



РЕКОМЕНДАЦИИ К СОСТАВУ ДАННЫХ ДЛЯ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ УК, СД и НПФ

Дата составления: 19.07.2017

Версия 5



ИСТОРИЯ ИЗМЕНЕНИЙ

Версия	Дата	Автор	Комментарии
1	30.08.2016	Мезенцев Е., Кузнецов А.	Разработана первая версия документа
2	09.09.2016	Мезенцев Е., Кузнецов А.	Учтены комментарии сообщества к первой версии документа, добавлен раздел с введением и описанием операций
3	30.09.2016	Мезенцев Е., Кузнецов А.	Изменено название документа, пересмотрена колонка «Заполнение» с учетом комментариев сообщества
4	18.10.2016	Кузнецов А.	Добавлены описания для форматов схем сообщений
5	29.06.2017	Мезенцев Е.	Добавлены дополнительные поля в таблицы Контрагенты, Финансовые инструменты, Операции с ФИ. Добавлены таблицы Справедливая стоимость ФИ, Ставки дисконтирования и амортизированная стоимость. Добавлено описание шапки файла
6	19.07.2017	Мезенцев Е.	Учтены замечания по результатам собрания



Оглавление

ИСТОРИЯ ИЗМЕНЕНИЙ	2
1 Общая информация.....	5
1.1 Принятые сокращения и термины	5
1.2 Введение	6
1.3 Заголовок файлов	12
2 Раздел «Справочная информация (классификаторы и списки)»	13
2.1 Договоры доверительного управления	13
2.2 Виды финансовых инструментов	14
2.3 Финансовые инструменты	15
2.4 Торговые площадки	20
2.5 Контрагенты	21
2.6 Договоры с контрагентами	24
2.7 Банковские счета	25
2.8 Управляющая компания	25
2.9 Брокерские счета	26
3 Раздел «Операции с финансовыми инструментами»	27
4 Раздел «Неторговые операции»	31
4.1 Типы операций	31
4.2 Операции.....	32
5 Раздел «Данные для расчетов»	34
5.1 Виды котировок	34
5.2 Котировки.....	35
5.3 Купонные расписания	36
5.4 Графики денежного потока по финансовым инструментам	37
5.5 Справедливая стоимость финансовых инструментов	38
5.6 Ставки дисконтирования и амортизированная стоимость на дату	39
6 Раздел «Данные по кредитным рейтингам»	40
6.1 Рейтинговые агентства	40
6.2 Шкалы рейтингов	41
6.3 Значения рейтингов	42
6.4 Значения прогнозов рейтингов	43
6.5 Рейтинги финансовых инструментов.....	44
6.6 Рейтинги контрагентов.....	45
6.7 Рейтинги банков	46



7	Раздел «Прочие списки и классификаторы».....	47
7.1	История изменения объема выпуска	47
7.2	История признания бумаг обращающимися/ не обращающимися на ОРЦБ	48
7.3	История включения/исключения в биржевые торги	49
7.4	Отрасли.....	50
8	Раздел «Бухгалтерские проводки»	51
8.1	Бухгалтерские проводки	51
8.2	Аналитические признаки бухгалтерских счетов	54



1 Общая информация

1.1 Принятые сокращения и термины

Сокращение/термин	Описание
НФО	Некредитные финансовые организации
УК	Управляющая компания
СД	Специализированный депозитарий
НПФ	Негосударственный пенсионный фонд
ДС	Денежные средства
ДПУ	Документы первичного учета
ДУ	Доверительное управление
Р/С	Расчетный счет

1.2 Введение

Данный документ содержит верхнеуровневое описание интеграционных потоков, структуры и состава передаваемых сведений между системами учета операций с инвестиционными инструментами управляющих компаний, спец. депозитариев и негосударственных пенсионных фондов, в целях отражения в бухгалтерском учете и финансовой отчетности негосударственных пенсионных фондов операций с инвестициями, находящимися в доверительном управлении у управляющих компаний.

Взаимодействие УК и НПФ осуществляется на основании регламентных документов:

№ п/п	Наименование документа	Передающая сторона	Носитель	Периодичность
1	Договор ДУ (в том числе инвестиционная декларация)	НПФ и УК	Бумажный	Разовый, по мере необходимости
2	Инвестиционная стратегия	НПФ	Бумажный	Разовый, по мере необходимости
3	Учетная политика	НПФ	Бумажный	Ежегодно
4	Методика определения справедливой стоимости	НПФ	Бумажный	Ежегодно

Информационный обмен по составу данных, рекомендованному настоящим документам, осуществляется на основании договоров / соглашений об информационном обмене, заключаемых между негосударственным пенсионным фондом и управляющей компанией либо специализированным депозитарием, предоставляющими услуги управления инвестиционными активами фонда.

Источником информации являются, как правило, данные первичного учета, регистрируемые в системе учета инвестиционной деятельности управляющей компании / специализированного депозитария, из которой в соответствии с соглашениями об информационном обмене регулярно передаются в систему учета негосударственного пенсионного фонда сведения об инвестиционных инструментах, сделках с ними, платежных операциях, а также дополнительные сведения при наличии соглашения и соответствующей исходной информации в системе – источнике.

Информационный обмен по основным объектам учета и часто меняющимся справочникам происходит в виде регулярных выгрузок из системы-источника по заданному расписанию, либо по команде пользователя. В пакет выгрузки включаются записи по объектам учета вновь созданные и изменившиеся после предыдущего сеанса выгрузки. Прием выгруженных данных происходит по событию появления нового пакета данных из системы – источника.

Направление на выгрузку объектов учета производится, как правило, при возникновении бизнес-событий (операций) определенных типов, приводящих к изменениям данных учета инвестиционных инструментов.



Основаниями для передачи данных (объектов учета) в рамках информационного обмена рассматриваются следующие основные операции с инвестиционными инструментами и связанные с ними первичные документы – основания для проведения операций:

№	Вид операции для Управляющей компании (УК)	Комментарий по существу операции	Документ первичного учета (ДПУ)
1.	Поступление денежных средств (ДС) в управление (начисление)	Возникновение обязанности Фонда по передаче ДС в управление УК	Акт приема-передачи денежных средств в управление между УК и Фондом
2.	Поступление ДС в управление (факт)	Фактическое зачисление ДС на расчетный счет(Р/С) с назначением платежа «передача ДС в управление»	Выписка с р/с, открытого УК в обеспечение деятельности по договору ДУ
3.	Вывод ДС из управления (начисление)	Возникновение обязанности УК по возврату учредителю управления ДС	Акт приема-передачи денежных средств из управления между УК и Фондом
4.	Вывод ДС из управления (факт)	Фактическое списание ДС с р/с с назначением платежа «возврат учредителю управления ДС»	Выписка с р/с, открытого УК в обеспечение деятельности по договору ДУ
5.	Передача активов в управление (начисление)	Возникновение обязанности Фонда по передаче активов в управление УК	Акт между УК и Фондом
6.	Передача активов в управление (факт)	Фактическая перерегистрация активов при их передаче от учредителя управления	Выписка со счета Депо, открытого УК в обеспечение деятельности по договору ДУ; выписка Регистратора; индоссамент по векселю; выписка ЕГРП, Справка о внесении изменений в ЕГРЮЛ
7.	Возврат активов из управления (начисление)	Возникновение обязательств по возврату активов учредителю управления	Акт между УК и Фондом
8.	Передача активов в управление (факт)	Фактическая перерегистрация активов при их возврате учредителю управления	Выписка со счета Депо, открытого УК в обеспечение деятельности по договору ДУ; выписка Регистратора; индоссамент по векселю; выписка ЕГРП (для недвижимости), Справка о внесении изменений в ЕГРЮЛ (для долей)
9.	Задолженность по сделке: ДС (начисление)	Возникновение требований или обязательств по оплате ДС в	Для биржевых сделок – отчет брокера; для



		зависимости от направления связанной сделки	внебиржевых сделок, депозитов и займов – договор.
10.	Исполнение сделки: ДС (факт)	Фактическое списание/зачисление ДС в зависимости от направления связанной сделки	Для биржевых сделок – отчет брокера; для внебиржевых сделок, депозитов и займов – выписка с банковского счета
11.	Задолженность по сделке: активы (начисление)	Возникновение требований или обязательств по поставке активов в зависимости от направления связанной сделки	Для биржевых сделок – отчет брокера; для внебиржевых сделок, депозитов и займов – договор.
12.	Исполнение сделки: активы (факт)	Фактическая перерегистрация активов в зависимости от направления связанной сделки	Для биржевых сделок – отчет брокера; для внебиржевых сделок – выписка со счета ДЕПО, выписка Регистратора, индоссамент по векселю, выписка ЕГРП (для недвижимости), Справка о внесении изменений в ЕГРЮЛ (для долей); для депозитов и займов – выписка с банковского счета
13.	Начисление комиссии по сделке	Возникновение обязательств по оплате комиссий и расходов, напрямую связанных со сделкой (комиссии брокера, биржи, посредника, банка, регистратора и пр.)	Для биржевых сделок – отчет брокера; для внебиржевых сделок – договор, акты и счета; для депозитов и займов – договор.
14.	Оплата комиссии по сделке	Фактическое исполнение обязательств по оплате комиссий и расходов, напрямую связанных со сделкой (комиссии брокера, биржи, посредника, банка, регистратора и пр.)	Для биржевых сделок – отчет брокера; для внебиржевых сделок, депозитов и займов – выписка с банковского счета
15.	Начисление доходов от владения	Возникновение права по получению доходов от владения (дивиденды, распределение прибыли по долям)	Решение общего собрания эмитента или учредителей
16.	Получение доходов от владения	Фактическое получение ДС на р/с по доходам от владения (дивиденды, распределение прибыли по долям)	Выписка с р/с, открытого УК в обеспечение деятельности по договору ДУ
17.	Начисление налога на доходы от владения	Возникновение обязательств по уплате налога на рассчитанные доходы от владения (дивиденды, распределение прибыли по долям)	Решение общего собрания эмитента или учредителей



18.	Оплата налога на доходы от владения	Фактическое списание ДС с р/с по оплате налога на доходы от владения	Выписка с банковского счета
19.	Начисление прочих расходов	Возникновение обязательств по оплате комиссий и расходов, напрямую не связанных со сделками (депозитарные услуги, услуги страховщика, оценщика, аудитора и др.).	Договоры, акты, счета
20.	Оплата прочих расходов	Фактическое исполнение обязательств по оплате комиссий и расходов, напрямую не связанных со сделками.	Выписка с банковского счета
21.	Начисление прочих доходов	Возникновение права по получению доходов, для которых не определены отдельные операции (доходы от аренды недвижимости, др.)	Договоры, акты, счета
22.	Оплата прочих доходов	Фактическое зачисление ДС на р/с от доходов, для которых не определены отдельные операции	Выписка с банковского счета
23.	Начисление вознаграждения	Возникновение требований по оплате вознаграждения управляющего	Договор ДУ, бухгалтерская справка
24.	Оплата вознаграждения	Фактическое зачисление ДС на р/с УК или списание ДС с р/с, открытого УК в обеспечение деятельности по договору ДУ, с назначением «оплата вознаграждения управляющего»	Выписка с банковского счета
25.	Возврат аванса (начисление)	Возникновение обязательств по возврату излишне оплаченного авансами вознаграждения управляющего по итогам окончательных расчетов	Акт между УК и Фондом
26.	Возврат аванса (факт)	Фактическое списание ДС с р/с УК или зачисление ДС на р/с, открытый УК в обеспечение деятельности по договору ДУ, с назначением «возврат аванса по вознаграждению управляющего»	Выписка с банковского счета
27.	Движение ДС по р/с (перевод между счетами)	Фактическое поступление/списание ДС на/с расчетный счет, открытый УК в обеспечение деятельности по договору ДУ, кроме платежей, для которых определены отдельные операции.	Выписка с р/с, открытого УК в обеспечение деятельности по договору ДУ



28.	Перерегистрация активов (перевод между счетами и разделами)	Фактическое поступление/списание активов по операциям, для которых не определены отдельные виды.	Выписка со счета Депо, открытого УК в обеспечение деятельности по договору ДУ; выписка Регистратора; др.
29.	Процентный доход по активам (начисление)	Возникновение права на получение процентного дохода по активам	Для выпусков облигаций - расписание купонных платежей; для депозитов и займов - договор
30.	Процентный доход по активам (факт)	Фактическое поступление ДС в виде процентного дохода по активам	Отчет брокера или выписка с р/с, открытого УК в обеспечение деятельности по договору ДУ
31.	Погашение активов (начисление)	Возникновение права на получение сумм от погашения активов	Для выпусков облигаций - расписание погашений номинала
32.	Погашение активов (факт)	Фактическое поступление ДС от погашения активов	Отчет брокера или выписка с р/с, открытого УК в обеспечение деятельности по договору ДУ

Информация из Условно-постоянных справочников передается при появлении их обновлений разовыми сеансами выгрузки - загрузки, по инициативе системы-источника.

Разделы документа содержат описание передаваемых в электронных сообщениях (документах) объектов учета и их реквизитов.

Каждый объект учета содержит уникальный идентификатор, присваиваемый системой – источником данных. Идентификатор может быть использован системой – получателем для синхронизации справочников и классификаторов.

Каждый объект дополняется технологическими реквизитами, позволяющими отличить вновь созданную запись, редактируемую запись, удаляемую запись.

До начала работы регулярного интеграционного процесса производится разовая загрузка полного содержания справочников для дальнейшего сопоставления данных.

В следующих разделах приведено описание объектов учета и их реквизитов (рекомендованный состав данных), передаваемых в адрес негосударственного пенсионного фонда в рамках информационного взаимодействия по доверительному управлению инвестиционными инструментами.

На Рис. 1 представлена схема обмена данными между информационными системами УК, НПФ и спец. депозитария. В рамках задачи обмена данными по доверительному управлению предполагается постоянный обмен справочной информацией и информацией о совершенных операциях между информационными системами бухгалтерского и оперативного учета НПФ, УК и спец. депозитария. В зависимости от текущей степени автоматизации компании, информация по операциям с инвестициями может содержаться в одной или нескольких системах: системе бухгалтерского учета или системе оперативного учета инвестиций.

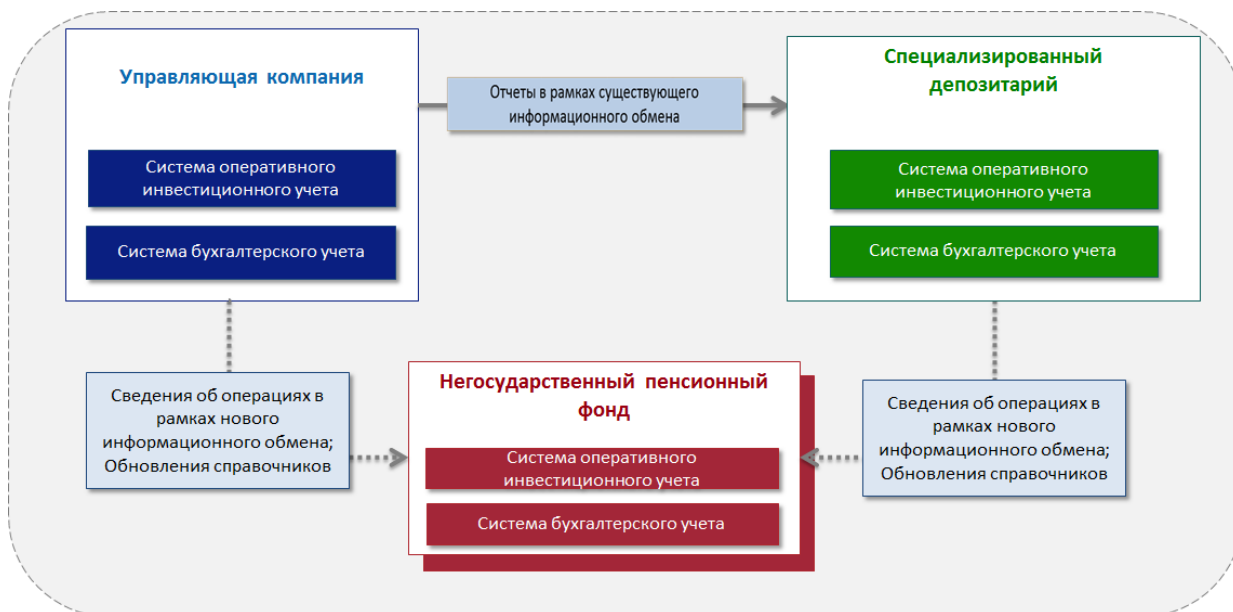


Рис. 1. Схема обмена данными между информационными системами управляющей компании, спец. депозитария и НПФ

1.3 Заголовок файлов

В файлах с информацией по доверительному управлению, которые подготавливает управляющая компания, рекомендуется указывать шапку следующего формата для идентификации данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Версия файла	Версия файла. Следует использовать, если передавались несколько версий файла с данными за один период	Текстовый		Рекомендовано	FileVersion
Наименование отправителя	Наименование организации отправителя	Текстовый		Обязательно	CompanyName
ИНН отправителя	ИНН организации отправителя	Числовой		Рекомендовано	CompanyINN
КПП отправителя	КПП организации отправителя	Числовой		Рекомендовано	CompanyKPP
Номер договора ДУ	Номер договора доверительного управления	Текстовый		Рекомендовано	AgreementNo
Наименование получателя	Наименование организации получателя	Текстовый		Обязательно	ClientName
ИНН получателя	ИНН организации получателя	Числовой		Рекомендовано	ClientINN
КПП получателя	КПП организации получателя	Числовой		Рекомендовано	ClientKPP
Дата подготовки файла	Дата подготовки файла	ууууmmdd hhmmss		Рекомендовано	DateCreate
Дата начала периода данных	Дата начала периода, за который предоставлены данные	Дата		Обязательно	DateStart
Дата окончания периода данных	Дата окончания периода, за который предоставлены данные	Дата		Обязательно	DateEnd

2 Раздел «Справочная информация (классификаторы и списки)»

2.1 Договоры доверительного управления

Описание:

Список договоров доверительного управления (портфели), в том числе портфель собственного размещения (для целей загрузки данных от специализированного депозитария).

Требования к предоставлению информации: Обязательное предоставление

Периодичность предоставления информации: Разовое предоставление при изменениях

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код договора доверительного управления	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Наименование	Наименование договора доверительного управления	Текстовый		Обязательно	Name
Управляющая компания	Уникальный код управляющей компании	Текстовый		Обязательно	UKCode
Негосударственный пенсионный фонд	Уникальный код негосударственного пенсионного фонда	Текстовый		Рекомендовано	ExtFundCode
Наименование негосударственного пенсионного фонда	Наименование негосударственного пенсионного фонда	Текстовый		Рекомендовано	FundName
Вид средств	Вид средств, переданных в доверительное управление для целей отдельного учета пенсионных резервов, пенсионных накоплений и собственных средств или имущества, предназначенного для осуществления уставной деятельности. Например, <ul style="list-style-type: none"> • ПР – пенсионные резервы • ПН – пенсионные накопления • СС – собственные средства 	Текстовый		Рекомендовано	FundsKind

2.2 Виды финансовых инструментов

Описание:

Классификатор возможных видов финансовых инструментов по видам

Требования к предоставлению информации: Обязательное предоставление

Периодичность предоставления информации: Разовое предоставление при изменениях

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код вида финансового инструмента	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Наименование	Наименование вида финансового инструмента	Текстовый		Обязательно	Name
Группа вида финансового инструмента	Уникальный код вышестоящего Вида финансового инструмента в иерархии справочника УК/СД. Не указывается для верхнего уровня иерархии	Текстовый		Обязательно, если применимо	ParentGroup

2.3 Финансовые инструменты

Описание:

Список финансовых инструментов

Требования к предоставлению информации: Обязательное предоставление

Периодичность предоставления информации: На регулярной основе

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код финансового инструмента	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Вид финансового инструмента	Уникальный код вида финансового инструмента	Текстовый		Рекомендовано	FIKindCode
Краткое наименование	Краткое наименование финансового инструмента	Текстовый		Обязательно	ShortName
Полное наименование	Полное наименование финансового инструмента	Текстовый		Обязательно	Name
Валюта	Цифровой код валюты финансового инструмента в соответствии с Общероссийским классификатором валют	Текстовый		Обязательно	CurrencyCode
Дата погашения	Дата погашения финансового инструмента	Дата		Рекомендовано	RepaymDate
Данные, применимые только для вида финансовых инструментов - ценных бумаг					
Номер государственной регистрации	Номер государственной регистрации ценной бумаги	Текстовый		Рекомендовано	RegistrNo
ISIN	Международный идентификационный код ценной бумаги	Текстовый		Рекомендовано	ISIN

Номинал	Номинал финансового инструмента (ценной бумаги) при выпуске	Числовой		Рекомендовано	PrincipAmount
Эмитент	Уникальный код эмитента (контрагента)	Текстовый		Рекомендовано	IssuerCode
Выпуск серия	Выпуск или серия ценной бумаги	Текстовый		Рекомендовано	Series
Дата выпуска	Дата выпуска финансового инструмента	Дата		Рекомендовано	IssueDate
Объем выпуска в штуках	Первоначальный объем выпуска финансового инструмента в штуках	Числовой		Рекомендовано	IssueVolume
Объем выпуска в валюте номинала	Первоначальный объем выпуска финансового инструмента в валюте номинала	Числовой		Рекомендовано	IssueAmount
Дата начала размещения	Дата начала размещения финансового инструмента	Дата		Рекомендовано	PlaceStrartDate
Индексируемый номинал	Признак, является ли финансовый инструмент долговой ценной бумагой с индексируемым номиналом	Числовой	0 - Нет 1 - Да	Рекомендовано	IndexPrincipAmount
ПФИ	Производный финансовый инструмент	Числовой	0 – Нет 1 - Да	Рекомендовано	DerivativeFI
Вид ПФИ	Вид производного финансового инструмента	Числовой	1. Фьючерс 2. Форвард 3. Опцион 4. Своп	Рекомендовано	DerivativeFIType
ПФИ, используемые для хеджирования	ПФИ, используемые для хеджирования	Числовой	0 – Нет 1 – Да	Рекомендовано	DerivativeFIForHedging
Встроенный ПФИ	Встроенный производный финансовый инструмент	Числовой	0 – Нет 1 – Да	Рекомендовано	BuiltInDerivativeFI
Код типа ценной бумаги	Код типа ценной бумаги в соответствии с формой ОКУД 0420415	Текстовый	BON1 - облигации, эмитированные федеральными органами исполнительной власти Российской Федерации, и облигации Банка России;	Обязательно	FITypeCode

			<p>BON2 - облигации, эмитированные органами исполнительной власти субъектов Российской Федерации и муниципальных образований;</p> <p>BON3 - облигации кредитных организаций - резидентов;</p> <p>BON4 - облигации прочих резидентов;</p> <p>BON5 - облигации иностранных государств и облигации иностранных центральных банков;</p> <p>BON6 - облигации банков-нерезидентов;</p> <p>BON7 - облигации прочих нерезидентов;</p> <p>DS1 - депозитные сертификаты кредитных организаций - резидентов;</p> <p>DS2 - депозитные сертификаты банков-нерезидентов;</p> <p>SS1 - сберегательные сертификаты кредитных организаций - резидентов;</p> <p>SS2 - сберегательные сертификаты банков-нерезидентов;</p> <p>SHS1 - акции кредитных организаций - резидентов (обыкновенные);</p> <p>SHS2 - акции кредитных организаций - резидентов (привилегированные);</p> <p>SHS3 - акции прочих резидентов (обыкновенные);</p> <p>SHS4 - акции прочих резидентов (привилегированные);</p> <p>SHS5 - акции банков-нерезидентов;</p> <p>SHS6 - акции прочих нерезидентов;</p> <p>SHS7 - паи, доли инвестиционных фондов - нерезидентов;</p> <p>SHS8 - паи, доли инвестиционных фондов - резидентов;</p> <p>BIL1 - векселя федеральных органов исполнительной власти Российской Федерации;</p> <p>BIL2 - векселя органов исполнительной власти субъектов Российской Федерации и муниципальных образований;</p> <p>BIL3 - векселя кредитных организаций - резидентов;</p> <p>BIL4 - векселя прочих резидентов;</p> <p>BIL5 - векселя иностранного государства;</p> <p>BIL6 - векселя банков-нерезидентов;</p> <p>BIL7 - векселя прочих нерезидентов;</p> <p>DR - депозитарные расписки;</p> <p>CON - складское свидетельство;</p> <p>WTS - варранты;</p> <p>OPN - опционы эмитента;</p>		
--	--	--	---	--	--

			ENC - закладные; KSU - клиринговые сертификаты участия; ISU - ипотечные сертификаты участия; OTHER - иное (в том числе иностранные финансовые инструменты, не квалифицированные в качестве ценных бумаг).		
Данные, применимые только для вида финансовых инструментов – депозитов и займов					
Эффективная ставка процента	Эффективная ставка процента (указывается только для депозитов и займов)	Числовой		Рекомендовано	EIR
Минимальное значение рыночной ставки	Минимальное значение диапазона рыночной ставки (профессиональное суждение). Если процентная ставка по договору ниже значения минимальной рыночной ставки, то в качестве эффективной ставки процента принимается минимальная рыночная процентная ставка	Числовой		Рекомендовано	MinRate
Максимальное значение рыночной ставки	Максимальное значение диапазона рыночной ставки (профессиональное суждение). Если процентная ставка по договору выше значения максимальной рыночной ставки, то в качестве эффективной ставки процента принимается максимальная рыночная процентная ставка	Числовой		Рекомендовано	MaxRate
Классификация при первоначальном признании	Классификация финансового инструмента при первоначальном признании (значение по умолчанию для депозитов и займов)	Числовой		Рекомендовано	CategoryFI
Номер банковского счета	Уникальный код банковского (депозитного) счета	Текстовый		Рекомендовано	BankAccNo

Дата начала расчета процентов	Дата начала расчета процентов	Дата		Рекомендовано	PercStartDate
Контрагент	Уникальный код контрагента	Текстовый		Рекомендовано	ContractorCode
Договор с контрагентом	Уникальный код договора с контрагентом	Текстовый		Рекомендовано	ContrAgrCode
Пополняемый депозит	Признак, определяющий, является ли депозит пополняемым	Числовой	0 - Не пополняемый 1 – Пополняемый	Рекомендовано	RecurrDeposit
Способ начисления процентов	Способ начисления процентов	Числовой	0 - Простой (без капитализации) 1 - Сложный (с капитализацией)	Рекомендовано	PercBasis
Срок капитализации процентов	Сроки капитализации процентов	Числовой	0 – Ежемесячно 1 – Ежеквартально 2 – Ежегодно	Рекомендовано	CapitalPeriod
Периодичность выплаты процентов	Признак определяет периодичность выплаты процентов. Например, 1 - ежемесячно 2 - ежеквартально 3 - ежегодно 4 - по полугодиям 5 - в конце срока 6 - в дату размещения	Числовой		Рекомендовано	PercPayPeriod



2.4 Торговые площадки

Описание:

Список торговых площадок

Требования к предоставлению информации: Обязательное предоставление

Периодичность предоставления информации: Разовое предоставление при изменениях

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код торговой площадки	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Наименование	Наименование торговой площадки	Текстовый		Обязательно	Name
Биржевая площадка	Признак, определяющий, является ли торговая площадка биржевой	Числовой	0 - нет 1 - да	Обязательно	StockKind

2.5 Контрагенты

Описание:

Список контрагентов, эмитентов, брокеров, депозитариев, банков

Требования к предоставлению информации: Обязательное предоставление

Периодичность предоставления информации: На регулярной основе

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код контрагента	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Тип контрагента	Тип контрагента	Числовой	0 - юридическое лицо 1 – Индивидуальный Предприниматель 2 - физическое лицо	Обязательно	IndivEnterpr
Краткое наименование	Краткое наименование контрагента	Текстовый		Обязательно	ShortName
Полное наименование	Полное наименование контрагента	Текстовый		Обязательно	Name
ИНН	Идентификационный номер налогоплательщика	Числовой		Обязательно, если применимо	INN
КПП	Код причины постановки на учет	Числовой		Рекомендовано	KPP
Отрасль	Уникальный код отрасли (отраслевой группы), к которой относится контрагент	Числовой		Рекомендовано	BranchCode
Нерезидент	Признак, является ли контрагент нерезидентом	Числовой	0 - нерезидент 1 - резидент	Обязательно	Resident
Юридический адрес	Юридический адрес контрагента	Текстовый		Рекомендовано	LegalAddress
Фактический адрес	Фактический адрес контрагента	Текстовый		Рекомендовано	FactAddress
Почтовый адрес	Почтовый адрес контрагента	Текстовый		Рекомендовано	PostalAddress
Регистрационный номер	ОГРН или ОГРНИП эмитента-резидента	Текстовый		Рекомендовано	OGRN

TIN Иностранного контрагента	Идентификационный номер налогоплательщика эмитента – нерезидента	Текстовый		Рекомендовано	TIN
Классификация	Классификация контрагента, например <ul style="list-style-type: none"> • 1 - Российская Федерация • 2 – Субъекты РФ и органы местного самоуправления • 3 – Кредитные организации • 4 – Прочие резиденты • 5 – Иностранное государства • 6 – Банки-нерезиденты • 7 - Прочие нерезиденты 	Числовой		Рекомендовано	Category
ОКАТО	ОКАТО	Текстовый		Рекомендовано	ОКАТО
ОКСМ	ОКСМ	Текстовый		Рекомендовано	ОКСМ
ОКТМО	ОКТМО	Текстовый		Рекомендовано	ОКТМО
Фамилия	Фамилия физического лица	Текстовый		Рекомендовано	LastName
Имя	Имя физического лица	Текстовый		Рекомендовано	FirstName
Дата рождения	Дата рождения физического лица	Дата		Рекомендовано	BirthDate
Идентификационные документы	Серия и номер паспорта или иного удостоверения личности	Текстовый		Рекомендовано	IdentificationNo
Кредитная	Кредитная или некредитная	Числовой	0 – Нет 1 - Да	Рекомендовано	CreditOrganization
Некоммерческая	Некоммерческая или коммерческая	Числовой	0 – Нет 1 - Да	Рекомендовано	Non-profit
Финансовая организация	Финансовая организация	Числовой	0 – нефинансовая организация 1 – финансовая организация	Рекомендовано	Financial
Вид государственного управления	Вид государственного управления	Числовой	1 - Федеральное казначейство 2 - Финансовые органы 3 - Внебюджетные фонды	Рекомендовано	GovernmentType
ОКФС	Код ОКФС	Числовой		Рекомендовано	OKFS
ОКВЭД	Код ОКВЭД	Числовой		Рекомендовано	OKVED
ОКОГУ	Код ОКОГУ	Числовой		Рекомендовано	OKGU

Код сектора экономики	Код сектора экономики из формы ОКУД 0420415	Текстовый	<p>S11 - нефинансовые организации; S111 - нефинансовые государственные организации; S112 - другие нефинансовые организации; S121 - Центральный банк Российской Федерации; S122 - кредитные организации; S124 - инвестиционные фонды; S125 - другие финансовые организации (за исключением страховщиков и негосударственных пенсионных фондов); S1251 - государственные финансовые корпорации; S128 - страховщики; S129 - негосударственные пенсионные фонды; S13 - сектор государственного управления; S131 - федеральные органы государственной власти; S132 - органы государственной власти субъектов Российской Федерации; S133 - органы местного самоуправления; S134 - внебюджетные фонды; S14 - население и некоммерческие организации, обслуживающие население; S2 - нерезиденты.</p>	Рекомендовано	EconomySectorCode
-----------------------	--	-----------	--	---------------	-------------------

2.6 Договоры с контрагентами

Описание:

Список договоров с контрагентами

Требования к предоставлению информации: Обязательное предоставление

Периодичность предоставления информации: На регулярной основе

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код договора с контрагентом	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Контрагент	Уникальный код контрагента	Текстовый		Обязательно	ContractorCode
Договор доверительного управления	Уникальный код договора ДУ, который заключен между УК/СД и Фондом (портфель), в рамках которого заключен договор	Текстовый		Обязательно	TrustAgrCode
Вид договора	Определяет направление договора	Числовой	0 - договор с поставщиком 1 - договор с покупателем	Рекомендовано	TransType
Дополнительное соглашение	Определяет, является ли договор основным или это дополнительное соглашение	Числовой	0 - договор 1 – дополнительное соглашение	Обязательно	AgrSupplType
Содержание	Текст содержания (предмет) договора	Текстовый		Обязательно	Description
Номер	Номер договора	Текстовый		Обязательно	AgreementNo
Дата заключения	Дата заключения договора	Дата		Рекомендовано	AgreementDate
Дата начала действия	Дата начала действия договора	Дата		Обязательно	StartDate
Дата окончания действия	Дата окончания действия договора	Дата		Рекомендовано	ExpireDate
Валюта	Цифровой код валюты договора в соответствии с Общероссийским классификатором валют	Текстовый		Обязательно	AgrCurrencyCode
Валюта расчетов	Цифровой код валюты расчетов по договору в соответствии с Общероссийским классификатором валют	Текстовый		Рекомендовано	PayCurrencyCode

2.7 Банковские счета

Описание:

Список банковских счетов

Требования к предоставлению информации: Обязательное предоставление

Периодичность предоставления информации: На регулярной основе

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код банковского счета	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Вид	Виды банковских счетов. Произвольный классификатор	Числовой		Обязательно	AccKindCode
БИК	Банковский идентификационный код	Текстовый		Обязательно	BIC
Номер	Номер банковского счета (расчетного, депозитного счета)	Текстовый		Обязательно	AccountNo
Валюта	Цифровой код валюты банковского счета в соответствии с Общероссийским классификатором валют	Текстовый		Обязательно	CurrencyCode
Дата открытия	Дата открытия банковского счета	Дата		Обязательно	OpeningDate
Дата закрытия	Дата закрытия банковского счета	Дата		Обязательно, если применимо	ClosingDate
Контрагент	Уникальный код контрагента (банка)	Текстовый		Рекомендовано	ContractorCode

2.8 Управляющая компания

Описание:

Справочная информация об управляющей компании

Требования к предоставлению информации: Обязательное предоставление

Периодичность предоставления информации: Разовое предоставление при изменениях

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код управляющей компании	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Сокращенное наименование	Сокращенное наименование управляющей компании	Текстовый		Обязательно	ShortName
Полное наименование	Полное наименование управляющей компании	Текстовый		Обязательно	Name
ИНН	ИНН управляющей компании	Текстовый		Обязательно	INN
КПП	КПП управляющей компании	Текстовый		Обязательно	KPP

2.9 Брокерские счета

Описание:

Список брокерских счетов

Требования к предоставлению информации: Обязательное предоставление

Периодичность предоставления информации: На регулярной основе

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код брокерского счета в системе УК/СД	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Код	Клиентский код (номер брокерского счета)	Текстовый		Обязательно	AccountNo
Валюта	Цифровой код валюты брокерского счета в соответствии с Общероссийским классификатором валют по умолчанию	Текстовый		Рекомендовано	CurrencyCode
Дата открытия	Дата открытия брокерского счета	Дата		Обязательно	OpeningDate
Дата закрытия	Дата закрытия брокерского счета	Дата		Обязательно, если применимо	ClosingDate
Контрагент	Уникальный код контрагента (брокера)	Текстовый		Рекомендовано	ContractorCode

3 Раздел «Операции с финансовыми инструментами»

Раздел содержит в себе описание торговых операций (сделок) с финансовыми инструментами. Первичным документом является отчет брокера и договоры по внебиржевым сделкам.

Описание:

Список операций покупки и продажи финансовых инструментов

Требования к предоставлению информации: Обязательное предоставление

Периодичность предоставления информации: На регулярной основе

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код сделки/документа	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Финансовый инструмент	Уникальный код финансового инструмента	Текстовый		Обязательно	FICode
Тип операции	Тип операции с финансовым инструментом	Текстовый	0 - покупка 1 – продажа	Обязательно	TransType
Режим торгов	Режим торгов	Числовой	0 - T0 1 - T+	Обязательно, если применимо	CalculationsType
Торговая площадка	Уникальный код торговой площадки	Текстовый		Обязательно	TradingFICode
Дата и время	Дата и время сделки	Дата Время		Обязательно	TradeDateTime
Внешний номер сделки	Внешний номер сделки (биржевой номер или номер договора)	Текстовый		Обязательно, если применимо	DocumentNo
Количество	Количество финансовых инструментов, участвующих в сделке	Числовой		Обязательно	Quantity
Цена	Цена финансового инструмента в абсолютном выражении	Числовой		Рекомендовано, если применимо	Price
Валюта	Цифровой код валюты сделки в соответствии с Общероссийским классификатором валют	Текстовый		Обязательно	CurrencyCode

Сумма	Сумма сделки в валюте сделки	Числовой		Обязательно	Amount
НКД	Начисленный купонный доход	Числовой		Рекомендовано, если применимо	ACI
Контрагент	Уникальный код контрагента (или брокера) по сделке	Текстовый		Обязательно	ContractorCode
Договор с контрагентом	Уникальный код договора с контрагентом по сделке	Текстовый		Обязательно	ContrAgrCode
Брокер	Уникальный код брокера (контрагента)	Текстовый		Рекомендовано, если применимо	BrokerCode
Договор с брокером	Уникальный код договора с брокером	Текстовый		Рекомендовано, если применимо	BrokerAgrCode
Брокерский счет	Уникальный код брокерского счета	Текстовый		Рекомендовано, если применимо	BrokerAccCode
Валюта комиссии биржи	Цифровой код комиссии биржи в соответствии с Общероссийским классификатором валют	Текстовый		Рекомендовано, если применимо	TFCommCurrency Code
Комиссия биржи	Комиссия биржи с НДС в валюте комиссии биржи	Числовой		Рекомендовано, если применимо	TFCommAmount
Валюта комиссии брокера	Код валюты комиссии брокера	Текстовый		Рекомендовано, если применимо	BrCommCurrency Code
Сумма комиссии брокера	Сумма комиссии брокера в валюте комиссии брокера	Числовой		Рекомендовано, если применимо	BrCommAmount
Комментарий	Текстовый комментарий к сделке	Текстовый		Рекомендовано	Description
Дата оплаты	Дата оплаты финансового инструмента	Дата		Обязательно	PayDate
Дата поставки	Дата поставки финансового инструмента	Дата		Обязательно	DelivDate
Тип РЕПО	Тип операции РЕПО	Числовой	0 - нет 1 – Прямое 2 – Обратное 3 – Двойное РЕПО (короткая позиция)	Обязательно	REPOTrade
Сделка первой части РЕПО	Для сделок РЕПО указывается уникальный код сделки первой части РЕПО	Текстовый		Рекомендовано	REPO1Code
Дата исполнения второй части РЕПО	Плановая дата исполнения 2 части сделки РЕПО	Дата		Рекомендовано	REPO2PlanDate

Цена исполнения второй части сделки РЕПО	Цена исполнения второй части сделки РЕПО	Числовой		Рекомендовано	REPO2Amount
Договор доверительного управления	Уникальный код договора, который заключен между УК/СД и НПФ (портфель), в рамках которого совершена торговая операция	Текстовый		Обязательно	TrustAgrCode
Адресность сделки	Признак адресности сделки	Числовой	0 - Нет 1 – Да	Обязательно	Address
Эффективная ставка процента	Эффективная ставка процента	Числовой		Рекомендовано	EIR
Минимальное значение рыночной ставки	Минимальное значение диапазона рыночной ставки (профессиональное суждение). Если процентная ставка по договору ниже значения минимальной рыночной ставки, то в качестве эффективной ставки процента принимается минимальная рыночная процентная ставка	Числовой		Рекомендовано	MinRate
Максимальное значение рыночной ставки	Максимальное значение диапазона рыночной ставки (профессиональное суждение). Если процентная ставка по договору выше значения максимальной рыночной ставки, то в качестве эффективной ставки процента принимается максимальная рыночная процентная ставка	Числовой		Рекомендовано	MaxRate
Классификация при первоначальном признании	Классификация ценных бумаг при первоначальном признании,	Числовой	IAS 39 1 - Ценные бумаги, оцениваемые по справедливой стоимости через прибыль или убыток 2 - Долговые ценные бумаги, удерживаемые до погашения ценные бумаги 3 - Имеющиеся в наличии для продажи 4 - Долговые ценные бумаги (включая векселя), учитываемые по амортизированной стоимости (кроме долговых ценных бумаг, удерживаемых до погашения) IFRS 9	Обязательно.	CategoryFI

			<p>5- Ценные бумаги, оцениваемые по амортизированной стоимости;</p> <p>6 - Ценные бумаги, оцениваемые по справедливой стоимости через прочий совокупный доход;</p> <p>7 - Ценные бумаги, оцениваемые по справедливой стоимости через прибыль или убыток.</p>		
Цена (процент от номинала)	Цена финансового инструмента в процентах от номинала	Числовой		Рекомендовано	PercNomPrice
Подкатегория ценной бумаги по IAS 39	Подкатегория ценной бумаги по IAS 39	Числовой	<p>1 - Ценные бумаги, удерживаемые для торговли;</p> <p>2 - Ценные бумаги, классифицируемые как оцениваемые по справедливой стоимости, изменения которой отражаются в составе прибыли или убытка при первоначальном признании;</p>	Обязательно.	SubCategoryIAS39
Подкатегория ценной бумаги по IFRS 9	Подкатегория ценной бумаги по IFRS 9	Числовой	<p>1 - В обязательном порядке классифицируемые как оцениваемые по справедливой стоимости через прибыль или убыток</p> <p>2 - Классифицируемые как оцениваемые по справедливой стоимости через прибыль или убыток по усмотрению организации</p>	Обязательно.	SubCategoryIFRS9
Тип инвестиций	Тип инвестиций		<p>1 – Ассоциированное предприятие</p> <p>2 – Совместно контролируемое предприятие</p> <p>3 – Дочернее предприятие</p>	Обязательно.	

4 Раздел «Неторговые операции»

В этом разделе описываются операции по финансовым инструментам, не связанным с покупкой и продажей, операции движения денежных средств и финансовых активов, прочие операции в рамках договора доверительного управления.

4.1 Типы операций

Описание:

Список типов операций, определяющих экономический смысл операции и методику отражения операций в бухгалтерском учете

Требования к предоставлению информации: Обязательное предоставление

Периодичность предоставления информации: Разовое предоставление при изменениях

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код типа операции	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Наименование	Наименование типа операции	Текстовый		Обязательно	Name
Группа	Уникальный код вышестоящего типа операции в иерархии	Текстовый		Обязательно, если применимо	ParentGroup

4.2 Операции

Описание:

Список операций и параметров операций. Первичные документы - выписки банка, бухгалтерские справки.

Требования к предоставлению информации: Обязательное предоставление

Периодичность предоставления информации: На регулярной основе

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный номер операции	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Договор доверительного управления	Уникальный код договора доверительного управления, который заключен между УК/СД и НПФ (портфель)	Текстовый		Обязательно	TrustContrCode
Тип операции	Уникальный код типа операции	Текстовый		Обязательно	OperTypeCode
Финансовый инструмент	Уникальный код финансового инструмента. Заполняется для операций, связанных с финансовыми инструментами	Текстовый		Обязательно, если применимо	FICode
Операция с финансовым инструментом	Уникальный код сделки/документа. Заполняется для операций, связанных с покупкой и продажей финансовых инструментов	Текстовый		Обязательно, если применимо	TradeCode
Банковский счет отправителя	Уникальный код банковского счета Отправителя. Заполняется, если проходит операция по движению денежных средств	Текстовый		Обязательно, если применимо	PayerBankAccCode
Банковский счет получателя	Уникальный код банковского счета Получателя. Заполняется, если проходит операция по перемещению денежных средств между своими расчетными счетами	Текстовый		Обязательно, если применимо	ReceiverBankAccCode
Внешний номер документа	Внешний номер документа по операции. Для операций движения денежных средств - номер платежного документа (по нумерации контрагента). Для операций поставки/списания - номер акта или иного документа, подтверждающего поставку/продажу	Текстовый		Рекомендовано	DocumentNo
Дата	Дата учета операции	Дата		Обязательно	PostDate
Описание	Описание из документа (например, для платежного документа = назначение платежа)	Текстовый		Рекомендовано	Description
Количество	Количество финансовых инструментов по операции Заполняется только для операций, связанных с финансовыми инструментами	Числовой		Обязательно, если применимо	Quantity
Валюта	Цифровой код валюты операции в соответствии с Общероссийским классификатором валют	Текстовый		Обязательно, если применимо	CurrencyCode



Сумма	Сумма операции покупки/продажи/оплаты в валюте самой операции (договора, сделки, банковского счета и прочего)	Числовой		Обязательно	Amount
Контрагент	Уникальный код контрагента по операции	Текстовый		Обязательно, если применимо	ContractorCode
Договор с контрагентом	Уникальный код договора с контрагентом по операции	Текстовый		Обязательно, если применимо	ContrAgrCode
Статья движения денежных средств	Номер строки отчета о потоках денежных средств (Приложения 7, 8 к Положению Банка России N 527-П в редакции 4273-У) Обязательно для заполнения по операциям движения средств на расчетных счетах.	Текстовый		Обязательно, если применимо	CashFlowCode

5 Раздел «Данные для расчетов»

В этом разделе описывается дополнительная информация, необходимая для проведения расчетов и начислений по финансовым инструментам, а также для подготовки примечаний к бухгалтерской отчетности.

5.1 Виды котировок

Описание:

Список видов котировок, например, «Рыночная цена (1)», «Рыночная цена (3)», «Минимальная цена», «Максимальная цена» и т.д.

Требования к предоставлению информации: **Опциональное** предоставление (при наличии договоренности о предоставлении данных сведений управляющей компанией)

Периодичность предоставления информации: Разовое предоставление при изменениях

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код вида котировки	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Наименование	Наименование вида котировки	Текстовый		Обязательно	Name

5.2 Котировки

Описание:

Список значений биржевых котировок и расчетных цен по каждому финансовому инструменту на дату

Требования к предоставлению информации: Опциональное предоставление (при наличии договоренности о предоставлении данных сведений управляющей компанией)

Периодичность предоставления информации: На регулярной основе

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код записи по котировке	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Финансовый инструмент	Уникальный код финансового инструмента	Текстовый		Обязательно	FICode
Дата	Дата котировки	Дата		Обязательно	Date
Источник данных	Уникальный код торговой площадки, ценового центра или информационного агентства	Текстовый		Обязательно	SourceCode
Режим торгов	Режим торгов	Числовой	0 - Режим основных торгов: T0 1 - Режим основных торгов: T+	НеОбязательно, если применимо	CalculationsType
Вид котировки	Уникальный код вида котировки	Текстовый		Обязательно	QuotKindCode
Значение котировки	Значение котировки	Числовой		Обязательно	QuotValue
Валюта котировки	Цифровой код валюты котировки в соответствии с Общероссийским классификатором валют	Текстовый		Рекомендовано	Currency

5.3 Купонные расписания

Описание:

График денежного потока по финансовым инструментам (облигациям), включая выплаты купонов и погашения номинала

Требования к предоставлению информации: Опциональное предоставление (при наличии договоренности о предоставлении данных сведений управляющей компанией)

Периодичность предоставления информации: На регулярной основе

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код записи расписания	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Финансовый инструмент	Уникальный код финансового инструмента	Текстовый		Обязательно	FICode
Валюта	Цифровой код валюты финансового инструмента в соответствии с Общероссийским классификатором валют	Текстовый		Обязательно	CurrencyCode
Расчетная дата выплат	Расчетная дата выплат	Дата		Обязательно	Date
Тип выплат	Тип выплат	Числовой	0 - купон 1 - оферта 2 - частичное погашение/ погашение номинала	Обязательно	PaymentType
Ставка	Ставка	Числовой		Обязательно	Rate
Сумма выплат	Сумма выплат	Числовой		Обязательно	Amount
Примечание	Примечание	Текстовый		Рекомендовано	Description

5.4 Графики денежного потока по финансовым инструментам

Описание:

График денежного потока по прочим финансовым инструментам (депозитам, займам и др.)

Требования к предоставлению информации: Опциональное предоставление (при наличии договоренности о предоставлении данных сведений управляющей компанией)

Периодичность предоставления информации: На регулярной основе

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщени
Идентификатор	Уникальный код записи графика	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Финансовый инструмент	Уникальный код финансового инструмента	Текстовый		Обязательно	FICode
Тип ставки	Тип ставки	Числовой	0 - основная ставка 1 - ставка досрочного расторжения 2 - переменная ставка	Обязательно	RateType
Ставка	Ставка	Числовой		Обязательно	Rate
Дата начала	Дата начала действия	Дата		Обязательно	StartDate
Дата окончания	Дата окончания действия	Дата		Обязательно	ExpireDate
Тип выплат	Тип выплат	Числовой	0 - проценты 1- Основной долг	Обязательно	PaymentType
Сумма выплат	Сумма выплат	Числовой		Обязательно	Amount

5.5 Справедливая стоимость финансовых инструментов

Описание:

Справедливая стоимость ценных бумаг и других финансовых инструментов на дату

Требования к предоставлению информации: Опциональное предоставление (при наличии договоренности о предоставлении данных сведений управляющей компанией)

Периодичность предоставления информации: На регулярной основе

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщени
Идентификатор	Уникальный код записи	Текстовый		Рекомендова но	ExtCode
Финансовый инструмент	Уникальный код финансового инструмента	Текстовый		Обязательно	FICode
Договор доверительного управления	Уникальный код договора, который заключен между УК/СД и НПФ (портфель)	Текстовый		Обязательно	TrustAgrCode
Дата	Дата, на которую определена справедливая стоимость	Дата		Обязательно	Date
Справедливая стоимость	Значение котировки справедливой стоимости	Числовой		Обязательно	QuotValue
Источник данных	Уникальный код торговой площадки, ценового центра или информационного агентства по данным которого определена справедливая стоимость	Текстовый		Рекомендова но	SourceCode
Уровень	Уровень иерархии справедливой стоимости	Числовой	1,2,3	Обязательно	FairValueLevel
Дата используемой котировки	Дата используемой котировки	Дата		Обязательно	SourceDate
Вид котировки	Уникальный код вида базовой котировки, которая использовалась для определения справедливой стоимости	Текстовый		Рекомендова но	SourceQuotKindC ode

5.6 Ставки дисконтирования и амортизированная стоимость на дату

Описание:

Ставки дисконтирования и амортизированная стоимость финансовых инструментов по партиям на дату

Требования к предоставлению информации: Опциональное предоставление (при наличии договоренности о предоставлении данных сведений управляющей компанией)

Периодичность предоставления информации: На регулярной основе

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщени
Идентификатор	Уникальный код записи	Текстовый		Рекомендова но	ExtCode
Договор доверительного управления	Уникальный код договора, который заключен между УК/СД и НПФ (портфель)	Текстовый		Обязательно	TrustAgrCode
Уникальный код сделки	Уникальный код сделки	Текстовый		Обязательно	ExtTradeCode
Финансовый инструмент	Уникальный код финансового инструмента	Текстовый		Обязательно	FICode
Дата	Дата, на которую определена ставка дисконтирования и амортизированная стоимость	Дата		Обязательно	Date
Ставка	Ставка дисконтирования (рыночная или ЭСП) на дату	Числовой		Обязательно	EffectiveInterestRate
Амортизированная стоимость	Амортизированная стоимость на дату	Числовой		Рекомендова но	AmortizedCost

6 Раздел «Данные по кредитным рейтингам»

В этом разделе описываются данные по кредитным рейтингам, которые присваивают эмитентам и ценным бумагам рейтинговые агентства. Эта информация может передаваться управляющей компанией для целей подготовки примечаний к отчетности.

6.1 Рейтинговые агентства

Описание:

Список рейтинговых агентств

Требования к предоставлению информации: **Опциональное** предоставление (при наличии договоренности о предоставлении данных сведений управляющей компанией)

Периодичность предоставления информации: Разовое предоставление при изменениях

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код рейтингового агентства	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Наименование	Наименование рейтингового агентства	Текстовый		Обязательно	Name

6.2 Шкалы рейтингов

Описание:

Классификатор шкал рейтингов

Требования к предоставлению информации: Опциональное предоставление (при наличии договоренности о предоставлении сведений о рейтингах управляющей компанией)

Рекомендованное предоставление

Периодичность предоставления информации: Разовое предоставление при изменениях

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код шкалы рейтингов	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Наименование	Наименование шкалы рейтингов	Текстовый		Обязательно	Name
Рейтинговое агентство	Уникальный код рейтингового агентства	Текстовый		Обязательно	RACode

6.3 Значения рейтингов

Описание:

Классификатор значений рейтингов рейтинговой шкалы

Требования к предоставлению информации: **Опциональное** предоставление (при наличии договоренности о предоставлении сведений о рейтингах управляющей компанией)

Периодичность предоставления информации: На регулярной основе

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код рейтинга рейтинговой шкалы	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Рейтинговое агентство	Уникальный код рейтингового агентства	Текстовый		Обязательно	RACode
Шкала рейтингов	Уникальный код шкалы рейтингов	Текстовый		Обязательно	ScaleCode
Значение рейтинга	Значение кода рейтинга	Текстовый		Обязательно	RatingValue
Унифицированный рейтинг	Значение унифицированного рейтинга, соответствующее данному значению рейтинга в используемой шкале	Текстовый	A, B, C, D, 0 (без рейтинга)	Рекомендовано	UnifRating

6.4 Значения прогнозов рейтингов

Описание:

Классификатор прогнозов рейтингов

Требования к предоставлению информации: Опциональное предоставление (при наличии договоренности о предоставлении сведений о рейтингах управляющей компанией)

Периодичность предоставления информации: Разовое предоставление при изменениях

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код прогноза рейтинга	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Значение	Значение прогноза рейтинга. Например, негативный, позитивный, стабильный, развивающийся и др.	Текстовый		Обязательно	ForecastRatingValue

6.5 Рейтинги финансовых инструментов

Описание:

Список значений рейтингов по каждому финансовому инструменту (облигационному выпуску) на дату

Требования к предоставлению информации: Опциональное предоставление (при наличии договоренности о предоставлении сведений о рейтингах управляющей компанией)

Периодичность предоставления информации: На регулярной основе

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код записи о рейтинге финансового инструмента	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Финансовый инструмент	Уникальный код финансового инструмента	Текстовый		Обязательно	FiCode
Дата рейтинга	Дата присвоения рейтинга	Дата		Обязательно	Date
Рейтинговое агентство	Уникальный код рейтингового агентства	Текстовый		Обязательно	RACode
Шкалы рейтингов	Уникальный код шкалы рейтингов	Текстовый		Обязательно	ScaleCode
Рейтинг	Уникальный код значения рейтинга	Текстовый		Обязательно	RValueCode
Прогноз рейтинга	Уникальный код прогноза рейтинга	Текстовый		Рекомендовано	ForecastRVCode

6.6 Рейтинги контрагентов

Описание:

Список значений рейтингов по каждому контрагенту на дату

Требования к предоставлению информации: Опциональное предоставление (при наличии договоренности о предоставлении сведений о рейтингах управляющей компанией)

Периодичность предоставления информации: На регулярной основе

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код записи о рейтинге контрагента	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Контрагент	Уникальный код контрагента (эмитента, банка и т.д.)	Текстовый		Обязательно	ContractorCode
Дата рейтинга	Дата присвоения рейтинга	Дата		Обязательно	Date
Рейтинговое агентство	Уникальный код рейтингового агентства	Текстовый		Обязательно	RACode
Шкалы рейтингов	Уникальный код шкалы рейтингов	Текстовый		Обязательно	ScaleCode
Рейтинг	Уникальный код значения рейтинга	Текстовый		Обязательно	RValueCode
Прогноз рейтинга	Уникальный код прогноза рейтинга	Текстовый		Рекомендовано	ForecastRVCode

6.7 Рейтинги банков

Описание:

Список значений рейтингов по каждому банку на дату

Требования к предоставлению информации: Опциональное предоставление (при наличии договоренности о предоставлении сведений о рейтингах управляющей компанией)

Периодичность предоставления информации: На регулярной основе

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код записи о рейтинге банка	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Банк	Уникальный код контрагента (банка)	Текстовый		Обязательно	BankCode
Дата рейтинга	Дата присвоения рейтинга	Дата		Обязательно	Date
Рейтинговое агентство	Уникальный код рейтингового агентства	Текстовый		Обязательно	RACode
Шкалы рейтингов	Уникальный код шкалы рейтингов	Текстовый		Обязательно	ScaleCode
Рейтинг	Уникальный код значения рейтинга	Текстовый		Обязательно	RValueCode
Прогноз рейтинга	Уникальный код прогноза рейтинга	Текстовый		Рекомендовано	ForecastRVCode

7 Раздел «Прочие списки и классификаторы»

7.1 История изменения объема выпуска

Описание:

График изменения объема выпуска финансовых инструментов (ценных бумаг)

Требования к предоставлению информации: Опциональное предоставление (при наличии договоренности о предоставлении данных сведений управляющей компанией)

Периодичность предоставления информации: На регулярной основе

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код записи об изменении объема выпуска	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Финансовый инструмент	Уникальный код финансового инструмента	Текстовый		Обязательно	FICode
Дата изменения объема выпуска	Дата изменения объема выпуска (начала действия нового значения объема)	Дата		Обязательно	Date
Номинал	Значение номинала одной бумаги	Числовой		Обязательно	NominalValue
Объем выпуска в штуках	Объем выпуска финансового инструмента в штуках (после изменения)	Числовой		Обязательно	IssueVolume
Объем выпуска в валюте номинала	Объем выпуска финансового инструмента в валюте номинала (после изменения)	Числовой		Обязательно	IssueValue
Валюта	Цифровой код валюты номинала в соответствии с Общероссийским классификатором валют	Текстовый		Обязательно	CurrencyCode
Примечание	Комментарий к обстоятельствам (основаниям) изменения объема выпуска	Текстовый		Рекомендовано	Description

7.2 История признания бумаг обращающимися/ не обращающимися на ОРЦБ

Описание:

График изменения признака "Обращается на ОРЦБ" по финансовым инструментам (ценным бумагам)

Требования к предоставлению информации: Опциональное предоставление (при наличии договоренности о предоставлении данных сведений управляющей компанией)

Периодичность предоставления информации: На регулярной основе

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код записи о статусе (признании)	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Финансовый инструмент	Уникальный код финансового инструмента	Текстовый		Обязательно	FICode
Дата	Дата признания статуса финансового инструмента (обращающимся или не обращающимся на ОРЦБ)	Дата		Обязательно	Date
Значение	Устанавливаемое значение статуса финансового инструмента	Числовой	0 – не обращается на ОРЦБ 1 – обращается на ОРЦБ	Обязательно	ActiveSecurStatus

7.3 История включения/исключения в биржевые торги

Описание:

График включения/исключения выпуска ценной бумаги в биржевые торги

Требования к предоставлению информации: **Опциональное** предоставление (при наличии договоренности о предоставлении данных сведений управляющей компанией)

Периодичность предоставления информации: На регулярной основе

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код записи о статусе в биржевых торгах	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Финансовый инструмент	Уникальный код финансового инструмента	Текстовый		Обязательно	FICode
Торговая площадка	Уникальный код торговой площадки	Текстовый		Обязательно	TradingFICode
Дата включения	Дата включения в биржевые торги	Дата		Обязательно	InDate
Дата исключения	Дата исключения из биржевых торгов	Дата		Обязательно, если применимо	OutDate
Уровень котировального листа	Уровень котировального листа для финансового инструмента, например 1 – 1 уровень 2 – 2 уровень 3 – 3 уровень	Числовой		Обязательно	QuotLevel



7.4 Отрасли

Описание:

Классификатор отраслей контрагентов для подготовки примечаний к отчетности

Требования к предоставлению информации: Опциональное предоставление (при наличии договоренности о предоставлении данных сведений управляющей компанией)

Периодичность предоставления информации: Разовое предоставление при изменениях

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор	Уникальный код отрасли (отраслевой группы)	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Наименование	Наименование отрасли (отраслевой группы)	Текстовый		Обязательно	Name

8 Раздел «Бухгалтерские проводки»

8.1 Бухгалтерские проводки

Описание:

Перечень бухгалтерских проводок по счетам второго порядка

Требования к предоставлению информации: Опциональное предоставление (при наличии договоренности о предоставлении сведений в виде сформированных проводок управляющей компанией)

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор проводки	Уникальный идентификатор проводки, присвоенный системой – источником данных	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Дата проводки	Дата проведения проводки в бухгалтерском учете	Дата		Обязательно	TransDate
Дата исходного документа	Дата исходного документа, с которым связана проводка	Дата		Рекомендовано	DocumDate
Сумма	Сумма проводки	Числовой		Обязательно	Amount
Счет (Дебет)	Код из рабочего плана счетов (стандартный вариант - счет 2 порядка)	Текстовый	стандартный вариант - счет 2 порядка из 5 знаков (цифр)	Обязательно	AccDebit
Счет (Кредит)	Код из рабочего плана счетов (стандартный вариант - счет 2 порядка)	Текстовый	стандартный вариант - счет 2 порядка из 5 знаков (цифр)	Обязательно	AccCredit
Символ ОФР (Дебет)	Заполняется, если счет дебета связан с доходами / расходами	Текстовый	Число из 3 или 5 знаков	Заполняется, если применимо	SymbSFPDebit
Символ ОФР (Кредит)	Заполняется, если счет дебета связан с доходами / расходами	Текстовый	Число из 3 или 5 знаков	Заполняется, если применимо	SymbSFPCredit
Лицевой счет (Дебет)	Лицевой счет, составленный по правилам стандарта, с учетом включенных аналитических признаков	Текстовый		Обязательно	LedgerAccDebit
Лицевой счет (Кредит)	Лицевой счет, составленный по правилам стандарта, с учетом включенных аналитических признаков	Текстовый		Обязательно	LedgerAccCredit
Название операции	Наименование / основное содержание бухгалтерской операции	Текстовый		Обязательно	Description
Номер документа - основания	Номер первичного документа - основания для операции	Текстовый		Обязательно.	DocumentNo
Тип операции	Идентификатор из справочника заданных видов операций, присвоенного системой – источником данных	Текстовый		Обязательно	OperTypeCode



Курс валюты – дебет	Заполняется, если в лицевом счете дебета код валюты отличается от кода рубля	Числовой		Заполняется, если применимо	CurrRateDebit
Курс валюты – кредит	Заполняется, если в лицевом счете кредита код валюты отличается от кода рубля	Числовой		Заполняется, если применимо	CurrRateCredit
Налоговый учет - дата	Дата учета операции в налоговом учете. Заполняется, если дата проведения отличается для целей налогового учета	Дата		Заполняется, если применимо	FiscalAccDate
Налоговый учет - сумма	Принимаемая сумма операции в налоговом учете. Заполняется, если сумма проведения отличается для целей налогового учета	Числовой		Заполняется, если применимо	FiscalAccAmount
Сумма временной разницы	Заполняется, если сумма проводки по бухгалтерскому учету не совпадает с суммой по налоговому учету	Числовой		Заполняется, если применимо	TemporTaxDiffer
Аналитический признак 1 (Дебет)	Код значения записи (справочника, объекта) признака, применяемого для данного счета. Примечание: Данная и последующие строки заполняются в соответствии с настроенным порядком аналитических признаков для используемых в проводке счетов (справочник Аналитических признаков), при наличии соответствующего аналитического признака	Текстовый		Заполняется, если применимо	SubcDebit1
Аналитический признак 2 (Дебет)	Код значения записи (справочника, объекта) признака, применяемого для данного счета	Текстовый		Заполняется, если применимо	SubcDebit2
Аналитический признак 3 (Дебет)	Код значения записи (справочника, объекта) признака, применяемого для данного счета	Текстовый		Заполняется, если применимо	SubcDebit3
Аналитический признак 4 (Дебет)	Код значения записи (справочника, объекта) признака, применяемого для данного счета	Текстовый		Заполняется, если применимо	SubcDebit4
Аналитический признак 5 (Дебет)	Код значения записи (справочника, объекта) признака, применяемого для данного счета	Текстовый		Заполняется, если применимо	SubcDebit5
Аналитический признак 1 (Кредит)	Код значения записи (справочника, объекта) признака, применяемого для данного счета	Текстовый		Заполняется, если применимо	SubcCredit1
Аналитический признак 2 (Кредит)	Код значения записи (справочника, объекта) признака, применяемого для данного счета	Текстовый		Заполняется, если применимо	SubcCredit2
Аналитический признак 3 (Кредит)	Код значения записи (справочника, объекта) признака, применяемого для данного счета	Текстовый		Заполняется, если применимо	SubcCredit3
Аналитический признак 4 (Кредит)	Код значения записи (справочника, объекта) признака, применяемого для данного счета	Текстовый		Заполняется, если применимо	SubcCredit4
Аналитический признак 5 (Кредит)	Код значения записи (справочника, объекта) признака, применяемого для данного счета	Текстовый		Заполняется, если применимо	SubcCredit5



САМОРЕГУЛИРУЕМАЯ ОРГАНИЗАЦИЯ
НАЦИОНАЛЬНАЯ АССОЦИАЦИЯ
НЕГОСУДАРСТВЕННЫХ
ПЕНСИОННЫХ ФОНДОВ

8.2 Аналитические признаки бухгалтерских счетов

Описание:

Значения аналитики проводок

Требования к предоставлению информации: Опциональное предоставление (при наличии договоренности о предоставлении сведений в виде сформированных проводок управляющей компанией)

Состав данных:

Наименование	Комментарий	Тип	Возможные значения	Заполнение	Название поля в базовой схеме сообщения
Идентификатор аналитики	Уникальный идентификатор записи об аналитическом признаке, присвоенный системой – источником данных	Текстовый		Обязательно	ExtCode
Номер бухгалтерского счета	Код из рабочего плана счетов (стандартный вариант – номер счета 2 порядка)	Текстовый		Обязательно	AccountNo
Идентификатор вида аналитического признака	Уникальный идентификатор (код) вида аналитического признака, присвоенный системой – источником данных. Примечание: рекомендуется согласовать коды аналитических признаков с системой – приемником данных	Текстовый		Обязательно	SubcountCode
Название объекта аналитического признака	Название объекта / справочника, используемого в аналитическом признаке:	Текстовый	Вид финансового инструмента, признак обесцененности, контрагент, договор, категория актива и т.д.	Обязательно	SubObjectName
Позиция признака в аналитике счета	Порядковый номер аналитического признака для данного бухгалтерского счета	Числовой	число от 1 до 5	Обязательно	SubcOrder
Расположение аналитического признака в лицевом счете (начало)	Заполняется для признаков, включаемых в лицевой счет - начальная позиция значения признака в лицевом счете. Признаки располагаются не ранее позиции 11 в лицевом счете	Числовой	Число от 11	Заполняется, если применимо	SubcPositionBegin
Расположение аналитического признака в лицевом счете (конец)	Заполняется для признаков, включаемых в лицевой счет - конечная позиция значения признака в лицевом счете	Числовой	Число не более номера конечной позиции лицевого счета	Заполняется, если применимо	SubcPositionEnd