

УТВЕРЖДЕНЫ

решением Правления
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

от «___» _____ 2013 года (Протокол № ___)

Председатель Правления
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

_____ Хавин А.С.

**ФОРМАТЫ ОТЧЕТОВ, ПРЕДОСТАВЛЯЕМЫХ УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА В
СООТВЕТСТВИИ С ПРАВИЛАМИ КЛИРИНГА ЗАО АКБ «НАЦИОНАЛЬНЫЙ
КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР» НА СРОЧНОМ РЫНКЕ**

Москва, 2013г.

СОДЕРЖАНИЕ

I.	Общие положения.....	3
II.	Отчет «Список расчетных пар счетов и клиентов».....	7
III.	«Отчет о состоянии торговых счетов и денежных регистров».....	9
IV.	«Клиринговый отчет об исполненных сделках с полным обеспечением»	14
V.	«Отчет о сделках репо».....	19
VI.	«Отчет о Сделках с отложенным исполнением».....	23
VII.	«Клиринговый отчет об исполненных поручениях на клиринг».....	26
VIII.	«Клиринговый отчет об исполненных обязательствах по поставочным срочным контрактам».....	29
IX.	«Клиринговый отчет об исполненных Сделках T+N».....	31
X.	«Отчет о комиссионных вознаграждениях клирингового центра и организаторов торговли».....	33
XI.	«Отчет о комиссионных вознаграждениях АБ «Газпромбанк».....	36
XII.	«Отчет о Договорах займа Клирингового центра».....	38

I. Общие положения

1. Настоящий документ «Форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга в соответствии с Правилами клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на срочном рынке» (далее – Форматы отчетов) разработан в соответствии с Правилами клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на срочном рынке, утвержденными уполномоченным органом ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» (далее – Клиринговый центр) и зарегистрированными Банком России (далее – Правила клиринга), с учетом требований законодательства Российской Федерации о клиринговой деятельности и иных нормативных правовых актов Российской Федерации.
2. Форматы отчетов устанавливают форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга, которым присвоен код Расчетной фирмы, в соответствии с Правилами клиринга.
3. Термины, используемые в Форматах отчетов, используются в значениях, определенных Правилами клиринга.
4. Клиринговый центр извещает Участников клиринга о дате вступления в силу Форматов отчетов, а также изменений и дополнений к ним путем раскрытия соответствующей информации на Сайте Клирингового центра (www.nksbank.ru), включая размещение текста Форматов отчетов, не менее чем за 5 (пять) дней до даты вступления их в силу, если иной срок и порядок извещения не установлен решением Клирингового центра.
5. Отчеты Клирингового центра предоставляются с использованием системы ЭДО в виде электронных сообщений, являющихся документами, сформированными в соответствии с требованиями языка XML версии 1.0. Полная спецификация языка XML версии 1.0 приводится в документе Extensible Markup Language (XML) 1.0 (Second Edition), разработанном W3C и опубликованном в сети Интернет по адресу <http://www.w3.org/TR/REC-xml>. В описаниях структуры полей для каждого типа сообщений:
 - Символом «М» отмечены поля, наличие и заполнение которых в сообщении является обязательным;
 - Символом «О» отмечены поля, наличие и заполнение которых в сообщении не является обязательным.

Структура XML документа

Ниже приводится краткое описание структуры XML документа версии 1.0. Любой XML документ состоит из двух частей: Пролога и Корневого элемента.

Пролог XML документа

Пролог XML документа предназначен для описания глобальных параметров XML документа. Пролог может содержать несколько инструкций, каждая из которых начинается с последовательности символов «<?» и заканчивается последовательностью символов «?>».

В первой строке пролога всегда размещается объявление XML с указанием кодировки символов, используемых в документе.

Пример Пролога документа:

<?xml version="1.0" encoding="windows-1251"?>

Элементы XML документа

Документ XML всегда содержит единственный корневой элемент, который может включать в себя любое число других элементов. Начало любого элемента обозначается открывающим тегом, например <element1>. Конец элемента обозначается закрывающим тегом, например </element1>. Конец элемента также может обозначаться последовательностью </>, в случае если данный элемент не содержит дочерних (вложенных) элементов.

Пример элемента:

<doc> пример элемента </doc>

Атрибуты элементов XML документа

Каждый элемент может содержать любое количество атрибутов. Атрибуты предназначены для передачи дополнительной информации об элементе. Атрибуты указываются внутри открывающего тега сразу после его названия в виде пар атрибут1="значение1" атрибут2="значение2". Значения атрибутов не должны содержать символы «<» (левая угловая скобка), «>» (правая угловая скобка), «&» (амперсанд), «'» (апостроф) и «"» (двойная кавычка). Данные символы кодируются последовательностями «<», «>», «&», «'», «"», соответственно.

Пример атрибута:

<doc type="значение type" />

В данном примере элемент <doc> содержит атрибут type, со значением «значение type».

Каждый элемент может содержать любое количество других элементов. Такие элементы называются дочерними элементами по отношению к данному элементу.

Пример дочернего элемента:

```
<doc type="test">
<fid> пример дочернего элемента </fid>
</doc>
```

Здесь, <fid> является дочерним элементом элемента <doc>.

Для всех отчетов действуют два основных правила:

- 1) Любой элемент может быть дочерним элементом любого другого. Это правило позволяет группировать элементы отчетов в любой иерархии.
- 2) Для каждого дочернего элемента действует правило: Если в элементе значение атрибута не указано, то его значение соответствует значению атрибута, имеющего то же имя и указанного в элементе более высокого уровня. Это правило позволяет не дублировать информацию во вложенных элементах.

Типы значений

Тип	а) Описание
Text	Строковое значение, включая символы кириллицы
Boolean	Логическая переменная ("1" или "0")

Numeric (n, m)	Числа с десятичной точкой (если размер дробной части в описании атрибута элемента > 0) или числа без десятичной точки (если размер дробной части в описании атрибута элемента отсутствует или равен 0) n – размер целой части m – размер дробной части Если размер целой части не определен, указывается #
Date	Дата в формате: dd.mm.yyyy
Time	Время в формате: hh:mm:ss
Datetime	Дата и время в формате: dd.mm.yyyy hh:mm:ss

Корневой элемент

В каждом отчете обязательно присутствует корневой элемент <Receiver>, который предназначен для определения получателя отчета, дат начала и окончания периода, за который сформирован отчет, даты и времени формирования отчета.

Элемент Receiver

М/О	Атрибут	Описание	Тип
M	Id	Код участника клиринга, для которого сформирован отчет	Text
M	Name	Наименование участника клиринга, для которого сформирован отчет	Text
O	DateFrom	Дата начала периода, за который сформирован отчет	Date
M	DateTo	Дата окончания периода, за который сформирован отчет, либо дата, за которую сформирован отчет, если DateFrom не задана	Date
M	DateRpt	Дата и время формирования отчета	Datetime

Корневой элемент <Receiver> содержит взаимосвязанный дочерний элемент <Report>, описывающий идентификатор, название и версию отчета.

Элемент Report

М/О	Атрибут	Описание	Тип
M	Type	Идентификатор отчета	Text
M	Desc	Название отчета	Text
M	Ver	Версия отчета	Text

Правила формирования значений определенных атрибутов элемента:

- Атрибут «Type» может принимать следующие значения:
 - “DAYSP” – Список расчетных пар счетов и клиентов;
 - “DAYASSET” – Отчет о состоянии торговых счетов и денежных регистров;
 - “DAYCONTRACT_GTS” – Клиринговый отчет об исполненных сделках с полным обеспечением;
 - “DAY_REPO” – Отчет о Сделках репо;
 - “DAY_TPN” – Отчет о Сделках с отложенным исполнением;
 - “DAY_LOAN” – Отчет о Договорах займа Клирингового центра;
 - “DAYCONTRACT_DVP” – Клиринговый отчет об исполненных поручениях на клиринг;

- “DAYCONTRACT_FTS” – Клиринговый отчет об исполненных обязательствах по поставочным срочным контрактам;
- “DAYCONTRACT_STS” – Клиринговый отчет об исполненных Сделках T+N;
- “DAYFEE” – Отчет о комиссионных вознаграждениях клирингового центра и организаторов торговли;
- “DAYFEE_GPB” – Отчет о комиссионных вознаграждениях АБ «Газпромбанк».

II. Отчет «Список расчетных пар счетов и клиентов»

В отчет включается информация о зарегистрированных в Клиринговом центре на дату формирования отчета клиентах и Кодах торговых счетов.

Отчет DAYSP

М/О	Элемент	Описание	Элемент - владелец
M	Receiver	Информация о получателе отчета и дате (периоде), за который сформирован отчет	-
M	Report	Тип, название и версия отчета	Receiver
M	SettlPairGroup	Расчетная пара с уникальным сочетанием денежного торгового счета (денежного регистра) и торгового счета депо или расчетная пара с уникальным сочетанием поставочного рублевого счета и поставочного валютного счета	Receiver
M	SettlPair	Информация о торговых счетах (о торговом счете депо и денежном регистре) или о поставочных счетах (рублевом и валютном), входящих в состав расчетной пары счетов	SettlPairGroup
O	Account	Торговый счет (денежный или депозитарный), поставочный счет (рублевый или валютный) или денежный регистр	SettlPair
M	Client	Клиент	SettlPairGroup

Правила указания элементов и значений определенных атрибутов элементов:

- Для расчетной пары, зарегистрированной без торговых счетов, элементы «Account», дочерние к элементу «SettlPair», не указываются.

Пример:

```
<?xml version="1.0" encoding="Windows-1251"?>
<?xml-stylesheet type="text/xsl" href=".\\DAYSP.xsl"?>
<Receiver Id="TRNMM" Name="Закрытое Акционерное Общество &quot;ФИНАНС&quot;"
DateTo="16.01.2007" DateRpt="17.01.2007 19:31:05">
  <Report Type="DAYSP" Desc="Список расчетных пар и клиентов" Ver="1" />
  <SettlPairGroup>
    <SettlPair>
      <Account OrgType="B" OrgCode="RTS-SC"
AccCode="30218810700000000001" />
      <Account OrgType="D" OrgCode="DCC" AccCode="1998" />
    </SettlPair>
    <Client ClientCode="trnmm1" Inn="5906060488" />
    <Client ClientCode="trnmm2" Inn="5906060481" />
    <Client ClientCode="trnmm3" Inn="5906060482" />
    <Client ClientCode="trnmm4" Inn="5906060483" />
  </SettlPairGroup>
</SettlPairGroup>
  <SettlPair NoAccounts="1" />
    <Client ClientCode="ltd" Inn="#CYP C11111" AnCls="1" />
    <Client ClientCode="ltd1" Inn="#CYP C11112" />
  </SettlPair>
</Receiver>
```

```

                <Client ClientCode="ltd2" Inn="#СYP C11113" />
            </SettlPairGroup>
            <SettlPairGroup>
                <SettlPair>
                    <Account                      OrgType="B"                      OrgCode="RTS-SC"
                    AccCode="30218810500000000002" />
                    <Account OrgType="D" OrgCode="RDC" AccCode="883F/000000111" />
                </SettlPair>
            <Client ClientCode="trnmmg" Inn="5906060488" />
            </SettlPairGroup>
        </Receiver>
    
```

Элемент *SettlPairGroup*

Не имеет атрибутов.

Элемент *SettlPair*

М/О	Атрибут	Описание	Тип
О	NoAccounts	Признак "расчетная пара без счетов"	boolean

Правила формирования значений определенных атрибутов элемента:

- Атрибут «NoAccounts» принимает значение “1” для расчетной пары без счетов, “0” - для расчетной пары со счетами.

Элемент *Account*

М/О	Атрибут	Описание	Тип
О	OrgType	Тип организации	text
О	OrgCode	Код организации	text
О	AccCode	Номер торгового счета / денежного регистра / счета обеспечения	text

Правила формирования значений определенных атрибутов элемента:

- Атрибут «OrgType» может принимать следующие значения:
 - “B” - расчетная / кредитная организация;
 - “D” - расчетный депозитарий / расчетная группа поставочных валютных счетов.
- Атрибут «OrgCode» может принимать следующие значения:
 - “NSD” - НКО ЗАО НРД;
 - “RDC” - ЗАО "Расчетно-депозитарная компания";
 - код банка, присвоенный Клиринговым центром, – для иных кредитных организаций.

Элемент *Client*

М/О	Атрибут	Описание	Тип
М	ClientCode	Код клиента (Код торговых счетов / код раздела регистра учета позиций)	text
М	Inn	ИНН клиента или код, его заменяющий	text

III. «Отчет о состоянии торговых счетов»

В отчет включается информация о зарегистрированных в Клиринговом центре на дату формирования отчета:

- торговых счетах, по которым получатель отчета является владельцем, и/или Участником клиринга, имеющим право указывать данный торговый счет при регистрации Кодов торговых счетов, и исполнять обязательства по сделкам за счет средств (ценных бумаг), учитываемых на данном торговом счете;
- и об изменении остатков по торговым счетам, денежным регистрам по итогам операций, выполненных после окончания расчетной клиринговой сессии предыдущего операционного дня и до окончания расчетной клиринговой сессии текущего операционного дня по поручениям Клирингового центра / с согласия Клирингового центра.

Отчет DAYASSET

М/О	Элемент	Описание	Элемент - владелец
M	Receiver	Информация о получателе отчета и дате (периоде), за который сформирован отчет	-
M	Report	Тип, название и версия отчета	Receiver
M	Owner	Владелец счета	Receiver
M	Account	Торговый счет	Owner
M	Attribute	Атрибуты торгового счета	Account
M	Asset	Остатки по торговому счету	Account
O	Money	Информация о денежных средствах	Asset
O	Issue	Информация об Инструменте	Asset
M	InitEnd	Остатки на счете на начало и конец дня	Asset
M	InOut	Изменение остатка на счете, связанное с вводом-выводом	Asset
M	IncExp	Изменение остатка на счете по итогам клиринга сделок	Asset
O	Details	Операции, приведшие к изменению остатка на счете по итогам клиринга сделок	IncExp

Правила указания элементов и значений определенных атрибутов элементов:

- Элемент «Details» указывается в случае, если изменение остатка на счете вызвано не только исполнением основных обязательств по сделкам.

Пример:

```
<?xml version="1.0" encoding="Windows-1251"?>
<?xml-stylesheet type="text/xsl" href=".\\DAYASSET~205.xsl"?>
<Receiver Id="SHUTTL" Name="Открытое Акционерное Общество &quot;Шаттл-7&quot;"
DateTo="10.11.2011" DateRpt="10.11.2011 19:37:16">
  <Report Type="DAYASSET" Desc="Отчет о состоянии торговых и денежных регистров"
Ver="205" />
  <Owner Id="SHUTTL" Name="Открытое Акционерное Общество &quot;Шаттл-7&quot;"
INN="2290861429">
```

```

<Account OrgType="B" OrgCode="NSD" AccCode="3010981000000039998" >
  <Attribute AccPrimary="30218810800000009546" IsClr="1" Purpose="NOGTS"
/>

  <Asset Type="M">
    <Money Code="RUR" />
    <InitEnd Init="105971767.00" End="105971767.00" />
    <InOut Input="0.00" Output="281294600.00" />
    <IncExp Income="281294600.00" Expense="0.00" >
    </IncExp>
  </Asset>
</Account>

<Account OrgType="B" OrgCode="NSD" AccCode="30214810600000009546" >
  <Attribute IsClr="1" Purpose="REG" />
  <Asset Type="M">
    <Money Code="RUR" />
    <InitEnd Init="0.00" End="0.00" />
    <InOut Input="0.00" Output="0.00" />
    <IncExp Income="0.00" Expense="0.00" >
    </IncExp>
  </Asset>
</Account>

<Account OrgType="B" OrgCode="NSD" AccCode="30218810800000009546" >
  <Attribute AccPrimary="30214810600000000453" IsClr="1" Purpose="GTS" />
  <Asset Type="M">
    <Money Code="RUR" />
    <InitEnd Init="410222.41" End="902020.90" />
    <InOut Input="580000000.00" Output="343000000.00" />
    <IncExp Income="0.00" Expense="236508201.51" >
    </IncExp>
  </Asset>
</Account>

<Account OrgType="D" OrgCode="NSD" AccCode="89512" >
  <Attribute AccPrimary="10427" IsClr="1" Purpose="GTS" />
  <Asset Type="I">
    <Issue Type="SHS" Code="CHMF" SubCode="RF0000006309"
Name="ОАО Северсталь, ао" FaceValue="0.01000" Currency="RUR" />
    <InitEnd Init="0.00" End="0.00" />
    <InOut Input="0.00" Output="17790.00" />
    <IncExp Income="17790.00" Expense="0.00" >
    </IncExp>
  </Asset>
</Account>
</Owner>
</Receiver>

```

Элемент Owner

М/О	Атрибут	Описание	Тип
М	Id	Код владельца / оператора счета	text
М	Name	Наименование владельца счета	text
М	Inn	ИНН владельца счета	text

Элемент Attribute

М/О	Атрибут	Описание	Тип
О	AccPrim	Номер основного счета	text
О	SpecBrk	Признак "специальный брокерский счет"	boolean

О	IsClr	Признак "клиринг по счету разрешен"	boolean
М	Purpose	Назначение счета	text

Правила формирования значений определенных атрибутов элемента:

- Атрибут «SpecBrk» принимает значение “1”, если счет является специальным брокерским счетом, “0” – если не является; атрибут указывается только для денежных торговых счетов.
- Атрибут «IsClr» принимает значение “1”, если по счету возможно проведение расчетов по итогам клиринга, “0” – если не возможно.
- Атрибут «Purpose» может принимать следующие значения:
 - “GTS” – в случае если счет предназначен для клиринга с полным обеспечением;
 - “REG” – в случае если элемент Account содержит информацию о денежном регистре, предназначенном для учета средств Участника клиринга на Счете Клирингового центра для электронной торговли;
 - “NOGTS” – в случае если счет не предназначен для клиринга с полным обеспечением.

Элемент Asset

М/О	Атрибут	Описание	Тип
М	Type	Тип актива	Text

Правила формирования значений определенных атрибутов элемента:

- Атрибут «Type» может принимать следующие значения:
 - “M” – денежные средства;
 - “T” – ценные бумаги.

Элемент Money

М/О	Атрибут	Описание	Тип
М	Code	Код валюты	text

Правила формирования значений определенных атрибутов элемента:

- Атрибут «Code» может принимать следующие значения:
 - “RUR” – рубли Российской Федерации.

Элемент Issue

М/О	Атрибут	Описание	Тип
М	Type	Вид Инструмента	text
М	Code	Код Инструмента	text
О	TSCode	Код ценной бумаги в Торговой системе	text
О	SubCode	Код ценной бумаги в расчетном депозитарии	text
М	Name	Наименование Инструмента	text
О	FaceValue	Номинал	numeric(#,2)
О	Currency	Валюта номинала	text

Правила формирования значений определенных атрибутов элемента:

- Атрибут «Type» может принимать следующие значения:
 - “SHS” – акция;
 - “BON” – облигация;
 - “MSC” – пай ПИФа.
- Список возможных значений атрибута «Code», если Инструментом является ценная бумага (акция, облигация или пай ПИФа): <http://www.codes.rts.ru>

- Список возможных значений атрибута «SubCode» для депозитария ЗАО «ДКК»:
http://www.dcc.ru/dcc/rus/docs/dcc_codes/c01.xls
- Атрибуты «FaceValue» и «Currency» в обязательном порядке указываются только для облигаций.
- Атрибут «Currency» может принимать следующие значения:
 - “RUR” – рубли Российской Федерации.

Элемент InitEnd

М/О	Атрибут	Описание	Тип
M	Init	Значение остатка на счете на момент окончания расчетной клиринговой сессии предыдущего операционного дня	numeric(#,2)
M	End	Значение остатка на счете на момент окончания расчетной клиринговой сессии текущего операционного дня	numeric(#,2)

Элемент InOut

М/О	Атрибут	Описание	Тип
M	Input	Сумма денежных средств / количество ценных бумаг, зачисленных на счет (ввод)	numeric(#,2)
M	Output	Сумма денежных средств / количество ценных бумаг, списанных со счета (вывод)	numeric(#,2)

Элемент IncExp

М/О	Атрибут	Описание	Тип
M	Income	Сумма денежных средств / количество ценных бумаг, зачисленных на счет по итогам клиринга сделок	numeric(#,2)
M	Expense	Сумма денежных средств / количество ценных бумаг, списанных со счета по итогам клиринга сделок	numeric(#,2)

Элемент Details

М/О	Атрибут	Описание	Тип
M	Type	Тип операции	text
M	Income	Сумма денежных средств / количество ценных бумаг, зачисленных на счет для исполнения операции	numeric(#,2)
M	Expense	Сумма денежных средств / количество ценных бумаг, списанных со счета для исполнения операции	numeric(#,2)

Правила формирования значений определенных атрибутов элемента:

- Атрибут «Type» может принимать следующие значения:
 - “Main” – исполнение основного обязательства по сделке.

Для элементов «Asset» выполняется равенство:

$$\text{InitEnd.End} = \text{InitEnd.Init} + (\text{InOut.Input} - \text{InOut.Output}) + (\text{IncExp.Income} - \text{IncExp.Expense}).$$

IV. «Клиринговый отчет об исполненных сделках с полным обеспечением»

В отчет включается информация об исполненных в дату формирования отчета сделках с полным обеспечением.

Отчет DAYCONTRACT GTS

М/О	Элемент	Описание	Элемент - владелец
M	Receiver	Информация о получателе отчета и дате (периоде), за который сформирован отчет	-
M	Report	Тип, название и версия отчета	Receiver
M	SettlPairGroup	Группа расчетных пар с уникальным сочетанием денежного торгового счета и торгового счета депо	Receiver
M	SettlPair	Расчетная пара с уникальным сочетанием денежного торгового счета и торгового счета депо	SettlPairGroup
M	Account	Торговый счет (денежный или депозитарный), входящий в состав расчетной пары счетов	SettlPair
M	Client	Клиент	SettlPairGroup
M	Issue	Информация о ценной бумаге	Client
O	Bond	НКД на одну ценную бумагу	Issue
M	Settlement	Тип и дата расчетов	Issue
M	Contract	Информация о сделке	Settlement

Правила указания элементов и значений определенных атрибутов элементов:

- Элемент «Bond» указывается только для облигаций (Issue.Type="BON").
- В атрибуте «Type» элемента «Settlement» (Settlement.Type) всегда указывается значение "GTS".

Пример:

```
<?xml version="1.0" encoding="Windows-1251"?>
<?xml-stylesheet type="text/xsl" href=".\\DAYCONTRACT_GTS~103.xsl"?>
<Receiver Id="TRNMM" Name="Закрытое Акционерное Общество &quot;ФИНАНС&quot;"
DateTo="08.11.2011" DateRpt="08.11.2011 19:30:38">
  <Report Type="DAYCONTRACT_GTS" Desc="Клиринговый отчет об исполненных сделках с
полным обеспечением" Ver="103" />
  <SettlPairGroup>
    <SettlPair>
      <Account OrgType="B" OrgCode="RTS-SC"
AccCode="30218810700000000909" />
      <Account OrgType="D" OrgCode="DCC" AccCode="6920" />
    </SettlPair>
    <Client ClientCode="trnmm1" Inn="40 05 500062">
      <Issue Type="SHS" Code="GAZP" TSCode="GSPBEX"
SubCode="RF0000001636" Name="ОАО Газпром, ao" FaceValue="5.00000" Currency="RUR" >
        <Settlement Type="GTS" Date="08.11.2011">
          <Contract Number="GQTS0004247991"
TSOrderNumber="0015834662"
MarketCode="SPB"
```

```

Type="A"
Moment="08.11.2011 18:18:08"
Action="S"
TypeExt="N"
ExecMoment="08.11.2011 19:09:47"
Qty="140"
Currency="RUR"
Price="183.34000"
Amt="25667.60"
State="EXECUTED"
Memo="14133/000 18864002" />
</Settlement>
</Issue>
</Client>
<Client ClientCode="trnmm2" Inn="22 05 255080">
  <Issue Type="SHS" Code="GAZP" TSCode="GSPBEX"
SubCode="RF0000001636" Name="ОАО Газпром, ао" FaceValue="5.00000" Currency="RUR" >
  <Settlement Type="GTS" Date="08.11.2011">
    <Contract Number="GQTS0004247786"
TSTOrderNumber="0015833955"
MarketCode="SPB"
Type="A"
Moment="08.11.2011 11:38:13"
Action="S"
TypeExt="N"
ExecMoment="08.11.2011 17:23:44"
Qty="2"
Currency="RUR"
Price="186.12000"
Amt="372.24"
State="EXECUTED"
Memo="59004/001 18925897" />
  </Settlement>
</Issue>
</Client>
</SettlPairGroup>
<SettlPairGroup>
  <SettlPair>
    <Account OrgType="B" OrgCode="RTS-SC"
AccCode="30218810700000000909" />
    <Account OrgType="D" OrgCode="RDC" AccCode="883F/34700622" />
  </SettlPair>
  <Client ClientCode="trnmm3" Inn="6474976219">
    <Issue Type="SHS" Code="GAZP" TSCode="GSPBEX"
SubCode="RF0000001636" Name="ОАО Газпром, ао" FaceValue="5.00000" Currency="RUR" >
    <Settlement Type="GTS" Date="08.11.2011">
      <Contract Number="GQTS0004247765"
TSTOrderNumber="0015833894"
MarketCode="SPB"
Type="A"
Moment="08.11.2011 11:13:45"
Action="S"
TypeExt="N"
ExecMoment="08.11.2011 17:23:42"
Qty="400"
Currency="RUR"
Price="184.80000"
Amt="73920.00"
State="EXECUTED"
Memo="/000 18929059" />
    </Settlement>
  </Client>
</Settlement>

```

</Issue> </Client> </SettlPairGroup> </Receiver>

Элемент Bond

М/О	Атрибут	Описание	Тип
M	AI	НКД на одну ценную бумагу в валюте номинала	numeric(#,5)
M	Date	Дата НКД	date

Элемент Settlement

М/О	Атрибут	Описание	Тип
M	Type	Тип расчетов	text
M	Date	Дата расчетов	date

Правила формирования значений определенных атрибутов элемента:

- Атрибут «Type» может принимать следующие значения:
 - “GTS” – клиринг с полным обеспечением;
 - “FTS” – исполнение обязательств по перерегистрации/оплате ценных бумаг по поставочным срочным контрактам;
 - “STS” – клиринг с частичным обеспечением;
- В качестве Даты расчетов в отчетах указывается дата, в которую сделка / поручение на клиринг должно быть исполнено.

Элемент Contract

М/О	Атрибут	Описание	Тип
M	Number	Номер сделки в КЦ / номер поручения на клиринг	text
O	RepoRealNumber	Номер сделки репо, заключенной в Секторе рынка Standard Закрытого акционерного общества «Фондовая биржа ММВБ» / номер Сделок купли-продажи, являющихся частью Связки, заключенной в Секторе рынка Standard Закрытого акционерного общества «Фондовая биржа ММВБ»	text
O	TSOrderNumber	Номер заявки в ТС	text
O	MarketCode	Код Организатора торговли	text
O	Type	Тип сделки	text
O	Moment	Дата и время регистрации сделки в ТС / подачи поручения на клиринг	datetime
M	Action	Направление сделки	text
M	TypeExt	Признак сделки	text
O	ExecMoment	Дата и время прекращения обязательств по сделке	datetime
M	Qty	Количество Инструментов	numeric(#,5)
M	Currency	Валюта сделки	text
O	Price	Цена одного Инструмента	numeric(#,5)
M	Amt	Сумма сделки	numeric(#,2)
O	AIsum	Сумма НКД, включенная в сумму сделки	numeric(#,2)

M	State	Состояние обязательств по сделке	text
O	Memo	Значение поля "Мемо" из сделки в ТС	text
O	InclYield	«Включая доход»	boolean
O	InclMoment	Дата и время включения обязательств по сделке в клиринговый пул	datetime

Правила формирования значений определенных атрибутов элемента:

- Номер сделки в КЦ, указываемый в атрибуте «Number», состоит из префикса и Идентификационного номера сделки. Префикс в номере сделки в КЦ может принимать следующие значения:
 - “GQTS” – для сделок с полным обеспечением и каждой части Сделки репо;
 - “FTS” – при исполнении обязательств по перерегистрации/оплате ценных бумаг по поставочным срочным контрактам;
 - “STS” – для Сделок T+N;
 - “” (пустое поле) – для сделок исполнения поставочного фьючерсного контракта через Инструмент RTS Standard;
 - “RTST” – для Сделок с отложенным исполнением.
- Атрибут «RepoRealNumber» указывается только для сделок репо, заключенных в Секторе рынка Standard Закрытого акционерного общества «Фондовая биржа ММВБ» и для сделок купли-продажи, являющихся частью Связок, заключенных в Секторе рынка Standard Закрытого акционерного общества «Фондовая биржа ММВБ»;
- Номер поручения на клиринг, указываемый в атрибуте «Number», состоит из префикса и цифрового номера. Префикс в номере поручений на клиринг может принимать следующие значения:
 - “RTSN” – для поручений на клиринг, поданных для исполнения Сделок с отложенным исполнением;
 - символный код – для поручений на перевод позиций с одного раздела регистра учета позиций на другой в рамках разделов одной Расчетной фирмы (клиента одной Расчетной фирмы)..
- Атрибут «MarketCode» может принимать следующие значения:
 - “RTS” – ФБ ММВБ;
 - “SPB” – ОАО «СПБ»;
 - .
- Атрибут «Type» может принимать следующие значения:
 - “A” – аукционная сделка;
 - “B” – адресная сделка;
 - “Q” – сделка по котировке;
 - “” – для поручений на клиринг, и Договоров займа Клирингового центра.
- Атрибут «Action» может принимать следующие значения:
 - “B” – покупка;
 - “S” – продажа.Для Договоров займа Клирингового центра Атрибут Action всегда имеет значение “S”, и означает, что Участник клиринга является займодавцем, а Клиринговый центр заемщиком.
- Атрибут «TypeExt» может принимать следующие значения:
 - “N” – сделка с полным обеспечением;
 - “D” – исполнение поставочных срочных контрактов;
 - “RD” – 1-ая часть сделки репо;
 - “RB” – 2-ая часть сделки репо;
 - “O” – Сделка с отложенным исполнением;

- “P” – поручение на клиринг или на перевод позиций с одного раздела регистра учета позиций на другой в рамках разделов одной Расчетной фирмы (клиента одной Расчетной фирмы);
- “S” – Сделка T+N;
- “C” – одна из пары сделок купли-продажи, заключенной Клиринговым центром с Расчетной фирмой в соответствии с Правилами клиринга при наличии Необеспеченных позиций Участника клиринга или Клирингового центра по Сделкам T+N; сделка купли-продажи, являющаяся частью Связки, в Секторе рынка Standard Закрытого акционерного общества «Фондовая биржа ММВБ»;
- “IPO” – сделка первичного размещения;
- “L” – Договор займа Клирингового центра.
- Для сделок с облигациями значение атрибута «Price» – это цена одной ценной бумаги без учета НКД.
- Атрибут «Currency» может принимать следующие значения:
 - “RUR” – рубли Российской Федерации.
- Для сделок с облигациями значение атрибута «Amt» – это сумма сделки, включая НКД.
- Атрибут «AISum» указывается только для сделок с облигациями.
- Атрибут «State» может принимать следующие значения:
 - “WAITING” – сделка не исполнена, дата исполнения обязательств по сделке не наступила;
 - “EXPIRED” – сделка не исполнена, исполнение обязательств по сделке просрочено;
 - “PARTLY_EXECUTED” – обязательства по сделке исполнены частично;
 - “EXECUTED” – обязательства по сделке исполнены полностью;
 - “TERMINATED” – обязательства по сделке (части сделки) прекращены выплатой неустойки.
- Атрибут «Memo» указывается для сделок в случае, если поле «Memo» в ТС заполнено.
- Атрибут «InclYield» указывается только для сделок репо и Договоров займа Клирингового центра и принимает значение “1”, если сумма Дохода подлежит передаче Первоначальным покупателем (заемщиком) Первоначальному продавцу (займодавцу) в случае, если в течение срока сделки репо или Договора займа Клирингового центра составляется список лиц, имеющих право на получение Дохода, “0” – если не подлежит.
- Атрибут «InclMoment» указывается для Сделок T+N и для обязательств по перерегистрации/оплате ценных бумаг по поставочным срочным контрактам.

V. «Отчет о сделках репо»

В отчет включается информация о сделках репо, 2-ые части которых не исполнены либо исполнены в дату формирования отчета.

Отчет DAY REPO

М/О	Элемент	Описание	Элемент - владелец
M	Receiver	Информация о получателе отчета и дате (периоде), за который сформирован отчет	-
M	Report	Тип, название и версия отчета	Receiver
M	SettlPairGroup	Группа расчетных пар с уникальным сочетанием денежного торгового счета (денежного регистра) и торгового счета депо	Receiver
M	SettlPair	Расчетная пара с уникальным сочетанием денежного торгового счета (денежного регистра) и торгового счета депо	SettlPairGroup
M	Account	Торговый счет (денежный или депозитарный) или денежный регистр, входящий в состав расчетной пары счетов	SettlPair
M	Client	Клиент	SettlPairGroup
M	Issue	Информация о ценной бумаге	Client
O	Bond	НКД на одну ценную бумагу	Issue
M	Contract	Информация о 1-ой части репо	Issue
M	Settlement	Тип и дата расчетов для 1-ой части репо	Contract
M	CounterParty	Контрагент по сделке репо	Contract
M	Contract	Информация о 2-ой части репо	Contract
M	Settlement	Тип и дата расчетов для 2-ой части репо	Contract

Правила указания элементов и значений определенных атрибутов элементов:

- В атрибуте «Type» элемента «Settlement» (Settlement.Type) указывается значение «GTS» для Сделок репо, заключенных в Режиме торговли с полным обеспечением.
- Элемент «Bond» указывается только для облигаций (Issue.Type="BON"). Количество элементов «Bond» в отчете соответствует количеству разных дат исполнения 1-ых и 2-ых частей репо, включенных в отчет.

Пример:

```
<?xml version="1.0" encoding="Windows-1251"?>
<?xml-stylesheet type="text/xsl" href=".\\DAY_REPO.xsl"?>
<Receiver Id="TRNMM" Name="Закрытое Акционерное Общество &quot;ФИНАНС&quot;"
DateTo="06.03.2007" DateRpt="09.03.2007 19:31:05" >
  <Report Type="DAY_REPO" Desc="Отчет о сделках репо" Ver="1" />
  <SettlPairGroup>
    <SettlPair>
      <Account OrgType="B" OrgCode="RTS-SC"
```

```
AccCode="30218810700000000001" />
  <Account OrgType="D" OrgCode="RDC" AccCode="883F/00100001" />
</SettlPair>
<Client ClientCode="trnmm1" Inn="5906060488" >
  <Issue Type="SHS" Code="GAZP" TSCode="GSPBEX" SubCode="1-02-00028-
A" >
  <Contract
    Number="GQTS0003604389"
    TSOOrderNumber="0003604389"
    MarketCode="RTS"
    Type="B"
    Moment="28.03.2007 15:04:53"
    Action="B"
    TypeExt="RD"
    ExecMoment="28.03.2007 19:00:10"
    Qty="21700"
    Currency="RUR"
    Amt="5338200"
    State="EXECUTED"
    Memo="for him"
    InclYield="1" >
    <Settlement Type="GTS" Date="28.03.2007" />
    <CounterParty ContrCode="TRN1M" />
    <Contract
      Number="GQTS0003604490"
      Action="S"
      TypeExt="RB"
      ExecMoment="04.04.2007 16:00:37"
      Amt="5346901.92"
      State="EXECUTED" >
      <Settlement Type="GTS" Date="04.04.2007" />
    </Contract>
  </Contract>
</Contract>
<Contract
  Number="GQTS0003604386"
  TSOOrderNumber="0003604386"
  MarketCode="RTS"
  Type="B"
  Moment="28.03.2007 14:36:51"
  Action="B"
  TypeExt="RD"
  ExecMoment="28.03.2007 19:00:00"
  Qty="21500"
  Currency="RUR"
  Amt="5289000"
  State="EXECUTED"
  Memo=""
  InclYield="0" >
  <Settlement Type="GTS" Date="28.03.2007" />
  <CounterParty ContrCode="TRN1M" />
  <Contract
    Number="GQTS0003604455"
    Action="S"
    TypeExt="RB"
    ExecMoment=""
    Amt="5297621.72"
    State="EXPIRED" >
    <Settlement Type="GTS" Date="04.04.2007" />
  </Contract>
</Contract>
</Issue>
```

```
</Client>
</SettlPairGroup>
<SettlPairGroup>
  <SettlPair>
    <Account                      OrgType="B"                      OrgCode="RTS-SC"
AccCode="30218810700000000002" />
    <Account OrgType="D" OrgCode="DCC" AccCode="1998" />
  </SettlPair>
  <Client ClientCode="ltd" Inn="#CYP C1111" >
    <Issue      Type="BON"      Code="ROTR01"      TSCode="ROTR01G"
SubCode="RF0000005499"
      FaceValue="100000" Currency="RUR" >
      <Bond AI="2478.08" Date="04.04.2007" />
      <Bond AI="2500" Date="13.04.2007" />
      <Contract
        Number="GQTS0003612227"
        TSOOrderNumber="0003612227"
        MarketCode="RTS"
        Type="B"
        Moment="03.04.2007 15:24:51"
        Action="S"
        TypeExt="RD"
        ExecMoment="03.04.2007 16:00:10"
        Qty="100"
        Currency="RUR"
        Amt="10247808"
        AISum="247808"
        State="EXECUTED"
        Memo=""
        InclYield="0" >
        <Settlement Type="GTS" Date="03.04.2007" />
        <CounterParty ContrCode="TRN3M" />
        <Contract Number="GQTS0003612232"
          Action="B"
          TypeExt="RB"
          ExecMoment=""
          Amt="10277397.26"
          AISum="250000"
          State="WAITING" >
          <Settlement Type="GTS" Date="13.04.2007" />
        </Contract>
      </Contract>
    </Issue>
  </Client>
</SettlPairGroup>
<SettlPairGroup>
  <SettlPair>
    <Account                      OrgType="B"                      OrgCode="RTS-SC"
AccCode="40807840700000000002" />
    <Account OrgType="D" OrgCode="DCC" AccCode="1998" />
  </SettlPair>
  <Client ClientCode="ltd" Inn="#CYP C1111" >
    <Issue      Type="SHS"      Code="GAZP"      TSCode="GAZP"
SubCode="RF0000001636" >
      <Contract
        Number="REPO0003612227S"
        Type="B"
        Moment="06.03.2007 18:04:51"
        Action="S"
        TypeExt="RD"
        ExecMoment="06.03.2007 18:14:10"
```

```

Qty="100"
Currency="USD"
Amt="10247808"
State="EXECUTED"
Memo="for us"
InclYield="0" >
<Settlement Type="RMS" Date="06.04.2007" />
<CounterParty ContrCode="RTSPM" />
<Contract Number="REPO0003612228B"
    Action="B"
    TypeExt="RB"
    ExecMoment=""
    Amt="10247800"
    State="WAITING" >
    <Settlement Type="RMS" Date="07.04.2007" />
</Contract>
</Contract>
</Issue>
</Client>
</SettlPairGroup>
</Receiver>
    
```

Элемент CounterParty

М/О	Атрибут	Описание	Тип
М	ContrCode	Код контрагента по сделке (участника торгов или Клирингового центра)	text
О	ContrClientCode	Код клиента участника торгов – контрагента по сделке	text

Правила формирования значений определенных атрибутов элемента:

- Атрибут «ContrClientCode» указывается в случае, если сделка заключена одним участником торгов за счет разных клиентов.

VI. «Отчет о Сделках с отложенным исполнением»

В отчет включается информация о неисполненных Сделках с отложенным исполнением либо сделках, исполненных в дату формирования отчета.

Отчет DAY TPN

М/О	Элемент	Описание	Элемент - владелец
M	Receiver	Информация о получателе отчета и дате (периоде), за который сформирован отчет	-
M	Report	Тип, название и версия отчета	Receiver
M	SettlPairGroup	Группа расчетных пар с уникальным сочетанием денежного торгового счета и торгового счета депо	Receiver
M	SettlPair	Расчетная пара с уникальным сочетанием денежного торгового счета и торгового счета депо	SettlPairGroup
M	Account	Торговый счет (денежный или депозитарный), входящий в состав расчетной пары счетов	SettlPair
M	Client	Клиент	SettlPairGroup
M	Issue	Информация о ценной бумаге	Client
O	Bond	НКД на одну ценную бумагу	Issue
M	Settlement	Тип и дата расчетов	Client
M	Contract	Информация о Сделке с отложенным исполнением	Settlement
M	CounterParty	Контрагент по Сделке с отложенным исполнением	Contract

Правила указания элементов и значений определенных атрибутов элементов:

- В атрибуте «Type» элемента «Settlement» (Settlement.Type) всегда указывается значение «GTS».
- Элемент «Bond» указывается только для облигаций (Issue.Type=«BON»). Количество элементов «Bond» в отчете соответствует количеству разных дат исполнения Сделок с отложенным исполнением, включенных в отчет.

Пример:

```
<?xml version="1.0" encoding="Windows-1251"?>
<?xml-stylesheet type="text/xsl" href=".\\DAY_TPN.xsl"?>
<Receiver Id="TRNMM" Name="Закрытое Акционерное Общество &quot;ФИНАНС&quot;"
DateTo="06.03.2007" DateRpt="09.03.2007 19:31:05">
  <Report Type="DAY_TPN" Desc="Отчет о Сделках с отложенным исполнением" Ver="1" />
  <SettlPairGroup>
    <SettlPair>
      <Account OrgType="B" OrgCode="RTS-SC"
AccCode="30218810700000000001" />
      <Account OrgType="D" OrgCode="RDC" AccCode="883F/00100001" />
    </SettlPair>
    <Client ClientCode="trnmm1" Inn="5906060488" >
      <Issue Type="SHS" Code="GAZP" TSCode="GSPBEX" SubCode="1-02-00028-
```

```
A" >
    <Settlement Type="GTS" Date="15.06.2006" >
        <Contract
            Number="RTST0003186438"
            TSOOrderNumber="0003186438"
            MarketCode="RTS"
            Type="B"
            Moment="14.06.2006 18:51:48"
            Action="B"
            TypeExt="O"
            ExecMoment="15.06.2006 13:10:41"
            Qty="1000000"
            Currency="RUR"
            Price="235"
            Amt="235000000"
            State="EXECUTED" >
            <CounterParty ContrCode="TRN1M" />
        </Contract>
        <Contract
            Number="RTST0003186439"
            TSOOrderNumber="0003186439"
            MarketCode="RTS"
            Type="B"
            Moment="14.06.2006 18:52:04"
            Action="B"
            TypeExt="O"
            ExecMoment="15.06.2006 13:10:41"
            Qty="500000"
            Currency="RUR"
            Price="235"
            Amt="117500000"
            State="EXECUTED" >
            <CounterParty ContrCode="TRN2M" />
        </Contract>
    </Settlement>
    <Settlement Type="GTS" Date="16.06.2006" >
        <Contract
            Number="RTST0003186438"
            TSOOrderNumber="0003186438"
            MarketCode="RTS"
            Type="B"
            Moment="14.06.2006 18:51:48"
            Action="S"
            TypeExt="O"
            ExecMoment=""
            Qty="1000000"
            Currency="RUR"
            Price="235"
            Amt="235000000"
            State="WAITING" >
            <CounterParty ContrCode="TRN3M" />
        </Contract>
    </Settlement>
</Issue>
</Client>
</SettlPairGroup>
<SettlPairGroup>
    <SettlPair>
        <Account
            OrgType="B"
            OrgCode="RTS-SC"
            AccCode="30218810700000000002" />
        <Account OrgType="D" OrgCode="DCC" AccCode="1998" />
    </SettlPair>
</SettlPairGroup>
</SettlPairGroup>
</Client>
A" <
```



```
</SettlPair>
  <Client ClientCode="ltd" Inn="#CYP C11111" >
    <Issue      Type="BON"      Code="ROTR01"      TSCode="ROTR01G"
SubCode="RF0000005499"
      FaceValue="100000" Currency="RUR" >
      <Bond AI="2500" Date="15.06.2006" />
      <Settlement Type="GTS" Date="15.06.2006" >
        <Contract
          Number="RTST0003186440"
          TSOOrderNumber="0003186440"
          MarketCode="RTS"
          Type="B"
          Moment="14.06.2006 18:51:48"
          Action="B"
          TypeExt="O"
          ExecMoment=""
          Qty="10"
          Currency="RUR"
          Price="110000"
          Amt="1125000"
          AISum="25000"
          State="EXPIRED"
          Memo="" >
          <CounterParty      ContrCode="TRNMM"
ContrClientCode="trnmm2" />
        </Contract>
      </Settlement>
    </Issue>
  </Client>
</SettlPairGroup>
</Receiver>
```

VII. «Клиринговый отчет об исполненных поручениях на клиринг»

В отчет включается информация об исполненных в дату формирования отчета поручениях на клиринг по сделкам без предварительного обеспечения.

Отчет DAYCONTRACT_DVP

М/О	Элемент	Описание	Элемент - владелец
М	Receiver	Информация о получателе отчета и дате (периоде), за который сформирован отчет	-
М	Report	Тип, название и версия отчета	Receiver
М	SettlPairGroup	Группа расчетных пар с уникальным сочетанием денежного торгового счета и торгового счета депо	Receiver
М	SettlPair	Расчетная пара с уникальным сочетанием денежного торгового счета и торгового счета депо	SettlPairGroup
М	Account	Торговый счет (денежный или депозитарный), входящий в состав расчетной пары счетов	SettlPair
М	Client	Клиент	SettlPairGroup
М	Issue	Информация о ценной бумаге	Client
О	Bond	НКД на одну ценную бумагу	Issue
М	Settlement	Тип и дата расчетов	Issue
М	Contract	Информация о поручении на клиринг	Settlement
О	Payment	Информация о платеже	Contract

Правила указания элементов и значений определенных атрибутов элементов:

- Элемент «Bond» указывается только для облигаций (Issue.Type="BON").
- В элементе «SettlPair» всегда указываются номера торговых счетов, использованных для расчетов по поручениям на клиринг.
- В атрибуте «Type» элемента «Settlement» (Settlement.Type) всегда указывается значение "DVP".

Пример:

```
<?xml version="1.0" encoding="Windows-1251"?>
<?xml-stylesheet type="text/xsl" href=".\\DAYCONTRACT_DVP.xsl"?>
<Receiver Id="TRNMM" Name="Закрытое Акционерное Общество &quot;ФИНАНС&quot;"
DateTo="16.01.2007" DateRpt="17.01.2007 19:31:05">
  <Report Type="DAYCONTRACT_DVP" Desc="Клиринговый отчет об исполненных
поручениях
на клиринг" Ver="1" />
  <SettlPairGroup>
    <SettlPair>
      <Account OrgType="B" OrgCode="RTS-SC"
AccCode="30218810700000000001" />
      <Account OrgType="D" OrgCode="DCC" AccCode="1998" />
    </SettlPair>
    <Client ClientCode="trnmm1" Inn="5906060488" >
      <Issue Type="SHS" Code="EESR">
```

```
<Settlement Type="DVP" Date="16.01.2007">
  <Contract
    Number="RTST0003431416"
    AgrNumber="RTST0003431416"
    Moment="15.01.2007 15:41:38"
    Action="S"
    TypeExt="P"
    ExecMoment="16.01.2007 16:01:00"
    Qty="6"
    Currency="RUR"
    Price="54500.00000"
    Amt="327000.00"
    State="EXECUTED" >
  </Contract>
  <Contract Number="RTST0003431432"
    AgrNumber="RTST0003431432"
    Moment="15.01.2007 18:01:55"
    Action="B"
    TypeExt="P"
    ExecMoment="16.01.2007 19:00:05"
    Qty="6"
    Currency="RUR"
    Price="54527.00000"
    Amt="327162.00"
    State="EXECUTED" >
  </Contract>
</Settlement>
</Issue>
<Issue Type="BON" Code="ROTR01" FaceValue="100000" Currency="RUR" >
  <Bond AI="2478.08" Date="16.01.2007" />
  <Settlement Type="DVP" Date="16.01.2007" >
    <Contract
      Number="RTST0003478836"
      AgrNumber="RTST0003478836"
      Moment="15.01.2007 15:24:51"
      Action="S"
      TypeExt="P"
      ExecMoment="16.03.2007 16:01:33"
      Qty="1"
      Currency="RUR"
      Price="100020.00000"
      Amt="102498.08"
      AISum="2478.08"
      State="EXECUTED" >
    </Contract>
  </Settlement>
</Issue>
</Client>
</SettlPairGroup>
<SettlPairGroup>
  <SettlPair >
    <Account
      OrgType="B"
      OrgCode="RTS-SC"
      AccCode="30218810700000000002" />
    <Account OrgType="D" OrgCode="RDC" AccCode="883F/00100001" />
  </SettlPair>
  <Client ClientCode="ltd" Inn="#CYP C1111" AnCls="1" >
    <Issue Type="SHS" Code="GAZP" >
      <Settlement Type="DVP" Date="16.01.2007" >
        <Contract
          Number="RTST0003490958"
          AgrNumber="RTST0003490958"
```

```

Moment="15.01.2007 18:27:04"
Action="S"
TypeExt="P"
ExecMoment="16.03.2007 15:08:09"
Qty="12000"
Currency="USD"
Price="9.84500"
Amt="118140.00"
State="EXECUTED" >
<Payment Currency="RUR"
Amt="3098552.29"
RateValue="26.2278" />
</Contract>
</Settlement>
</Issue>
</Client>
</SettlPairGroup>
</Receiver>

```

Элемент Payment

М/О	Атрибут	Описание	Тип
М	Currency	Валюта платежа	text
М	Amt	Сумма платежа	numeric(#,2)
О	AISum	Сумма НКД, включенная в сумму платежа	numeric(#,2)
М	RateValue	Курс валюты	numeric(#,5)

Правила формирования значений определенных атрибутов элемента:

- Атрибут «Currency» может принимать следующие значения:
 - “RUR” – рубли Российской Федерации;
 - “USD” – доллары США.
- Для сделок с облигациями значение атрибута «Amt» - это сумма платежа, включая НКД.
- Атрибут «AISum» указывается только для сделок с облигациями.
- Атрибут «RateValue» – курс рубля к доллару, по которому сумма сделки пересчитана в сумму платежа, указывается в случае, если «Валюта сделки» (Contract.Currency) и «Валюта платежа» (Payment.Currency) не совпадают.

VIII. «Клиринговый отчет об исполненных обязательствах по поставочным срочным контрактам»

В отчет включается информация об исполненных в дату формирования отчета обязательствах по перерегистрации/оплате ценных бумаг, являющихся базовым активом поставочных срочных контрактов.

Отчет DAYCONTRACT_FTS

М/О	Элемент	Описание	Элемент - владелец
М	Receiver	Информация о получателе отчета и дате (периоде), за который сформирован отчет	-
М	Report	Тип, название и версия отчета	Receiver
М	SettlPairGroup	Группа расчетных пар с уникальным сочетанием денежного торгового счета и торгового счета депо	Receiver
М	SettlPair	Расчетная пара с уникальным сочетанием денежного торгового счета и торгового счета депо	SettlPairGroup
М	Account	Торговый счет (денежный или депозитарный), входящий в состав расчетной пары счетов	SettlPair
М	Client	Клиент	SettlPairGroup
М	Issue	Информация о ценной бумаге	Client
О	Bond	НКД на одну ценную бумагу	Issue
М	Settlement	Тип и дата расчетов	Issue
М	Contract	Информация об исполненных обязательствах	Settlement

Правила указания элементов и значений определенных атрибутов элементов:

- В атрибуте «ClientCode» элемента «Client» указывается код раздела регистра учета позиций.
- Элемент «Bond» указывается только для облигаций (Issue.Type="BON").
- В атрибуте «Type» элемента «Settlement» (Settlement.Type) всегда указывается значение "FTS".

Пример:

```
<?xml version="1.0" encoding="Windows-1251"?>
<?xml-stylesheet type="text/xsl" href=".\\DAYCONTRACT_FTS.xsl"?>
<Receiver Id="TRNMM" Name="Закрытое Акционерное Общество &quot;ФИНАНС&quot;"
DateTo="06.03.2007" DateRpt="09.03.2007 19:31:05">
  <Report Type="DAYCONTRACT_FTS" Desc="Клиринговый отчет об исполненных
обязательствах по
поставочным срочным контрактам" Ver="1" />
  <SettlPairGroup>
    <SettlPair >
      <Account OrgType="B" OrgCode="RTS-SC"
AccCode="30218810700000000002" />
      <Account OrgType="D" OrgCode="RDC" AccCode="883F/00100001" />
    </SettlPair>
    <Client ClientCode="E101115" Inn="#CYP C11111" >
      <Issue Type="SHS" Code="GAZP" TSCode="GSPBEX" SubCode="1-02-00028-
```

```
A" >
      <Settlement Type="FTS" Date="06.03.2007" >
        <Contract
          Number="FTS0003490958"
          InclMoment="01.03.2007 09:27:04"
          Action="B"
          TypeExt="D"
          ExecMoment="06.03.2007 19:01:34"
          Qty="12000"
          Currency="RUR"
          Price="258.08372"
          Amt="3097004.64"
          State="EXECUTED">
        </Contract>
      </Settlement>
    </Issue>
  </Client>
</SettlPairGroup>
</Receiver>
```

IX. «Клиринговый отчет об исполненных Сделках T+N»

Отчет формируется для Участников клиринга, а также для клиентов Участника клиринга, на разделе регистра учета позиций которых установлен признак формирования отчетов.

В отчет включается информация об исполненных в дату формирования отчета:

- Сделках T+N;
- поручениях на перевод позиций с одного раздела регистра учета позиций на другой в рамках разделов одной Расчетной фирмы.

В отчет для Участника клиринга включается перечисленная выше информация по всем разделам регистра учета позиций Участника клиринга.

В отчет для Брокерской фирмой, включается перечисленная выше информация по всем разделам регистра учета позиций Брокерской фирмы.

В отчет для клиента Участника клиринга включается перечисленная выше информация по разделу регистра учета позиций клиента Участника клиринга.

Отчет DAYCONTRACT_STS

М/О	Элемент	Описание	Элемент – владелец
M	Receiver	Информация об Участнике клиринга - получателе отчета и дате (периоде), за который сформирован отчет	-
M	Report	Тип, название и версия отчета	Receiver
M	SettlPairGroup	Группа расчетных пар с уникальным сочетанием денежного торгового счета и торгового счета депо	Receiver
M	SettlPair	Расчетная пара с уникальным сочетанием денежного торгового счета и торгового счета депо	SettlPairGroup
M	Account	Торговый счет (денежный или депозитарный), входящий в состав расчетной пары счетов	SettlPair
M	Client	Клиент	SettlPairGroup
M	Issue	Информация об Инструменте	Client
M	Settlement	Тип и дата расчетов	Issue
M	Contract	Информация о сделке / поручении	Settlement
M	TotalExecution	Итоговые обязательства по клиенту	Client

Правила указания элементов и значений определенных атрибутов элементов:

- В атрибуте «Type» элемента «Settlement» (Settlement.Type) всегда указывается значение «STS».
- В атрибуте «ClientCode» элемента «Client» указывается код раздела регистра учета позиций.
- Для элемента «Contract» со значением атрибута «TypeExt», равным «P», атрибуты «TOrderNumber» и «MarketCode» принимают пустое значение.
- Для сделок купли-продажи ценных бумаг в составе пары сделок купли-продажи и для 1-ых и 2-ых частей сделок репо, заключенных Клиринговым центром с Расчетными фирмами в соответствии с Правилами клиринга при наличии Необеспеченных позиций Участника клиринга или Клирингового центра по

сделкам T+N, а также для Сделок переноса атрибуты «MarketCode» и «TSOrderNumber» элемента «Contract» принимают пустое значение.

- Для элемента «Contract» со значением атрибута «TypeExt», равным «P», атрибут «Price» не указывается.

Элемент TotalExecution

М/О	Атрибут	Описание	Тип
М	TransferBack	Сумма обязательств по возврату гарантийных переводов	numeric(#,2)
М	Amt	Итоговые обязательства с учетом обязательств по возврату гарантийных переводов	numeric(#,2)
М	Currency	Валюта обязательств	text

- Значения атрибутов «TransferBack», «Amt» указываются с учетом знака: знак «-» означает, что Участник клиринга должен уплатить указанную сумму, знак «+» означает, что Участник клиринга должен получить указанную сумму.
- Атрибут «Currency» может принимать следующее значение:
 - "RUR" – рубли Российской Федерации.

Пример:

```
<?xml version="1.0" encoding="Windows-1251"?>
<?xml-stylesheet type="text/xsl" href=".\\DAYCONTRACT_STS~105.xsl"?>
<Receiver Id="STRTM" Name="Закрытое акционерное общество &quot;Финансовая компания
&quot;Старт минус&quot;" DateTo="16.03.2011" DateRpt="16.03.2011 17:43:36">
  <Report Type="DAYCONTRACT_STS" Desc="Клиринговый отчет об исполненных Сделках
T+N" Ver="105" />
  <SettlPairGroup>
    <SettlPair>
      <Account OrgType="B" OrgCode="NSD" AccCode="30218810700000000009"
/>
      <Account OrgType="D" OrgCode="NSD" AccCode="6920" />
    </SettlPair>
    <Client ClientCode="S0000ZZ" Inn="54 98 731333">
      <Issue Type="SHS" Code="SBER" TSCode="SBER"
SubCode="RF0000011343" Name="ОАО Сбербанк России, ао" FaceValue="3.00000" Currency="RUR" >
        <Settlement Type="STS" Date="16.03.2011">
          <Contract
Number="STS0263591544B"
TSOrderNumber="2944437654"
MarketCode="RTS"
Type="A"
Moment="10.03.2011 10:04:45"
Action="B"
TypeExt="S"
Qty="100"
Currency="RUR"
Price="76.55000"
Amt="7655.00"
State="EXECUTED"
InclMoment="16.03.2011 17:16:16"
ExecMoment="16.03.2011 17:36:01" />
        </Settlement>
      </Issue>
      <TotalExecution Currency="RUR" TransferBack="-367.00" Amt="-8022.00" />
    </Client>
  </SettlPairGroup>
</Receiver>
```


Х. «Отчет о комиссионных вознаграждениях клирингового центра и организаторов торговли»

В отчет включается информация о суммах комиссионных вознаграждений, рассчитанных в дату формирования отчета.

Отчет DAYFEE

М/О	Элемент	Описание	Элемент - владелец
М	Receiver	Информация о получателе отчета и дате (периоде), за который сформирован отчет	-
М	Report	Тип, название и версия отчета	Receiver
М	Account	Банковский счет, с которого списано комиссионное вознаграждение	Receiver
М	FeeScheme	Информация о схеме комиссионного вознаграждения	Account
М	Fee	Информация о базе для расчета суммы комиссионного вознаграждения	FeeScheme
О	Client	Информация о клиенте	Fee
М	FeeSum	Информация о сумме комиссионного вознаграждения	Fee
М	Total	Итоговая сумма комиссионных вознаграждений	FeeScheme
М	FeeSum	Информация о сумме комиссионного вознаграждения	Total

Правила указания элементов и значений определенных атрибутов элементов:

- Если счет для списания комиссионных вознаграждений не зарегистрирован в Клиринговом центре, то элемент «Account» указывается без атрибутов.
- Элемент «Client» не указывается для схем комиссионного вознаграждения с типом «ORD» (FeeScheme.Type="ORD").
- Элемент «PayOrderSum» указывается только для схем комиссионного вознаграждения с типом «ORD» (FeeScheme.Type="ORD").

Пример:

```
<?xml version="1.0" encoding="Windows-1251"?>
<?xml-stylesheet type="text/xsl" href=".\\DAYFEE~105.xsl"?>
<Receiver Id="GAPRCK" Name="Акционерный банк &quot;Утес&quot; (закрытое акционерное общество)" DateTo="07.11.2011" DateRpt="07.11.2011 19:34:22" >
  <Report Type="DAYFEE" Desc="Отчет о комиссионных вознаграждениях клирингового центра и организаторов торговли" Ver="105" />
  <Account OrgType="B" OrgCode="RTS-SC" AccCode="30214810300000000767">
    <FeeScheme Name="GAZPCL" Ctg="CLR" Type="TRD" Desc="Оплата клиринговых услуг ЗАО &quot;КЦ РТС&quot; по сделкам с акциями и инвестиционными паями" >
      <Fee Number="GQTS0004247496" Billing="1" CurrLst="RUR" >
        <Client ClientCode="828" Inn="45 04 842380" />
        <FeeSum Currency="RUR" Sum="20.16" Vat="3.08" />
      </Fee>
      <Total CurrLst="RUR" >
        <FeeSum Currency="RUR" Sum="20.16" Vat="3.08" />
      </Total>
    </FeeScheme>
```

```

<FeeScheme Name="SPBTRD" Ctg="TRD" Type="TRD" Descr="Биржевой сбор ОАО
&quot;СПБ&quot; за регистрацию сделок с акциями" >
  <Fee Number="GQTS0004247496" Billing="1" CurrLst="RUR" >
    <Client ClientCode="828" Inn="45 04 842380" />
    <FeeSum Currency="RUR" Sum="15.12" Vat="2.31" />
  </Fee>
  <Total CurrLst="RUR" >
    <FeeSum Currency="RUR" Sum="15.12" Vat="2.31" />
  </Total>
</FeeScheme>
</Account>
</Receiver>

```

Элемент FeeScheme

М/О	Атрибут	Описание	Тип
М	Name	Классификатор комиссионной схемы	text
М	Ctg	Категория комиссионной схемы	text
М	Type	Тип комиссионной схемы	text
М	Descr	Описание комиссионной схемы	text

Правила формирования значений определенных атрибутов элемента:

- Атрибут «Ctg» может принимать следующие значения:
 - “TRD” – комиссионное вознаграждение организатора торговли;
 - “CLR” – комиссионное вознаграждение клирингового центра;
 - “DEPO” – комиссионное вознаграждение депозитария.
- Атрибут «Type» может принимать следующие значения:
 - “TRD” – комиссионное вознаграждение рассчитывается по сделке;
 - “POS” – комиссионное вознаграждение рассчитывается от изменения остатка по счету.
 - “ORD” – фиксированное комиссионное вознаграждение за зачисление (списание) средств на (с) денежные регистры (денежных регистров) Участников клиринга.

Элемент Fee

М/О	Атрибут	Описание	Тип
О	Number	Номер сделки / поручения	text
О	IssueNetto	Изменение остатка по счету депо по сделкам, за исключением Сделок репо	numeric(#,0)
М	Billing	Признак, сформировано поручение на списание комиссионного вознаграждения или нет	boolean
М	CurrLst	Список валют	text

Правила формирования значений определенных атрибутов элемента:

- Атрибут «Number» указывается для комиссионных схем, у которых FeeScheme.Type=“TRD” или FeeScheme.Type=“ORD”.
- Атрибут «IssueNetto» указывается для комиссионных схем, у которых FeeScheme.Ctg=“DEPO”.
- Атрибут «Billing» может принимать следующие значения:
 - “1” – поручение на списание комиссионного вознаграждения сформировано;
 - “0” – поручение на списание комиссионного вознаграждения не сформировано.
- Атрибут «CurrLst» может принимать следующие значения:

- “RUR” – рубли Российской Федерации.

Элемент FeeSum

М/О	Атрибут	Описание	Тип
М	Currency	Валюта комиссионного вознаграждения	text
М	Sum	Сумма комиссионного вознаграждения	numeric(#,2)
М	Vat	Сумма НДС	numeric(#,2)

Правила формирования значений определенных атрибутов элемента:

- Атрибут «Currency» может принимать следующие значения:
 - “RUR” – рубли Российской Федерации.
- Для сделок, по которым поручения на списание комиссионного вознаграждения не сформированы (Fee.Billing=“0”), элемент «FeeSum» с атрибутом «Currency», равным ”RUR”, не указывается.

Элемент Total

М/О	Атрибут	Описание	Тип
М	CurrLst	Список валют	text

Правила формирования значений определенных атрибутов элемента:

- Атрибут «CurrLst» может принимать следующие значения:
 - “RUR” – рубли Российской Федерации.

XI. «Отчет о комиссионных вознаграждениях АБ «Газпромбанк»

В отчет включается информация о суммах комиссионных вознаграждений, рассчитанных в дату формирования отчета.

Отчет DAYFEE_GPB

М/О	Элемент	Описание	Элемент - владелец
М	Receiver	Информация о получателе отчета и дате (периоде), за который сформирован отчет	-
М	Report	Тип, название и версия отчета	Receiver
М	Account	Банковский счет, с которого списано комиссионное вознаграждение	Receiver
М	FeeScheme	Информация о схеме комиссионного вознаграждения	Account
М	Issue	Информация о ценной бумаге	FeeScheme
О	MarketPrice	Рыночная цена акции ОАО «Газпром», использованная при расчете суммы комиссионного вознаграждения	Issue
М	Account	Информация о торговом счете депо	Issue
М	Fee	Информация о базе для расчета суммы комиссионного вознаграждения	Account
О	Client	Информация о клиенте	Fee
М	FeeSum	Информация о сумме комиссионного вознаграждения	Fee
М	Total	Итоговая сумма комиссионных вознаграждений	FeeScheme
М	FeeSum	Информация о сумме комиссионного вознаграждения	Total

Правила указания элементов и значений определенных атрибутов элементов:

- В атрибуте «Ctg» элемента «FeeScheme» (FeeScheme.Ctg) всегда указывается значение «DEPO».
- Элемент «MarketPrice» указывается для комиссионной схемы FeeScheme.Name="GAZPGPB".
- Элемент «Client» указывается для комиссионной схемы FeeScheme.Name="GPBREPO".

Пример:

```
<?xml version="1.0" encoding="Windows-1251"?>
<?xml-stylesheet type="text/xsl" href=".DAYFEE_GPB~103.xsl"?>
<Receiver Id="TRNMM" Name="Закрытое Акционерное Общество &quot;ФИНАНС&quot;"
DateTo="07.11.2011" DateRpt="07.11.2011 19:34:23" >
  <Report Type="DAYFEE_GPB" Desc="Отчет о комиссионных вознаграждениях АБ
<Газпромбанк>" Ver="103" />
  <Account OrgType="B" OrgCode="RTS-SC" AccCode="3021481050000000909">
    <FeeScheme Name="GAZPGPB" Ctg="DEPO" Type="POS" Desc="Оплата
депозитарных услуг АБ &quot;Газпромбанк&quot; по акциям ОАО &quot;Газпром&quot;, кроме
сделок РЕПО" >
      <Issue Type="SHS" Code="GAZP" TSCode="GSPBEX" SubCode="1-02-00028-
```

```

A" Name="ОАО Газпром, ао" FaceValue="5.00000" Currency="RUR" >
  <MarketPrice      Currency="RUR"      TradeDate="03.11.2011"
Value="180.90000" Source="SPB" />
  <Account OrgType="D" OrgCode="RDC" AccCode="883F/34700622" >
    <Fee IssueNetto="5460.00" Billing="1" CurrLst="RUR" >
      <FeeSum Currency="RUR" Sum="29.14" Vat="4.45"
/>
    </Fee>
  </Account>
</Issue>
<Total CurrLst="RUR" >
  <FeeSum Currency="RUR" Sum="29.14" Vat="4.45" />
</Total>
</FeeScheme>
</Account>
</Receiver>

```

Элемент *MarketPrice*

М/О	Атрибут	Описание	Тип
М	Currency	Валюта цены	Text
М	TradeDate	Дата, за которую взята рыночная цена	Date
М	Value	Значение рыночной цены	numeric(#,5)
М	Source	Источник информации о рыночной цене	Text

Правила формирования значений определенных атрибутов элемента:

- Атрибут «Currency» может принимать следующее значение:
 - «RUR» – рубли Российской Федерации.
- Атрибут «Source» может принимать следующие значения:
 -
 - “SPB” – ОАО «СПБ».

ХII. «Отчет о Договорах займа Клирингового центра»

В отчет включается информация о Договорах займа Клирингового центра заключенных в дату формирования отчета.

Отчет DAY_LOAN

М/О	Элемент	Описание	Элемент - владелец
M	Receiver	Информация о получателе отчета и дате (периоде), за который сформирован отчет	-
M	Report	Тип, название и версия отчета	Receiver
M	SettlPairGroup	Группа расчетных пар с уникальным сочетанием денежного торгового счета и торгового счета депо	Receiver
M	SettlPair	Расчетная пара с уникальным сочетанием денежного торгового счета и торгового счета депо	SettlPairGroup
M	Account	Торговый счет (денежный или депозитарный), входящий в состав расчетной пары счетов	SettlPair
M	Client	Клиент	SettlPairGroup
M	Issue	Информация о ценной бумаге	Client
M	Contract	Информация о Договоре займа Клирингового центра	Issue
M	Settlement	Дата возврата займа	Contract
M	CounterParty	Контрагент по Договору займа Клирингового центра	Contract

Правила указания элементов и значений определенных атрибутов элементов:

- В атрибуте «Action» элемента «Contract» (Settlement.Type) всегда указывается значение «S»;
- В атрибуте «TypeExt» элемента «Contract» (Settlement.Type) всегда указывается значение «L»;
- В атрибуте «InclYield» элемента «Contract» (Settlement.Type) всегда указывается значение «1»;
- Для элемента «Contract» атрибуты «RepoRealNumber», «TSOrderNumber», «MarketCode», «Type», «ExecMoment», «Price», «Memo», «InclMoment» принимают пустое значение.