каким-либо предложением, договором, обязательством или же инвестиционным решением, связанными с ним, равно как и он не является рекомендацией относительно ценных бумаг компании.
- Изложенная в данном документе информация не являлась предметом независимой проверки. В нем также не содержится каких-либо заверений или гарантий, сформулированных или подразумеваемых и никто не должен полагаться на достоверность, точность и полноту информации или мнения, изложенного здесь. Никто из Компании или каких-либо ее дочерних обществ или аффилированных лиц или их директоров, сотрудников или работников, консультантов или их представителей не принимает какой-либо ответственности (независимо от того, возникла ли она в результате халатности или чего-то другого), прямо или косвенно связанной с использованием этого документа или иным образом возникшей из него.
- Данная презентация содержит прогнозные заявления. Все включенные в настоящую презентацию заявления, за исключением заявлений об исторических фактах, включая, но, не ограничиваясь, заявлениями, относящимися к нашему финансовому положению, бизнес-стратегии, планам менеджмента и целям по будущим операциям являются прогнозными заявлениями. Эти прогнозные заявления включают в себя известные и неизвестные риски, факторы неопределенности и иные факторы, которые могут стать причиной того, что наши нынешние показатели, достижения, свершения или же производственные показатели, будут существенно отличаться от тех, которые сформулированы или подразумеваются под этими прогнозными заявлениями. Данные прогнозные заявления основаны на многочисленных презумпциях относительно нашей нынешней и будущей бизнес-стратегии и среды, в которой мы ожидаем осуществлять свою деятельность в будущем. Важнейшими факторами, которые могут повлиять на наши нынешние показатели, достижения, свершения или же производственные показатели, которые могут существенно отличаться от тех, которые сформулированы или подразумеваются этими прогнозными заявлениями являются, помимо иных факторов, следующие:
 - восприятие рыночных услуг, предоставляемых Компанией и ее дочерними обществами;
 - волатильность (а) Российской экономики и рынка ценных бумаг и (b) секторов с высоким уровнем конкуренции, в которых Компания и ее дочерние общества осуществляют свою деятельность;
 - изменения в (а) отечественном и международном законодательстве и налоговом регулировании и (b) государственных программах, относящихся к финансовым рынкам и рынкам ценных бумаг;
 - ростом уровня конкуренции со стороны новых игроков на рынке России;
 - способность успевать за быстрыми изменениями в научно-технической среде, включая способность использовать расширенные функциональные возможности, которые популярны среди клиентов Компании и ее дочерних обществ;
 - способность сохранять преемственность процесса внедрения новых конкурентных продуктов и услуг, равно как и поддержка конкурентоспособности;
 - способность привлекать новых клиентов на отечественный рынок и в зарубежных юрисдикциях;
 - способность увеличивать предложение продукции в зарубежных юрисдикциях.
- Прогнозные заявления делаются только на дату настоящей презентации, и мы точно отрицаем наличие любых обязательств по обновлению или пересмотру прогнозных заявлений в настоящей презентации в связи с изменениями наших ожиданий, или перемен в условиях или обстоятельствах, на которых основаны эти прогнозные заявления.

