

Приложение
к приказу НКО АО НРД
№ 854-Э от 13.09.2022

ИНСТРУКЦИЯ
ПО РАБОТЕ СЕРВИСА ФОРМАТНО-ЛОГИЧЕСКОГО КОНТРОЛЯ

Содержание

I. Термины и определения	3
II. Общие положения	4
III. Описание проверок	5
1. Для всех анкет.....	5
1.1. Проверка соблюдения регуляторных сроков регистрации сообщений в Разделе 1 Реестра договоров.....	5
1.2. Проверка соблюдения регуляторных сроков регистрации сообщений в Разделе 2 Реестра договоров.....	6
2. Для отдельных типов договоров	7
2.1. Проверка классификации договора как ПФИ.....	7
2.2. Проверка процентной ставки РЕПО.....	7
2.3. Проверка отклонения расчетного курса валюты от официального курса Банка России	8
2.4. Проверка значений, обозначающих сумму или количество	9
2.5. Проверка даты окончания срока действия договора	14
2.6. Проверка параметров, влияющих на расчет объема по сделке	17
2.7. Проверка формата заполнения процентной ставки	19
2.8. Проверка отклонения цены ценной бумаги от рыночной котировки	22
2.9. Проверка даты расчетов относительно даты погашения облигации	23
2.10. Проверка на дубликат сообщения.....	24
2.11. Проверки соблюдения сроков предоставления отчетов СМ093 и СМ094.....	25
2.11.1. Проверка сроков отчетности по СМ093	25
2.11.2. Проверка сроков отчетности по СМ094	26
Приложение 1.....	27
Приложение 2.....	28

I. Термины и определения

- 1.1. **Договор** – договор об оказании сопутствующих услуг, заключенный между НРД и Клиентом путем присоединения Клиента к указанному договору (в соответствии со статьей 428 Гражданского кодекса Российской Федерации), условия которого предусмотрены Регламентом оказания сопутствующих услуг Репозитария НКО АО НРД и Тарифами НРД.
- 1.2. **Договор ЭДО** – договор об обмене электронными документами, заключенный между НРД и Клиентом.
- 1.3. **Инструкция** – настоящая Инструкция по работе сервиса форматно-логического контроля.
- 1.4. **Клиент** – юридическое лицо, заключившее с НРД Договор и Договор об оказании репозитарных услуг.
- 1.5. **НРД** – Небанковская кредитная организация акционерное общество «Национальный расчетный депозитарий» (НКО АО НРД).
- 1.6. **Репозитарий** – НРД, осуществляющий репозитарную деятельность на основании лицензии.
- 1.7. **Сопутствующая услуга** – услуга по предоставлению удаленного доступа к услугам Репозитария с дополнительным сервисом форматно-логического контроля, оказываемая в соответствии с Договором.
- 1.8. **ФЛК** – форматно-логический контроль.
- 1.9. **Иные термины** используются в значениях, установленных законодательством Российской Федерации, иными нормативными правовыми актами, нормативными актами Банка России, Правилами осуществления репозитарной деятельности НКО АО НРД, Регламентом оказания сопутствующих услуг Репозитария НКО АО НРД и Договором ЭДО.

II. Общие положения

Сервис ФЛК является Сопутствующей услугой и позволяет Клиентам контролировать следующие параметры в регуляторной отчетности:

- 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 возможных дубликатов 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;
- корректность параметров, исходя из экономической сути договора.

По результатам обработки предоставленных в Репозиторий сообщений, при идентификации возможных неточностей в отчетности, происходит информирование Клиента о сработавшем контроле путем направления Уведомления о расхождении в параметрах анкет (Форма RM006) с признаком «FLC» и описанием возможной ошибки в отчетности.

Клиент самостоятельно принимает решение о необходимости исправления отчетности, при необходимости, вправе обратиться в Репозиторий для уточнения деталей полученного уведомления.

В интерфейсе Web-кабинета в разделе «Реестр» реализован визуальный контроль с подсветкой зарегистрированных договоров, по которым было направлено Уведомление о расхождении в параметрах анкет (Форма RM006), также разработано отдельное предоставление «Уведомления ФЛК» для уведомительных сообщений в разделе «Отчеты».

III. Описание проверок

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. Для всех анкет

1.1. Проверка соблюдения регуляторных сроков регистрации сообщений в Разделе 1 Реестра договоров

Дата (операционный день) регистрации сообщения (Анкета договора (Формы СМ021-СМ081), Анкета генерального соглашения (Форма СМ010), Анкета договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств (Форма СМ015), Анкета о состоянии обязательств по договорам (Форма СМ093)) в Журнале учета сообщений (раздел 1 Реестра договоров) не должна превышать дату заключения сделки и дату отчитываемого события более чем на 3 (три) рабочих дня. В случае отказа Репозитария в регистрации сообщения допускается подача нового сообщения с тем же Кодом УТИ не позднее 3 (трех) рабочих дней со дня получения сообщения об отказе.

Данные проверки не выполняются для информации, предоставленной в Bulk-формате (Отчет по сделкам репо (Форма СМ083), Отчет по сделкам валютный своп (Форма СМ084), Отчет по конверсионным сделкам (Форма СМ085)).

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1	Если сообщение подается на регистрацию договора с типом REG1 и при этом Код УТИ отсутствует (для договоров, заключенных до 01.07.2016) либо это первое уникальное сообщение с данным Кодом УТИ, проверяется условие: Разница между параметрами «Дата (операционный день) регистрации сообщения в журнале учета сообщений» и «Дата сделки» не должна превышать 3 (три) рабочих дня. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
2	Если сообщение подается на изменение/коррекцию Анкеты договора (СМ021-СМ081), Анкеты генерального соглашения (СМ010), Анкеты договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств (Форма СМ015) или подается Анкета о состоянии обязательств по договорам (Форма СМ093) и при этом последнее сообщение анкеты договора с данным Кодом УТИ не находится в статусе REJECT, проверяется условие: Разница между параметрами «Дата (операционный день) регистрации сообщения в журнале учета сообщений» и «Дата совершения отчитываемого события» не должна превышать 3 (три) рабочих дня. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	« NRW007 - Информация, содержащая сведения о договоре, занесена в журнал учета сообщений Репозитария позднее 3 (трех) рабочих дней с даты заключения, изменения или прекращения указанного договора».
3	Если сообщение подается на регистрацию договора и при этом имеется ранее зарегистрированное сообщение с таким же Кодом УТИ в статусе REJECT, проверяется условие: Разница между параметрами «Дата (операционный день) регистрации сообщения в журнале учета сообщений» нового сообщения и «Дата (операционный день) регистрации сообщения в журнале учета сообщений» (самого раннего сообщения с таким же Кодом УТИ в статусе REJECT) не должна превышать 3 (три) рабочих дня. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
4	Если подается сообщение на изменение договора или подается Анкета о состоянии обязательств по договорам (Форма СМ093), при этом последнее зарегистрированное сообщение с таким же Кодом УТИ находится в статусе	

	<p>REJECT, проверяется условие:</p> <p>Разница между параметрами «Дата (операционный день) регистрации сообщения в журнале учета сообщений» нового сообщения и «Дата (операционный день) регистрации сообщения в журнале учета сообщений» (последнего сообщения с таким же Кодом УТИ, если оно находится в статусе REJECT) не должна превышать 3 (три) рабочих дня.</p> <p>Если условие не выполняется – комментарий в RM006.</p>	
--	---	--

1.2. Проверка соблюдения регуляторных сроков регистрации сообщений в Разделе 2 Реестра договоров

Дата (операционный день) внесения записи в Реестр договоров не должна превышать дату заключения сделки и дату отчитываемого события более чем на 3 (три) рабочих дня.

В случае отказа Репозитария в регистрации сообщения допускается подача нового сообщения с тем же Кодом УТИ не позднее 3 (трех) рабочих дней со дня получения сообщения об отказе.

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1	<p>Если сообщение подается на регистрацию договора и при этом ранее не было отказов по сообщениям с данным Кодом УТИ, проверяется условие:</p> <p>Разница между параметрами «Дата (операционный день) регистрации сообщения в РЕЕСТРЕ» и «Дата сделки» не должна превышать 3 (три) рабочих дня.</p> <p>Если условие не выполняется – комментарий в RM006.</p>	<p>«NRW005 - Информация, содержащая сведения о договоре, занесена в реестр Репозитария позднее 3 (трех) рабочих дней с даты заключения, изменения или прекращения указанного договора».</p>
2	<p>Если сообщение подается на изменение/коррекцию договора или подается Анкета о состоянии обязательств по договорам (Форма 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 РЕЕСТРЕ» и «Дата совершения отчитываемого события» не должна превышать 3 (три) 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 РЕЕСТРЕ» и «Дата (операционный день) регистрации сообщения в РЕЕСТРЕ» (самого раннего сообщения с таким же Кодом УТИ в статусе REJECT) не должна превышать 3 (три) рабочих дня.</p> <p>Если условие выполняется – комментарий в RM006.</p>	
4	<p>Если сообщение подается на изменение/коррекцию договора или подается Анкета о состоянии обязательств по договорам (Форма 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 РЕЕСТРЕ» и «Дата (операционный день) регистрации сообщения в РЕЕСТРЕ» (самого раннего сообщения с таким же Кодом УТИ в статусе REJECT) не должна превышать 3 (три) рабочих дня.</p> <p>Если условие не выполняется – комментарий в RM006.</p>	

2. Для отдельных типов договоров

2.1. Проверка классификации договора как ПФИ

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

2.2. Проверка процентной ставки РЕПО

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1	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%. 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.	« NRW002 - Указанная процентная ставка отличается от вычисляемой ставки более чем на 0,001 (0,1%)».
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)	

	<p>r (фиксированная процентная ставка)</p> <p>t (срок сделки репо): разница между датой расчетов по второй части РЕПО и датой расчетов по первой части РЕПО;</p> <p>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):</p> <ul style="list-style-type: none"> • 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: <ul style="list-style-type: none"> ○ 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	<p>Определение расхождения между вычисленными ставками и указанной ставкой.</p> <p>Рассчитывается относительное минимальное отклонение указанной в анкете процентной ставки от расчетного значения (по формулам сложной и простой процентных ставок):</p> $Dmin = (\min\{ SD , CD \}) / (r)$ <p>Выбираем минимальное значение из SD и CD, и рассчитываем его отношение к указанной ставке «r».</p>	
4	Если значение Dmin >0.001 либо Dmin <=0.001 – комментарий в RM006.	

2.3. Проверка отклонения расчетного курса валюты от официального курса Банка России

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1	Анкета договора валютного свопа (CM021), Анкета договора конверсионной сделки (валютного форварда) (CM022), Анкета договора валютного опциона (CM023).	
1.1	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».	«NRW006 - Указанный курс по сделке отклоняется от официального курса иностранной валюты, установленного Банком России, более чем на 10%»
1.2	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	

	<p>Сумма валюты на продажу/Сумма валюты на покупку = указанный курс</p> <p>Для базиса котировки $Currency2PerCurrency1$ должно выполняться равенство:</p> <p>Сумма валюты 2 платежа/Сумма валюты 1 платежа = указанный курс или Сумма валюты на покупку/Сумма валюты на продажу = указанный курс</p>	
1.3	<p>Проверка отклонения.</p> <p>Если обе суммы (в Валюте 1 и Валюте 2), а также указанный курс > 1, то</p> <ul style="list-style-type: none"> Отклонение в процентах = $((\text{указанный курс} * \text{сумма в валюте 2} - \text{сумма в валюте 1}) / \text{сумма в валюте 1}) * 100 \leq 1\%$ <p>Если обе суммы (в валюте 1 и в валюте 2) > 1, и $0.1 < \text{указанный курс} \leq 1$, то</p> <ul style="list-style-type: none"> Отклонение в процентах = $((\text{указанный курс} * \text{сумма в валюте 2} - \text{сумма в валюте 1}) / \text{сумма в валюте 1}) * 100 \leq 5\%$ <p>В остальных случаях допускается любое отклонение без отказа.</p> <p>Если условие не выполняется – отказ NRD207, проверка завершается.</p> <p>Если условие выполняется – переход на следующий этап.</p>	
1.4	<ul style="list-style-type: none"> Если одна из валют является RUB: Определяется ОФкурс 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. Если ни одна из валют не является RUB: Определяется ОФкурс1 (в RUB) для Валюты 1 и ОФкурс2 (в RUB) для Валюты 2. Далее определяется отношение $\text{ОФкурс1} / \text{ОФкурс2} = \text{ОФкурс}$ и сравнивается с указанным курсом <i>rate</i>: $0,9 * \text{ОФкурс} \leq \text{указанный курс} \leq 1,1 * \text{ОФкурс}$ 	

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	Анкета договора валютного свопа (CM021 – fxSwap)	Комментарий 1
1.1	<p>Проверить значения суммы платежа в Валюте 1 и суммы платежа в Валюте 2:</p> <p>$\text{exchangedCurrency1}/\text{paymentAmount}$</p> <p>$\text{exchangedCurrency2}/\text{paymentAmount}$</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях $> 1\,000\,000\,000\,000$ (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	<p>"NRW008 - В поле <название поля- xml тэг > ожидается положительное значение, отличное от 0"</p> <p>Комментарий 2</p>
2	Анкета договора конверсионной сделки (валютного форварда) (CM022 – fxSingleLeg)	" NRW009 -
2.1	Проверить значения суммы платежа в Валюте 1 и суммы платежа в Валюте	Возможная ошибка: значение в <название поля –

	<p>2:</p> <p>exchangedCurrency1/paymentAmount</p> <p>exchangedCurrency2/paymentAmount</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	xml тэг> превышает значение 1 трлн. руб."
3.	Анкета договора валютного опциона (CM023 – fxOption)	
3.1	<p>Проверить значения суммы валюты на покупку, суммы валюты на продажу и суммы премии:</p> <p>callCurrencyAmount</p> <p>putCurrencyAmount</p> <p>premium/paymentAmount</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
4.	Анкета договора бинарного валютного опциона (CM024 – fxDigitalOption)	
4.1	<p>Проверить значения суммы выплаты по опциону и суммы премии:</p> <p>payout</p> <p>premium/paymentAmount</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
5.	Анкета соглашения о будущей процентной ставке (CM031 – fra)	
5.1	<p>Проверить значение номинальной суммы:</p> <p>notional</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
6.	Анкета договора процентного свопа (CM032 – swap)	
6.1	<p>Проверить значение номинальной суммы:</p> <p>notionalStepSchedule/initialValue</p> <p>knownAmountSchedule/initialValue</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
7.	Анкета договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки (CM033 – capFloor)	
7.1	<p>Проверить значения номинальной суммы и суммы премии:</p> <p>notionalStepSchedule/initialValue</p> <p>premium/paymentAmount</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу</p>	

	Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.	
8	Анкета договора свопциона (CM034 – swaption)	
8.1	<p>Проверить значения номинальной суммы и суммы премии:</p> <p>notionalStepSchedule/initialValue</p> <p>knownAmountSchedule/initialValue</p> <p>premium/paymentAmount</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
9.	Анкета договора РЕПО (CM041 - repo)	
9.1	<p>Проверить значения суммы расчетов, номинальной суммы обеспечения / количества и цены единицы актива в обеспечении:</p> <p>spotLeg/settlementAmount*</p> <p>spotLeg/collateral/nominalAmount*</p> <p>spotLeg/collateral/numberOfUnits</p> <p>spotLeg/collateral/unitPrice*</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях (только для тегов, отмеченных «*») > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
10.	Анкета договора купли-продажи облигации (CM042 – bondSimpleTransaction)	
10.1	<p>Проверить значение номинальной суммы:</p> <p>notionalAmount</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
11.	Анкета договора форварда на облигацию и индекс (CM043 – bondForward)	
11.1	<p>Проверить значение номинальной суммы:</p> <p>notionalAmount</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
12.	Анкета договора опциона на облигацию (CM044 – bondOption)	
12.1	<p>Проверить значения номинальной суммы, суммы премии, объема лота и количества опционов:</p> <p>notionalAmount</p> <p>premium/paymentAmount</p> <p>optionEntitlement</p> <p>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>) > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то</p>	

	Комментарий 2 в RM006.	
13.	Анкета договора опциона на индекс и корзину облигаций (индексов) (CM045 – bondBasketOption)	
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>) > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
14.	Анкета договора купли-продажи акции (CM046 – equitySimpleTransaction)	
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>) > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
15.	Анкета договора форварда на акцию (CM047 – equityForward)	
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>) > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
16.	Анкета договора опциона на акцию (CM048 – equityOption)	
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>) > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
17.	Анкета договора товарного форварда (CM051 – commodityForward)	

17.1	<p>Проверить значения общего номинального количества / поставляемого количества актива, фиксированной цены и общей суммы:</p> <p>floatingForwardLeg/totalNotionalQuantity</p> <p>commodityForwardPhysicalLeg/deliveryQuantity/totalPhysicalQuantity</p> <p>fixedLeg/fixedPrice</p> <p>fixedLeg/totalPrice</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях (только для <i>totalPrice</i>) > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
18.	Анкета договора товарного опциона (CM052 – commodityOption)	
18.1	<p>Проверить значения общего номинального количества и премии:</p> <p>totalNotionalQuantity</p> <p>premium/paymentAmount</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях (только для <i>premium</i>) > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
19.	Анкета договора товарного свопа (CM053 – commoditySwap)	
19.1	<p>Проверить значения общего номинального количества / поставляемого количества актива и общей суммы:</p> <p>floatingLegNsd/totalNotionalQuantity</p> <p>fixedLeg/totalNotionalQuantity</p> <p>commoditySwapPhysicalLeg/deliveryQuantity/totalPhysicalQuantity/quantity</p> <p>fixedLeg/totalPrice</p> <p>Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006.</p> <p>Если значение в рублях (только для <i>totalPrice</i>) > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
20.	Анкета договора товарного свопциона (CM054 – commoditySwaption)	
20.1	<p>Проверить значения общего номинального количества / поставляемого количества актива, общей суммы и премии:</p> <p>fixedLeg/totalNotionalQuantity</p> <p>floatingLegNsd/totalNotionalQuantity</p> <p>commoditySwapPhysicalLeg/deliveryQuantity/totalPhysicalQuantity</p> <p>fixedLeg/totalPrice</p> <p>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>) > 1 000 000 000 000 (1 трлн.) (конвертация по курсу Банка России на дату сделки), то Комментарий 2 в RM006.</p>	
21.	Анкета договора свопа дохода на облигацию (CM061 – bondSwap)	
21.1	<p>Проверить значения номинальной суммы:</p> <p>bondReturnLeg/notionalAmount</p>	

	interestLeg/notional/notionalAmount 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.	
22.	Анкета договора свопа дохода на акцию (CM062 – equitySwapTransactionSupplement)	
22.1	Проверить значения номинальной суммы: interestLeg/notional/notionalAmount returnLeg/notional/notionalAmount 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.	
23.	Анкета договора кредитного дефолтного свопа (CM071 – creditDefaultSwap)	
23.1	Проверить значение расчетной суммы: protectionTerms/calculationAmount 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.	
24.	Анкета договора кредитного дефолтного свопциона (CM072 – creditDefaultSwapOption)	
24.1	Проверить значения расчетной суммы, премии и цены страйк: protectionTerms/calculationAmount premium/paymentAmount strike/spread strike/price Если значение = 0, то Комментарий 1 в RM006. 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.	Анкета иной сделки (CM081 – generalProduct)	
25.1	Проверить значения общей денежной суммы: party1Obligations/nominalAmount party2Obligations/nominalAmount 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.	

2.5. 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 Инструкции).

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1	Анкета договора валютного свопа (CM021 – fxSwap)	<p data-bbox="1225 1010 1469 1279">"NRW010 - Возможно нарушена хронологическая последовательность дат в сообщении: <Дата окончания срока действия договора> меньше <название поля>"</p>
1.1	Дата валютирования для окончательного платежа <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
2	Анкета договора конверсионной сделки (валютного форварда) (CM022 – fxSingleLeg)	
2.1	Дата валютирования <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
3	Анкета договора валютного опциона (CM023 – fxOption)	
3.1	Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
4	Анкета договора бинарного валютного опциона (CM024 – fxDigitalOption)	
4.1	Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
5	Анкета соглашения о будущей процентной ставке (CM031 – fra)	
5.1	Дата платежа <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
6	Анкета договора процентного свопа (CM032 – swap)	
6.1	Дата истечения срока <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
7	Анкета договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки (CM033 – capFloor)	
7.1	Дата истечения срока <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
8	Анкета договора свопциона (CM034 – swaption)	
8.1	Дата истечения срока <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
9	Анкета договора РЕПО (CM041 - repo)	
9.1	Дата расчетов по 2 части <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
10	Анкета договора купли-продажи облигации (CM042 – bondSimpleTransaction)	
10.1	Дата расчетов <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
11	Анкета договора форварда на облигацию и индекс (CM043 – bondForward)	
11.1	Дата расчетов <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	

12	Анкета договора опциона на облигацию (CM044 – bondOption)	
12.1	Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
13	Анкета договора опциона на индекс и корзину облигаций (индексов) (CM045 – bondBasketOption)	
13.1	Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
14	Анкета договора купли-продажи акции (CM046 – equitySimpleTransaction)	
14.2	Дата расчетов <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
15	Анкета договора форварда на акцию (CM047 – equityForward)	
15.1	Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
16	Анкета договора опциона на акцию (CM048 – equityOption)	
16.1	Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
17	Анкета договора товарного форварда (CM051 – commodityForward)	
17.1	Даты платежей <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
18	Анкета договора товарного опциона (CM052 – commodityOption)	
18.1	Дата истечения, Даты платежей <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
19	Анкета договора товарного свопа (CM053 – commoditySwap)	
19.1	Дата истечения срока <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
19.2	Даты платежей <= Дата истечения срока. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
19.3	Даты поставки <= Дата истечения срока. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
20	Анкета договора товарного свопциона (CM054 – commoditySwaption)	
20.1	Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
20.2	Даты платежей <= Дата истечения срока. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
20.3	Даты поставки <= Дата истечения срока. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
21	Анкета договора свопа дохода на облигацию (CM061 – bondSwap)	
21.1	Даты платежа <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
22	Анкета договора свопа дохода на акцию (CM062 –	

	equitySwapTransactionSupplement)	
22.1	Даты платежа <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
23	Анкета договора кредитного дефолтного свопа (CM071 – creditDefaultSwap)	
23.1	Плановая дата окончания срока <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
24	Анкета договора кредитного дефолтного свопциона (CM072 – creditDefaultSwapOption)	
24.1	Дата истечения <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	
25	Анкета иной сделки (CM081 – generalProduct)	
25.1	Дата платежа <= Дата окончания срока действия договора. Если условие не выполняется – комментарий в RM006.	

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 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	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1.	Анкета договора валютного опциона (CM023 – fxOption)	
1.1	Проверить, что отношение суммы премии к номинальной сумме $putCurrencyAmount \leq 0,25$. Если значение > 0,25, то комментарий в RM006.	
2.	Анкета договора бинарного валютного опциона (CM024 – fxDigitalOption)	
2.1	Проверить, что отношение суммы премии к сумме выплаты $payout \leq 0,25$. Если значение > 0,25, то комментарий в RM006.	" NRW011 - Отношение суммы премии опциона к номинальной сумме валюты на продажу превышает 25%"
3.	Анкета договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки (CM033 – capFloor)	
3.1	Проверить, что отношение суммы премии к номинальной сумме $notionalStepSchedule/initialValue \leq 0,25$. Если значение > 0,25, то комментарий в RM006.	
4.	Анкета договора свопциона (CM034 – swaption)	
4.1	Проверить, что отношение суммы премии к номинальной сумме $notionalStepSchedule/initialValue \leq 0,25$. Если значение > 0,25, то комментарий в RM006.	
5.	Анкета договора форварда на облигацию или индекс (CM043 –	" NRW012 -

	bondForward)	Указанная Номинальная сумма не соответствует рассчитанному значению <Описание условия>"
5.1	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> . Если инструмент в КБД не найден, то проверка не выполняется. Если условие не выполняется, то комментарий в RM006.	
6.	Анкета договора опциона на облигацию (CM044 – bondOption)	
6.1	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> . Если инструмент в КБД не найден, то проверка не выполняется. Если условие не выполняется, то комментарий в RM006.	
7.	Анкета договора опциона на акцию (CM048 – equityOption)	
7.1	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>) $\leq 0,25$. Если значение $> 0,25$, то комментарий в RM006.	"NRW011 - Отношение суммы премии опциона к номинальной сумме валюты на продажу превышает 25%"
8.	Анкета договора товарного форварда (CM051 – commodityForward)	
8.1	Проверить, что 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). 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). Если условие не выполняется, то комментарий в RM006.	"NRW012 - Указанная Номинальная сумма не соответствует рассчитанному значению <Описание условия>"
9.	Анкета договора товарного опциона (CM052 – commodityOption)	
9.1	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>) $\leq 0,25$. Если значение $> 0,25$, то комментарий в RM006.	
10.	Анкета договора товарного свопциона (CM054 – commoditySwaption)	
10.1	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>) $\leq 0,25$. Если значение $> 0,25$, то комментарий в RM006.	"NRW011 - Отношение суммы премии опциона к номинальной сумме валюты на продажу превышает 25%"
11.	Анкета договора кредитного дефолтного свопциона (CM072 – creditDefaultSwapOption)	
11.1	Проверить, что отношение суммы премии к номинальной сумме <i>calculationAmount</i> $\leq 0,25$. Если значение $> 0,25$, то комментарий в RM006.	

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.	Анкета соглашения о будущей процентной ставке (CM031 – fra)	
1.1	Проверить значение параметра: fixedRate Если значение < -3 или > 3, то ошибка NRD234. Если значение < -1 или > 1, то комментарий в RM006.	
2.	Анкета договора процентного свопа (CM032 – swap)	
2.1	Проверить значения параметров: floatingRateCalculation/initialRate floatingRateCalculation/spreadSchedule/initialValue floatingRateCalculation/capRateSchedule/initialValue floatingRateCalculation/floorRateSchedule/initialValue fixedRateSchedule/initialValue Если значение < -3 или > 3, то ошибка NRD234. Для индекса <i>RUB-CPI-ROSSTAT</i> если значение < -15 или > 15, то ошибка NRD234. Если значение < -1 или > 1, то комментарий в RM006.	"NRW013 - Возможная ошибка: значение в <название поля – xml тэг> превышает 1 (100%)"
3.	Анкета договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки (CM033 – capFloor)	
3.1	Проверить значения параметров: floatingRateCalculation/initialRate floatingRateCalculation/spreadSchedule/initialValue floatingRateCalculation/capRateSchedule/initialValue floatingRateCalculation/floorRateSchedule/initialValue Если значение < -3 или > 3, то ошибка NRD234. Для индекса <i>RUB-CPI-ROSSTAT</i> , если значение < -15 или > 15, то ошибка NRD234. Если значение < -1 или > 1, то комментарий в RM006.	
4	Анкета договора свопциона (CM034 – swaption)	
4.1	Проверить значения параметров: floatingRateCalculation/initialRate floatingRateCalculation/spreadSchedule/initialValue floatingRateCalculation/capRateSchedule/initialValue floatingRateCalculation/floorRateSchedule/initialValue fixedRateSchedule/initialValue	

	Если значение < -3 или > 3, то ошибка NRD234. Если значение < -1 или > 1, то комментарий в RM006.	
5.	Анкета договора РЕПО (CM041 - repo)	
5.1	Проверить значения параметров: fixedRateSchedule/initialValue floatingRateCalculation/initialRate floatingRateCalculation/spreadSchedule/initialValue floatingRateCalculation/capRateSchedule/initialValue floatingRateCalculation/floorRateSchedule/initialValue Если значение < -3 или > 3, то ошибка NRD234. Если значение < -1 или > 1, то комментарий в RM006.	
5.2	Проверить значение параметра: cleanPrice Если значение <2, то ошибка NRD235. Если значение > 200, то комментарий в RM006.	
6.	Анкета договора купли-продажи облигации (CM042 – bondSimpleTransaction)	
6.1	Проверить значение параметра: cleanPrice Если значение <2, то ошибка NRD235. Если значение > 200, то комментарий в RM006.	
7.	Анкета договора форварда на облигацию и индекс (CM043 – bondForward)	
7.1	Проверить значение параметра: $0 \leq \text{basketPercentage} \leq 1$ Если значение < 0 или > 1, то ошибка NRD234.	
7.2	Проверить значение параметра: forwardPricePercentage Если значение <2, то ошибка NRD235. Если значение > 200, то комментарий в RM006.	
8.	Анкета договора опциона на облигацию (CM044 – bondOption)	
8.1	Проверить значение параметра: strikePercentage Если значение <2, то ошибка NRD235. Если значение > 200, то комментарий в RM006.	
9	Анкета договора опциона на индекс и корзину облигаций (индексов) (CM045 – bondBasketOption)	
9.1	Проверить значение параметра: $0 \leq \text{basketPercentage} \leq 1$ Если значение < 0 или > 1, то ошибка NRD234.	
9.2	Проверить значение параметра:	

	<p>strikePercentage</p> <p>Если значение <2, то ошибка NRD235.</p> <p>Если значение > 200, то комментарий в RM006.</p>	
10.	Анкета договора свопа дохода на облигацию (CM061 – bondSwap)	
10.1	<p>Проверить значения параметров:</p> <p>floatingRateCalculation/initialRate</p> <p>floatingRateCalculation/capRateSchedule/initialValue</p> <p>floatingRateCalculation/floorRateSchedule/initialValue</p> <p>fixedRate</p> <p>Если значение < -3 или > 3, то ошибка NRD234.</p> <p>Если значение < -1 или > 1, то комментарий в RM006.</p>	
10.2	<p>Проверить значение параметра:</p> <p>$0 \leq \text{basketPercentage} \leq 1$</p> <p>Если значение < 0 или > 1, то ошибка NRD234.</p>	
11.	Анкета договора свопа дохода на акцию (CM062 – equitySwapTransactionSupplement)	
11.1	<p>Проверить значения параметров:</p> <p>floatingRateCalculation/initialRate</p> <p>floatingRateCalculation/capRateSchedule/initialValue</p> <p>floatingRateCalculation/floorRateSchedule/initialValue</p> <p>fixedRate</p> <p>Если значение < -3 или > 3, то ошибка NRD234.</p> <p>Если значение < -1 или > 1, то комментарий в RM006.</p>	
11.2	<p>Проверить значение параметра:</p> <p>$0 \leq \text{basketPercentage} \leq 1$</p> <p>Если значение < 0 или > 1, то ошибка NRD234.</p>	
12.	Анкета договора кредитного дефолтного свопа (CM071 – creditDefaultSwap)	
12.1	<p>Проверить значение параметра:</p> <p>fixedRate</p> <p>Если значение < -3 или > 3, то ошибка NRD234.</p> <p>Если значение < -1 или > 1, то комментарий в RM006.</p>	
12.2	<p>Проверить значение параметра:</p> <p>$0 \leq \text{basketPercentage} \leq 1$</p> <p>Если значение < 0 или > 1, то ошибка NRD234.</p>	
13.	Анкета договора кредитного дефолтного свопциона (CM072 – creditDefaultSwapOption)	
13.1	<p>Проверить значение параметра:</p> <p>fixedRate</p> <p>Если значение < -3 или > 3, то ошибка NRD234.</p> <p>Если значение < -1 или > 1, то комментарий в RM006.</p>	

13.2	Проверить значение параметра: $0 \leq \text{basketPercentage} \leq 1$ Если значение < 0 или > 1 , то ошибка NRD234.	
------	---	--

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.	Анкета договора купли-продажи облигации (CM042 – bondSimpleTransaction)	
1.1	<p>Указанная цена (в %) – cleanPrice.</p> <p>Текущая цена (в %) – поиск котировки в корпоративной базе данных НРД на дату est_date по идентификатору <i>instrumentId</i>. Если инструмент не найден, проверка не выполняется.</p> <p>Если отклонение в процентах $((\text{указанная цена} - \text{текущая цена})/\text{текущая цена}) * 100 = > 20\%$, то комментарий в RM006.</p>	
2.	Анкета договора форварда на облигацию и индекс (CM043 bondForward)	
2.1	<p>Указанная цена (в валюте) – forwardPricePerBond.</p> <p>Текущая цена (в валюте) – поиск котировки в корпоративной базе данных НРД на дату est_date по идентификатору <i>instrumentId</i>. Если инструмент не найден, проверка не выполняется.</p> <p>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.</p> <p>Если отклонение в процентах $((\text{указанная цена} - \text{текущая цена})/\text{текущая цена}) * 100 = > 20\%$, то комментарий в RM006.</p>	<p>"NRW014 - Возможная ошибка: цена базового актива отклоняется от рыночной на 20%" и более</p>
2.2	<p>Указанная цена (в %) – forwardPricePercentage.</p> <p>Текущая цена (в %) – поиск котировки в корпоративной базе данных НРД на дату est_date по идентификатору <i>instrumentId</i>. Если инструмент не найден, проверка не выполняется.</p> <p>Если отклонение в процентах $((\text{указанная цена} - \text{текущая цена})/\text{текущая цена}) * 100 = > 20\%$ то комментарий в RM006.</p>	
3.	Анкета договора опциона на облигацию (CM044 – bondOption)	
3.1	<p>Указанная цена (в валюте) – strikePrice.</p> <p>Текущая цена (в валюте) – 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 $((\text{указанная цена} - \text{текущая цена})/\text{текущая цена}) * 100 = > 20\%$, то комментарий в RM006.</p>	
3.2	<p>Указанная цена (в %) – strikePercentage.</p> <p>Текущая цена (в %) – поиск котировки в корпоративной базе данных НРД на дату est_date по идентификатору <i>instrumentId</i>. Если инструмент не найден, проверка не выполняется.</p> <p>Если отклонение в процентах $((\text{указанная цена} - \text{текущая цена})/\text{текущая}$</p>	

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

2.9. Проверка даты расчетов относительно даты погашения облигации

В случае, когда дата расчетов по договору превышает дату погашения облигации, Репозиторий направляет Уведомление о расхождении в параметрах анкет (Форма RM006). Проверка выполняется только в отношении облигаций, учитываемых в НРД.

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1.	Анкета договора РЕПО (CM041 - repo)	
1.1	<p>Дата расчетов (поставки): spotLeg/settlementDate spotLeg/deliveryDate forwardLeg/settlementDate forwardLeg/deliveryDate</p> <p>Дата окончания срока действия договора: endAgreementDate.</p> <p>Дата погашения облигации (Maturity Date) – 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 > Дата погашения, то комментарий в RM006.</p>	"NRW015 - Возможная ошибка: дата окончания действия договора больше даты погашения облигации"
2.	Анкета договора купли-продажи облигации (CM042 – bondSimpleTransaction)	
2.1	Дата расчетов: settlementDate.	

	<p>Дата окончания срока действия договора: endAgreementDate.</p> <p>Дата погашения облигации (Maturity Date) – 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 > Дата погашения, то комментарий в RM006.</p>	
3.	Анкета договора форварда на облигацию и индекс (CM043 bondForward)	
3.1	<p>Дата расчетов: settlementDate.</p> <p>Дата окончания срока действия договора: endAgreementDate.</p> <p>Дата погашения облигации (Maturity Date) – 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 > Дата погашения, то комментарий в RM006.</p>	
4	Анкета договора опциона на облигацию (CM044 – bondOption)	
4.1	<p>Дата исполнения:</p> <p>americanExercise/expirationDate</p> <p>europeanExercise/expirationDate</p> <p>Дата окончания срока действия договора: endAgreementDate.</p> <p>Дата погашения облигации (Maturity Date) – 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 > Дата погашения, то комментарий в RM006.</p>	

2.10. Проверка на дубликат сообщения

Для предотвращения повторной регистрации Анкеты договора или Анкеты генерального соглашения, Репозиторий, в дополнение к текущей проверке по Коду УТИ, вводит дополнительную проверку на дубликат сообщения о договоре или генеральном соглашении, ранее зарегистрированного в Реестре договоров.

Первый этап – проверка нового сообщения на повторное направление. Сообщение сверяется с сообщениями, находящимися в состоянии ожидания при согласовании анкеты со стороны контрагента. При положительном результате (наличии повторного сообщения) участник получает уведомление о возможном дубликате.

Второй этап – проверка нового сообщения с ранее поданными сообщениями зарегистрированного договора или генерального соглашения в Реестре договоров. Если подобная информация будет найдена в Реестре договоров, участник получит уведомление о возможном дубликате.

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1.	Все анкеты, кроме bulk-отчетов CM083, CM084, CM085	
1.1	<p>Этап 1. Поиск повторного сообщения, находящего в режиме ожидания.</p> <p>1. Формируется список ранее полученных сообщений.</p> <p>2. Выбираются все Анкеты генеральных соглашений и Анкеты договоров, находящиеся в стадии ожидания, полученные от того же Отправителя, с теми же сторонами соглашения или договора, что и у нового</p>	" NRW018 - Возможен дубликат договора <Код УТИ старого договора>, <Реп.код договора сообщения>"

	<p>сообщения. Создается первичный список сообщений-кандидатов.</p> <p>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.</p> <p>4. Для каждого сообщения из полученного списка необходимо обратиться к справочной таблице 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.</p> <p>5. Если в списке сообщение найдено – формируется Уведомление о расхождении в параметрах анкет (Форма RM006).</p>	
1.2	<p>Этап 2. Поиск ранее зарегистрированного договора/генерального соглашения.</p> <p>Этот алгоритм применяется только для анкет, поданных на первичную регистрацию.</p> <p>1. Формируется список ранее зарегистрированных договоров/генеральных соглашений – кандидатов на дубликат.</p> <p>2. Выбираются все ранее зарегистрированные за последние 4 (четыре) операционных дня анкеты, со сторонами договора, что и в новом сообщении. Создается первичный список сообщений-кандидатов.</p> <p>3. Для каждого сообщения из полученного списка необходимо обратиться к справочной таблице 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.</p> <p>4. Если в списке сообщение найдено – формируется Уведомление о расхождении в параметрах анкет (Форма RM006).</p>	

2.11. Проверки соблюдения сроков предоставления отчетов CM093 и CM094

Процедуры запускаются согласно расписанию в рамках регламентных процедур операционного дня.

2.11.1. Проверка сроков отчетности по CM093

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1.	Анкета о состоянии обязательств по договорам (Форма CM093)	" NRW016 -
1.1	<p>Процедура запускается ежедневно в рабочие дни для выявления просрочки отчетности по дерегистрации договоров, а также предупреждения о необходимости предоставления такой отчетности.</p> <p>1. Производится выборка из реестра основных параметров (репозитарный номер договора, тип договора, Сторона1, Сторона2, дата окончания срока действия) по всем анкетам, которые удовлетворяют условиям:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Тип договора: CM021-CM081. • Дата окончания срока действия договора (см. примечание 1) + 3 рабочих дня <= текущая дата операционного дня. • Договор открыт (Статус = 'С', 'Е', 'О' или 'Р'). • Флаг автоматического закрытия договора не установлен (CONTRACTS.AUTO_EXECUTE! = 'Y') или статус не равен 'О' 	<p>Возможная просрочка отчетности обязательств по договорам <список договоров (репозитарный номер договора, дата окончания срока действия договора)>. Для закрытия договоров необходимо отправить CM093".</p>

	<p>(договор открыт).</p> <p>2. Для каждого отобранного договора осуществляется поиск Информирующего лица для указанных сторон(ы).</p> <p>3. Для каждого найденного Информирующего лица формируется Уведомление о расхождении в параметрах анкет (Форма RM006) со списком договоров, которые могут быть просрочены завтра или уже просрочены.</p>	
--	--	--

2.11.2. Проверка сроков отчетности по CM094

№	Описание проверки	Описание расхождений в RM006 (комментарий)
1.	Отчет о расчете справедливой (оценочной) стоимости (Форма CM094)	
1.1	<p>Процедура запускается ежемесячно на 4-ый рабочий день месяца и направлена на предупреждение о необходимости предоставления отчетности по справедливой стоимости за предыдущий месяц.</p> <p>Алгоритм работы процедуры:</p> <p>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:</p> <ul style="list-style-type: none"> • 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 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). <p>2. Для каждого отобранного договора осуществляется поиск Информирующего лица, наделенного на текущий момент полномочиями на регистрацию CM094 для указанных сторон(ы).</p> <p>3. Для каждого найденного Информирующего лица формируется Уведомление о расхождении в параметрах анкет (Форма RM006) со списком договоров, отчетность справедливой/оценочной стоимости по которым могла быть просрочена.</p>	<p>"NRW017 - Возможная просрочка отчетности справедливой/оценочной стоимости по договорам. <список договоров (номер договора, дата окончания действия договора)>. Для закрытия договоров необходимо отправить CM094"</p>

Приложение 1

к Инструкции по работе
сервиса форматно-логического контроля

Алгоритм выбора даты окончания действия договора в зависимости от его типа

№	Тип договора	Поле, используемое для проверки
1	Анкета договора валютного свопа (СМ021)	farLeg/valueDate
2	Анкета договора валютного форварда (СМ022)	valueDate
3.	Анкета договора валютного опциона (СМ023)	expiryDate
4.	Анкета договора бинарного валютного опциона (СМ024)	expiryDate
5.	Анкета соглашения о будущей процентной ставке (СМ031)	paymentDate, adjustedTerminationDate
6.	Анкета договора процентного свопа (СМ032)	terminationDate
7.	Анкета договора фиксации максимальной/минимальной процентной ставки (СМ033)	terminationDate
8	Анкета договора свопциона (СМ034)	expirationDate, terminationDate
11.	Анкета договора форварда на облигацию и индекс (СМ043)	settlementDate
12	Анкета договора опциона на облигацию (СМ044)	expirationDate
13	Анкета договора опциона на индекс и корзину облигаций (СМ045)	expirationDate
15.	Анкета договора форварда на акцию (СМ047)	expirationDate
16.	Анкета договора опциона на акцию (СМ048)	expirationDate
17.	Анкета договора товарного форварда (СМ051)	paymentDates, deliveryPeriods
18.	Анкета договора товарного опциона (СМ052)	expirationDate
19.	Анкета договора товарного свопа (СМ053)	terminationDate
20.	Анкета договора товарного свопциона (СМ054)	expirationDate, expirationDates
21.	Анкета договора свопа дохода на облигацию (СМ061)	interestLegPaymentDates, paymentDates
22.	Анкета договора свопа дохода на акцию (СМ062)	interestLegPaymentDates, paymentDates
23.	Анкета договора кредитного дефолтного свопа (СМ071)	scheduledTerminationDate
24.	Анкета договора кредитного дефолтного свопциона (СМ072)	expirationDate
25	Анкета иной сделки (СМ081)	settlementDate

Приложение 2

к Инструкции по работе
сервиса форматно-логического контроля

Справочник кодов,

используемых при направлении Уведомления о расхождении в параметрах анкет (Форма 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 3 (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_IN_MESSAGE	Информация, содержащая сведения о договоре, занесена в журнал учета сообщений Репозитория позднее 3 (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 действия договора> меньше <название поля>	Possible error: the chronological sequence of dates in the message might have been violated: <Contract 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_COPY_DUPLICATE	Возможен дубликат договора <Код UTI старого договора>, <Реп.код договора сообщения>	Possible agreement duplicate договора <Code UTI of old agreement>, <Repository code of the old agreement>