

Утверждено
Приказом НКО АО НРД
от 25 мая 2018 г. № 95

ПОРЯДОК РАСЧЕТА ОБОБЩЕННЫХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ
РЕПОЗИТАРИЕМ НКО АО НРД

Оглавление

1. Термины и определения	3
2. Общие положения.....	3
3. Основные принципы расчета Обобщенных показателей.....	4
4. Особенности расчета обобщенных показателей по видам договоров	6
Приложение №1.....	22

1. Термины и определения

- 1.1. **Дата публикации** – дата публикации Обобщенных показателей на Сайте.
- 1.2. **Обобщенные показатели** – предоставляемые Репозитарием сведения, содержащие расчетные данные за Отчетную дату о количестве и общем размере (объеме) обязательств каждого вида договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров и подлежит раскрытию в соответствии с Порядком.
- 1.3. **Отчетный период** – календарный месяц, в котором заключен договор, информация о котором была предоставлена в Репозитарий.
- 1.4. **Порядок** – Порядок расчета обобщенных показателей Репозитарием НКО АО НРД.
- 1.5. **Регулятор** – Центральный банк Российской Федерации (Банк России).
- 1.6. **Реестр договоров Репозитария** - электронная база данных Репозитария, предназначенная для учета сведений о договорах, заключенных не на организованных торгах, и генеральных соглашениях (если договоры заключены на условиях генеральных соглашений).
- 1.7. **Репозитарий** – Небанковская кредитная организация акционерное общество «Национальный расчетный депозитарий» (НКО АО НРД).
- 1.8. **Сайт** – официальный сайт Репозитария в сети Интернет по адресу: www.nsd.ru.
- 1.9. Иные термины используются в значениях, установленных законодательством Российской Федерации Правилами оказания репозитарных услуг Репозитария НКО АО НРД и Договором об обмене электронными документами.

2. Общие положения

- 2.1. Настоящий Порядок разработан в целях исполнения Репозитарием требований Федерального закона «О рынке ценных бумаг» и Указания Банка России от 22.12.2017 № 4660-У «Об объеме и порядке раскрытия информации репозитарием».
- 2.2. Порядок определяет правила расчета Обобщенных показателей и устанавливает порядок и сроки их раскрытия Репозитарием. Настоящий Порядок применяется Репозитарием к расчету Обобщенных показателей начиная с апреля 2018 года.
- 2.3. Изменения в Порядок вносятся Репозитарием в одностороннем порядке с соблюдением сроков и процедур, установленных нормативными актами Регулятора.
- 2.4. Порядок и все изменения к нему подлежат опубликованию на Сайте. Репозитарий публикует новую редакцию Порядка или изменений к нему за 2 (два) месяца до вступления новой редакции или изменений в силу. Сроки публикации могут быть сокращены в случае, если изменения в Порядок обусловлены изменениями в законодательстве Российской Федерации, нормативных правовых актов Российской Федерации, нормативных актах Регулятора.

- 2.5. Заинтересованные в получении информации лица самостоятельно отслеживают публикацию соответствующих сообщений Репозитарием.
- 2.6. Репозитарий публикует рассчитанные Обобщенные показатели на Сайте в хронологическом порядке не позднее 7 (седьмого) рабочего дня после окончания Отчетного периода.
- 2.7. Если суммарное количество договоров, составляющих группу договоров, входящих в состав Обобщенных показателей по итогам Отчетного периода, не превышает 10 (десяти), то их совокупный объем не раскрывается.
- 2.8. Репозитарий не вносит изменения в размещенные на Сайте Обобщенные показатели в случае, если сведения о заключении договора или его изменении были внесены в Реестр договоров Репозитария после Даты публикации.
- 2.9. Обобщенные показатели публикуются в виде отчета по форме Приложения № 1 к Порядку.
- 2.10. Репозитарий обеспечивает доступ к Обобщенным показателям, всем заинтересованным лицам круглосуточно (за исключением периодов проведения технических работ) без взимания платы и иных ограничений.
- 2.11. Репозитарий обеспечивает доступ заинтересованным лицам к Обобщенным показателям в течение 3 лет с даты ее раскрытия.
- 2.12. В случае возникновения причин, препятствующих доступу к Обобщенным показателям, Репозитарий в соответствии с внутренними документами, регламентирующими порядок действий сотрудников НКО АО НРД при возникновении внештатных ситуаций, принимает меры, направленные на устранение таких причин и осуществляет информирование клиентов о причине, дате и времени прекращения (ограничения) доступа к Обобщенным показателям, а также о предполагаемой дате и времени его возобновления.

3. Основные принципы расчета Обобщенных показателей.

- 3.1. Обобщенные показатели рассчитываются в отношении договоров, сведения о которых внесены в Реестр договоров Репозитария за Отчетный период, в том числе в отношении договоров, расчеты по которым завершены.
- 3.2. Совокупное количество заключенных договоров определяется как сумма количества договоров указанного вида.
- 3.3. Совокупный объем заключенных договоров определяется как сумма объемов договоров указанного вида.
- 3.4. Совокупный объем по виду договоров рассчитывается в рублевом эквиваленте, определенном по официальному курсу, установленному Регулятором по дате заключения договоров.
- 3.5. Обобщенные показатели не рассчитываются по договорам, расчеты по которым осуществляются в валюте, для которой Регулятором не установлен официальный курс.
- 3.6. Обобщенные показатели рассчитываются совокупно по следующим видам договоров:

№	Группа Договоров	Вид договоров	Наименование формы	Код формы
1.	Договоры репо	Все виды договоров репо	repo, repoBulkReport	CM041, CM083
2.	Производные финансовые инструменты, базисным активом которых является наступление обстоятельства, являющегося кредитным событием	Все виды производных финансовых инструментов, базисным активом которых является наступление обстоятельства, являющегося кредитным событием	creditDefaultSwap, creditDefaultSwaption	CM071, CM072
3.	Производные финансовые инструменты, базисным активом которых является валюта	Конверсионные договоры, форвардные договоры, валютные своп-договоры	fxSwap, fxSwapBulkReport, fxSingleLeg, fxSingleLegBulkReport	CM021, CM084, CM022, CM085
		Оptionные договоры	fxOption fxDigitalOption	CM023, CM024
4.	Производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются процентные ставки	Процентные своп-договоры, соглашения о будущей процентной ставке	fra, swap	CM031, CM032
		Оptionные договоры, включая договоры, базисным активом которых является максимальная и минимальная процентная ставка	capFloor, swaption	CM033, CM034
5.	Производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются ценные бумаги	Форвардные договоры, базисным активом которых являются облигации, форвардные договоры, базисным активом которых являются акции, своп-договоры на акции	bondForward, equityForward, bondSwap, equitySwap	CM043, CM047, CM061, CM062
		Оptionные договоры, базисным активом которых являются облигации (или корзина облигаций), опционные договоры, базисным активом которых являются акции	bondOption, basketBondOption, equityOption	CM044, CM045, CM048
6.	Производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются товары	Форвардные договоры, товарные своп-договоры	commodityForward, commoditySwap	CM051, CM053
		Оptionные договоры	commodityOption, commoditySwaption	CM052, CM054
7.	Иные договоры	Договоры, являющиеся производными финансовыми инструментами, содержащие условия, не предусмотренные указанными выше видами	generalProduct	CM081

№	Группа Договоров	Вид договоров	Наименование формы	Код формы
		договоров		

4. Особенности расчета обобщенных показателей по видам договоров

4.1. Валютный своп (fxSwap)

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

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:fxSwap/fpml:nearLeg/fpml:exchangedCurrency1/fpml:paymentAmount/fpml:currency nsdext:fxSwapBulkReport/nsdext:swaps/ nsdext:swapDetails/nsdext:currencies - c1	Первоначальный платеж по валютному свопу / Валюта 1 / Сумма платежа / Валюта суммы	Валюта 1.
2	fpml:fxSwap/fpml:nearLeg/fpml:exchangedCurrency1/fpml:paymentAmount/fpml:amount nsdext:fxSwapBulkReport/nsdext:swaps/ nsdext:swapDetails/nsdext:nearLeg - c1	Первоначальный платеж по валютному свопу / Валюта 1 / Сумма платежа / Сумма денежных средств	Сумма первоначального платежа в валюте 1.
3	fpml:fxSwap/fpml:nearLeg/fpml:exchangedCurrency2/fpml:paymentAmount/fpml:currency nsdext:fxSwapBulkReport/nsdext:swaps/ nsdext:swapDetails/nsdext:currencies - c2	Первоначальный платеж по валютному свопу / Валюта 2 / Сумма платежа / Валюта суммы	Валюта 2.
4	fpml:fxSwap/fpml:nearLeg/fpml:exchangedCurrency2/fpml:paymentAmount/fpml:amount nsdext:fxSwapBulkReport/nsdext:swaps/ nsdext:swapDetails/nsdext:nearLeg - c2	Первоначальный платеж по валютному свопу / Валюта 2 / Сумма платежа / Сумма денежных средств	Сумма первоначального платежа в валюте 2.

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

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

4.2. Конверсионная сделка / валютный форвард (fxSingleLeg)

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

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:fxSingleLeg/fpml:exchangedCurrency1/ fpml:paymentAmount/fpml:currency	Валюта 1 / Сумма платежа / Валюта суммы	Валюта 1.

	nsdext:fxSingleLegBulkReport/nsdext:singleLegs/ nsdext:singleLegDetails/nsdext:currencies - c1		
2	fpml:fxSingleLeg/fpml:exchangedCurrency1/ fpml:paymentAmount/fpml:amount nsdext:fxSingleLegBulkReport/nsdext:singleLegs/ nsdext:singleLegDetails/nsdext:singleLeg - c1	Валюта 1 / Сумма платежа / Сумма денежных средств	Сумма платежа в валюте 1
3	fpml:fxSingleLeg/fpml:exchangedCurrency2/ fpml:paymentAmount/fpml:currency nsdext:fxSingleLegBulkReport/nsdext:singleLegs/ nsdext:singleLegDetails/nsdext:currencies - c2	Валюта 2 / Сумма платежа / Валюта суммы	Валюта 2.
4	fpml:fxSingleLeg/fpml:exchangedCurrency2/ fpml:paymentAmount/fpml:amount nsdext:fxSingleLegBulkReport/nsdext:singleLegs/ nsdext:singleLegDetails/nsdext:singleLeg - c2	Валюта 2 / Сумма платежа / Сумма денежных средств	Сумма платежа в валюте 2

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

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

4.3. Валютный опцион (fxOption)

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

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

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

4.3.3. Если «Сумма в валюте на продажу» и «Сумма в валюте на покупку» выражены в иностранной валюте, то выбирается «Сумма в валюте на продажу» (п. 2) и переводится в российские рубли по официальному курсу

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

4.4. Валютный бинарный опцион (fxDigitalOption)

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

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

4.4.2. В качестве объема договора используется значение исходного параметра «Сумма выплаты по бинарному опциону». Если сумма выплаты установлена в иностранной валюте, то указанное значение переводится в российские рубли по официальному курсу Регулятора, установленному на дату заключения договора.

4.5. Соглашение о будущей процентной ставке (fra)

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

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

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

4.6. Процентный своп (swap)

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

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

	fpml:calculation/fpml:notionalSchedule/ fpml:notionalStepSchedule/fpml:currency	расчета суммы / График номинальной суммы / График значений номинальной суммы / Валюта	суммы.
3	fpml:swap/fpml:swapStream[1]/ fpml:calculationPeriodAmount/ fpml:calculation/fpml:fxLinkedNotionalSch edule/fpml:initialValue	Платежи по свопу / Сумма расчетного периода / Параметры расчета суммы / График номинальной суммы, привязанной к валютному курсу / Начальное значение номинальной суммы	Номинальная сумма, привязанная к валютному курсу.
4	fpml:swap/fpml:swapStream[1]/ fpml:calculationPeriodAmount/ fpml:calculation/fpml:fxLinkedNotionalSch edule/fpml:varyingNotionalCurrency	Платежи по свопу / Сумма расчетного периода / Параметры расчета суммы / График номинальной суммы, привязанной к валютному курсу / Валюта переменной номинальной суммы	Валюта переменной номинальной суммы.
5	fpml:swap/fpml:swapStream[1]/ fpml:calculationPeriodAmount/fpml:known AmountSchedule/fpml:initialValue	Платежи по свопу / Сумма расчетного периода / График известных сумм / Начальное значение	Фиксированная сумма.
6	fpml:swap/fpml:swapStream[1]/ fpml:calculationPeriodAmount/fpml:known AmountSchedule/fpml:currency	Платежи по свопу / Сумма расчетного периода / График известных сумм / Начальное значение / Валюта суммы	Валюта фиксированной суммы.

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

4.6.3. Если соответствующая сумма – «Валюта номинальной суммы» (п. 2), «Валюта переменной номинальной суммы» (п. 4) или «Валюта фиксированной суммы» (п. 6) установлена в иностранной валюте, то сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Регулятора, установленному на дату заключения договора.

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

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

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:capFloor/fpml:capFloorStream/ fpml:calculationPeriodAmount/ fpml:calculation/fpml:notionalSchedule/ fpml:notionalStepSchedule/fpml:initialValu e	Платежи по сделке кэп/флор / Сумма расчетного периода / Параметры расчета суммы / График номинальной суммы / График значений номинальной суммы / Начальное значение	Номинальная сумма.
2	fpml:capFloor/fpml:capFloorStream/ fpml:calculationPeriodAmount/ fpml:calculation/fpml:notionalSchedule/	Платежи по сделке кэп/флор / Сумма расчетного периода / Параметры расчета суммы /	Валюта номинальной суммы.

	fpml:notionalStepSchedule/fpml:currency	График номинальной суммы / График значений номинальной суммы / Валюта	
3	fpml:capFloor/fpml:capFloorStream/ fpml:calculationPeriodAmount/ fpml:calculation/fpml:fxLinkedNotionalSchedule/fpml:initialValue	Платежи по сделке кэп/флор / Сумма расчетного периода / Параметры расчета суммы / График номинальной суммы, привязанной к валютному курсу / Начальное значение номинальной суммы	Номинальная сумма, привязанная к валютному курсу.
4	fpml:capFloor/fpml:capFloorStream/ fpml:calculationPeriodAmount/ fpml:calculation/fpml:fxLinkedNotionalSchedule/fpml:varyingNotionalCurrency	Платежи по сделке кэп/флор / Сумма расчетного периода / Параметры расчета суммы / График номинальной суммы, привязанной к валютному курсу / Валюта переменной номинальной суммы	Валюта переменной номинальной суммы.

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

4.7.3. Если соответствующая сумма – «Валюта номинальной суммы» (п. 2) или «Валюта переменной номинальной суммы» (п. 4) – установлена в иностранной валюте, то сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Регулятора, установленному на дату заключения договора.

4.8. Процентный свопцион (swaption)

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

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

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

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

4.8.3. Если соответствующая сумма – «Валюта номинальной суммы» (п. 2), «Валюта переменной номинальной суммы» (п. 4) или «Валюта фиксированной суммы» (п. 6) установлена в иностранной валюте, то выбранная сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Регулятора, установленному на дату заключения договора.

4.9. Договор РЕПО (repo)

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

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

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

4.10. Договор купли-продажи облигации (bondSimpleTransaction)

4.10.1. Для расчета Обобщенных показателей по Договору купли-продажи облигаций (bondSimpleTransaction) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	nsdext:bondSimpleTransaction/ fpml:notionalAmount/fpml:currency	Номинальная сумма / Валюта суммы	Валюта совокупной номинальной

			стоимости.
2	nsdext:bondSimpleTransaction/ fpml:amount	Номинальная сумма / Сумма	Совокупная номинальная стоимость договора. ¹

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

4.11. Форвард на облигации (bondForward)

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

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

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

4.12. Опцион на облигации (bondOption)

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

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

¹ В соответствии с рекомендациями в данном поле указывается расчетная сумма, получаемая как количество облигаций, умноженное на начальную номинальную стоимость одной облигации.

² В соответствии с рекомендациями в данном поле указывается: в случае форварда на облигации – расчетная сумма, получаемая путем умножения количества облигаций по договору на начальную номинальную стоимость одной облигации; в случае форварда на корзину облигаций – расчетная сумма, получаемая путем умножения количества корзин по договору на начальную стоимость одной корзины; в случае форварда на индекс – расчетная сумма, получаемая путем умножения значения индекса на дату заключения договора в индексных пунктах на мультипликатор индекса (стоимость 1 пункта индекса в соответствии со спецификацией) либо совокупная стоимость договора на дату его заключения в соответствии с данными бухгалтерского учета.

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

fpml:amount		
-------------	--	--

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

4.13. Опцион на корзину облигаций (basketBondOption)

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

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	nsdext:bondBasketOption/ fpml:notionalAmount/fpml:curren cy	Номинальная сумма / Валюта суммы	Валюта совокупной номинальной стоимости.
2	nsdext:bondBasketOption/ fpml:notionalAmount/fpml:amoun t	Номинальная сумма / Сумма	Совокупная номинальная стоимость договора. ⁴

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

4.14. Договор купли-продажи акции (equitySimpleTransaction)

4.14.1. Для расчета Обобщенных показателей по Договору купли-продажи акций (equitySimpleTransaction) используются следующие параметры:

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	nsdext:equitySimpleTransaction/ fpml:ext:numberOfUnits	Количество единиц	Количество акций.
2	nsdext:equitySimpleTransaction/ fpml:ext:unitPrice/fpml:curren cy	Цена за единицу / Валюта суммы	Валюта цены акции.
3	nsdext:equitySimpleTransaction/ fpml:ext:unitPrice/fpml:amoun t	Цена за единицу / Сумма	Цена одной акции.
4	Расчетный параметр	Расчетный параметр	Общая стоимость акций. Рассчитывается как произведение количества акций (п. 1) и цены одной акции (п. 3).

4.14.2. В качестве объема договора используется значение расчетного параметра «Общая стоимость акций». Если «Валюта цены акции» установлена в иностранной валюте, то сумма переводится в российские рубли по

⁴ В соответствии с рекомендациями в данном поле указывается: в случае опциона на корзину облигаций – расчетная сумма, получаемая путем умножения количества опционов на количество корзин и на начальную стоимость одной корзины; в случае опциона на корзину индексов – расчетная сумма, получаемая путем умножения количества опционов на значение индекса на дату заключения договора в индексных пунктах и на мультипликатор индекса (стоимость 1 пункта индекса в соответствии со спецификацией) либо совокупная стоимость договора на дату его заключения в соответствии с данными бухгалтерского учета.

официальному курсу Регулятора, установленному на дату заключения договора.

4.15. Форвард на акции (equityForward)

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

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

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

4.15.3. Если «Валюта форвардной цены» установлена в иностранной валюте, то сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Регулятора, установленному на дату заключения договора.

4.16. Опцион на акции (equityOption)

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

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:equityOption/fpml:underlyer/fpml:singleUnderlyer/fpml:openUnits	Базовый актив / Единичный базовый актив / Лот актива	Количество акций.
2	fpml:equityOption/fpml:underlyer/fpml:basket/fpml:openUnits	Базовый актив / Корзина / Число единиц активов	Количество корзин.
3	fpml:equityOption/fpml:strike/fpml:currency	Цена исполнения / Валюта	Валюта цены исполнения.
4	fpml:equityOption/fpml:strike/fpml:strikePrice	Цена исполнения / Цена исполнения	Цена исполнения за единицу базового актива.
5	Расчетный параметр	Расчетный параметр	Общая стоимость акций. Рассчитывается как

			произведение количества акций (п. 1) и цены исполнения за единицу базового актива (п. 4).
6	Расчетный параметр	Расчетный параметр	Общая стоимость корзин. Рассчитывается как произведение количества корзин (п. 2) и цены исполнения за единицу базового актива (п. 4).

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

4.16.3. Если «Валюта цены исполнения» установлена в иностранной валюте, то «Общая стоимость акций/корзин» переводится в российские рубли по официальному курсу Регулятора, установленному на дату заключения договора.

4.17. Товарный форвард (commodityForward)

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

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

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

4.18. Товарный опцион (commodityOption)

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

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	fpml:commodityOption/ fpml:totalNotionalQuantity	Общее номинальное количество	Общее номинальное количество базового актива.
2	fpml:commodityOption/ fpml:strikePricePerUnit/fpml:amount	Цена страйк на единицу товара / Сумма денежных средств	Цена исполнения за единицу измерения базового актива.
3	fpml:commodityOption/ fpml:strikePricePerUnit/fpml:currency	Цена страйк на единицу товара / Валюта суммы	Валюта цены исполнения.
4	fpml:commodityOption/ fpml:weatherNotionalAmount/ fpml:currency	Номинальная сумма погодного контракта / Валюта суммы	Валюта номинальной суммы погодного опциона.

5	fpml:commodityOption/ fpml:weatherNotionalAmount/ fpml:amount	Номинальная сумма погодного контракта / Сумма денежных средств	Номинальная сумма погодного опциона.
6	fpml:commodityOption/ fpml:weatherIndexStrikeLevel/ fpml:quantity	Уровень страйк погодного индекса / Количество пунктов	Цена исполнения погодного опциона (количество пунктов погодного индекса).
7	Расчетный параметр	Расчетный параметр	Общая стоимость товарного опциона. Рассчитывается как произведение общего номинального количества (п. 1) и цены исполнения за единицу измерения базового актива (п. 2).
8	Расчетный параметр	Расчетный параметр	Общая стоимость погодного опциона. Рассчитывается как произведение номинальной суммы погодного опциона (п. 5) и цены исполнения погодного опциона (п. 6).

4.18.2. В качестве объема договора используется значение расчетного параметра «Общая стоимость товарного опциона» (п. 7) либо расчетного параметра «Общая стоимость погодного опциона» (п. 8) – в зависимости от того, какой из параметров – «Общее номинальное количество базового актива» (п. 1) или «Номинальная сумма погодного опциона» (п. 5) – указан в договоре.

4.18.3. Если соответствующая указанному параметру валюта – «Валюта цены исполнения» (п. 3) или «Валюта номинальной суммы погодного опциона» (п. 4) установлена в иностранной валюте, то сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Регулятора, установленному на дату заключения договора.

4.19. Товарный своп (commoditySwap)

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

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

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

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

4.19.3. Если соответствующая сумме - «Валюта, в которой выражена цена товара [1]» (п. 1) «Валюта, в которой выражена цена товара [2]» (п. 4) «Валюта,

в которой выражена сумма фиксированных платежей» (п. 11) или «Валюта номинальной суммы погодного свопа» (п. 7) установлена в иностранной валюте, то сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Регулятора, установленному на дату заключения договора.

4.20. Товарный свопцион (commoditySwaption)

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

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

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

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

4.20.3. Если соответствующая сумма – «Валюта, в которой выражена цена товара [1]» (п. 1), «Валюта, в которой выражена цена товара [2]» (п. 4), «Валюта, в которой выражена сумма фиксированных платежей» (п. 11) или «Валюта номинальной суммы погодного свопа» (п. 7) – установлена в иностранной валюте, то сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Регулятора, установленному на дату заключения договора.

4.21. Своп дохода на облигации (bondSwap)

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

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

4.21.2. В качестве объема договора используется значение параметра «Номинальная сумма» (п. 2). Если данный параметр отсутствует,

используется значение параметра «Номинальная сумма (вариант выбора «Суммы дохода от облигации»)» (п. 4).

4.21.3. Если соответствующая выбранной сумме «Валюта номинальной суммы» (п. 1 или п. 3) установлена в иностранной валюте, то сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Регулятора, установленному на дату заключения договора.

4.22. Своп дохода на акции (equitySwap)

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

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

4.22.2. В качестве объема договора используется значение параметра «Номинальная сумма» (п. 2). Если данный параметр отсутствует, используется значение параметра «Номинальная сумма (вариант выбора «Суммы дохода от актива»)» (п. 4).

4.22.3. Если соответствующая выбранной сумме «Валюта номинальной суммы» (п. 1 или п. 3) установлена в иностранной валюте, то сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Регулятора, установленному на дату заключения договора.

4.23. Кредитный дефолтный своп (creditDefaultSwap)

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

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

4.23.2. В качестве объема договора используется значение параметра «Номинальная сумма». Если «Валюта номинальной суммы» установлена в иностранной валюте, то сумма переводится в российские рубли по

официальному курсу Регулятора, установленному на дату заключения договора.

4.24. Кредитный свопцион (creditDefaultSwaption)

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

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

4.24.2. В качестве объема договора используется значение параметра «Номинальная сумма». Если «Валюта номинальной суммы» установлена в иностранной валюте, то сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Регулятора, установленному на дату заключения договора.

4.25. Иные договоры (generalProduct)

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

№	Параметр (xpath)	Название параметра	Описание
1	nsdext:generalProduct/nsdext:party1Obligations/nsdext:nominalAmount/fpml:currency	Валюта суммы обязательств	Валюта суммы обязательств по договору Стороны1
2	nsdext:generalProduct/nsdext:party1Obligations/nsdext:nominalAmount/fpml:amount	Сумма обязательств	Сумма обязательств по договору Стороны1
3	nsdext:generalProduct/nsdext:party2Obligations/nsdext:nominalAmount/fpml:currency	Валюта суммы обязательств	Валюта суммы обязательств по договору Стороны2
4	nsdext:generalProduct/nsdext:party2Obligations/nsdext:nominalAmount/fpml:amount	Сумма обязательств	Сумма обязательств по договору Стороны2

4.25.2. В качестве объема договора используется значение параметра «Сумма обязательств» Стороны1 или «Сумма обязательств» Стороны2. Если «Сумма обязательств» установлена в иностранной валюте, то сумма переводится в российские рубли по официальному курсу Регулятора, установленному на дату заключения договора.

Приложение №1
к Порядку расчета обобщенных
показателей Репозитарием НКО АО
НРД

Обобщенные показатели Репозитария НКО АО НРД за

(период предоставления)

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

	которых являются облигации (или корзина облигаций), опционные договоры, базисным активом которых являются акции (bondOption, basketBondOption, equityOption)		
6.	Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются товары»		
6.1.	Форвардные договоры, товарные своп-договоры (commodityForward, commoditySwap)		
6.2.	Опционные договоры (commodityOption, commoditySwaption)		
7.	Группа договоров «Иные договоры»		
7.1.	Иные договоры		