

## УТВЕРЖДЕНЫ

Правлением  
Банка «Национальный Клиринговый Центр»  
(Акционерное общество)

Протокол № 23 от 22 июня 2016 года

И.о. Председателя Правления  
Банка «Национальный Клиринговый Центр»  
(Акционерное общество)



Е.С. Демущкина

М.П.

## ФОРМАТЫ ОТЧЕТОВ, ПРЕДОСТАВЛЯЕМЫХ УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА НА СРОЧНОМ РЫНКЕ

г. Москва,  
2016 г.

## СОДЕРЖАНИЕ

1.	Общие положения .....	3
2.	Отчет о заключенных Сделках.....	5
3.	Отчет о заключенных опционных контрактах.....	7
4.	Отчет об итогах Торгов Инструментами и Связками .....	9
5.	Отчет об итогах Торгов опционными контрактами .....	12
6.	Отчет об обязательствах по Сделкам .....	13
7.	Отчет об обязательствах по опционным контрактам.....	15
8.	Отчет о денежных средствах в рублях, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Средствами гарантийного обеспечения .....	16
9.	Предварительный отчет о денежных средствах в рублях РФ, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Средствами гарантийного обеспечения.....	19
10.	Отчет об операциях по разделам денежного регистра и депо регистра обеспечения ...	20
11.	Отчет об операциях с иностранной валютой и ценными бумагами, учитываемыми в качестве Средств гарантийного обеспечения .....	21
12.	Отчет о разделах клиринговых регистров.....	22
13.	Отчет о разделах клиринговых регистров, имеющих признак «Индивидуальный Инвестиционный Счет» .....	23
14.	Отчет о сборах за транзакции.....	23
15.	Отчет о сборах за неэффективные транзакции.....	24
16.	Отчет детализированный о сборах за неэффективные транзакции .....	24
17.	Отчет о сборах за неэффективные транзакции, подлежащих списанию .....	25
18.	Отчет о сборах за ошибочные транзакции по каждому клиентскому логину, подлежащих списанию.....	25
19.	Отчет о количестве ошибочных транзакций по каждому клиентскому логину.....	25
20.	Отчет о сборах за ошибочные транзакции по каждому клиентскому логину .....	26
21.	Отчет о заключенных Связках .....	26
22.	Информация о Сделках, составляющих Связку .....	28
23.	Отчет об иностранной валюте и ценных бумагах, предоставленных в качестве Средств гарантийного обеспечения.....	29
24.	Отчет о позициях по инструментам.....	30
25.	Отчет о соответствии Брокерской фирмы Расчетному коду валютного рынка .....	30
26.	Отчет о соответствии Торгово-клирингового счета Брокерской фирме/ разделу регистра учета позиций.....	31
27.	Сводная финансовая ведомость .....	32
28.	Отчет об обязательствах по поставочным фьючерсным контрактам на облигации .....	34

## 1. Общие положения

- 1.1. Настоящий документ «Форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга на срочном рынке» (далее – Форматы отчетов) разработан в соответствии с Правилами клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество), утвержденными уполномоченным органом Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) (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.
- 1.2. Форматы отчетов устанавливают форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга в соответствии с Правилами клиринга.
- 1.3. Термины, используемые в Форматах отчетов, используются в значениях, определенных Правилами клиринга.
- 1.4. 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](http://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.
- 1.5. Отчеты 2–26 предоставляются в виде файлов формата CSV.
- 1.6. В имени файлов XX означает код Расчетной фирмы, ХХУУ – код Брокерской фирмы, ХХУУZZZ – код раздела клиринговых регистров.

### Типы полей

Тип	Описание
char(n)	Строковое значение, включая символы кириллицы, состоящее из n символов
numeric(n, m)	Числа с десятичной точкой (если размер дробной части поля больше 0) или числа без десятичной точки (если размер дробной части поля отсутствует или равен 0) n – размер целой части m – размер дробной части
date	Дата в формате: YYYY/MM/DD
time	Время в формате: hh:mm:ss

- 1.7. В целях настоящего документа:

**Инструментом** именуется предмет и условия сделок, определяемые кодом инструмента.

**Сделкой** именуется Срочный контракт.

**Связкой** именуется несколько Срочных контрактов, заключенных на основании одной заявки.

Для Связок с количеством Сделок равным двум под **ценой Связки** понимается процентная ставка, под ценой Связки в пунктах или рублях понимается своп-цена -

разница между ценой первой Сделки в Связке и ценой второй Сделки в Связке (возможно отрицательная).

Под **биржевым сбором** понимается сбор Организатора торговли, взимаемый за заключение Срочных контрактов.

Сумма биржевого сбора и вознаграждения Клирингового центра устанавливается для каждой Связки.

**Дата исполнения Связки** – это ближайшая дата из дат исполнения Сделок, входящих в Связку.

**Отчетный день** – это Торговый день в соответствии с правилами организованных торгов ПАО Московская Биржа (далее – Биржа), регулирующими порядок проведения организованных торгов на Срочном рынке Биржи.

## 2. Отчет о заключенных Сделках

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Брокерской фирме, имя файла – **f04\_XXYY.csv**.

При формировании отчета по разделам регистра учета позиций, по которым установлен признак формирования отчетов, имя файла – **f04clXXYYZZZ.csv**.

Структура CSV-файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
id_deal	numeric(10)	Идентификационный номер Сделки
isin	char(25)	Код (обозначение) Инструмента
price	numeric(16,5)	Цена заключения Сделки (в пунктах)
vol	numeric(10)	Количество Инструментов в Сделке (в штуках)
kod_sell	char(7)	Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке, поданной Продавцом, на основании которой заключена Сделка
kod_buy	char(7)	Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке, поданной Покупателем, на основании которой заключена Сделка
date	char(10)	Дата регистрации Сделки
time	char(8)	Время регистрации Сделки
profit_usd	numeric(20,4)	Не используется
type	numeric(2)	Признак: 0 – для Сделок, заключенных на основании безадресной Заявки, 1 – для обязательств по фьючерсным контрактам, которым возникли в результате исполнения Опционов, 2 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки, или для Поручений на перевод позиций при условии наличия в шлюзе битовой маски 0x8 в поле signs, 3 – для фьючерсных контрактов, обязательства по которым возникли в ходе проведения процедуры принудительного закрытия позиций, 11 – не является сделкой. Данные отображают информацию о прекращении обязательств в указанном объеме, 14 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 15 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 16 – для Поручений на управление риском
var_marg_b	numeric(16,2)	Обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи по фьючерсным контрактам (в рублях РФ)
var_marg_s	numeric(16,2)	Обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи по фьючерсным контрактам (в рублях РФ)
user_sell	char(20)	Имя (наименование) Продавца
user_buy	char(20)	Имя (наименование) Покупателя
no_buy	numeric(15)	Идентификационный номер Заявки, поданной Покупателем, на основании которой заключена

		Сделка
no_sell	numeric(15)	Идентификационный номер Заявки, поданной Продавцом, на основании которой заключена Сделка
fee_buy	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ)
fee_sell	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ)
date2	date	Дата регистрации Сделки
comm_buy	char(20)	Комментарий в Заявке, поданной Покупателем
comm_sell	char(20)	Комментарий в Заявке, поданной Продавцом
du_buy	numeric(1)	Признак того, что Сделка заключена Покупателем за счет средств, находящихся в доверительном управлении: 1 – за счет средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – не за счет средств, находящихся в доверительном управлении)
du_sell	numeric(1)	Признак того, что Сделка заключена Продавцом за счет средств, находящихся в доверительном управлении: 1 – за счет средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – не за счет средств, находящихся в доверительном управлении
fee_ns_b	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделку, заключенную на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ)
fee_ns_s	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделку, заключенную на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ)
price_rur	numeric(16,5)	Цена заключения Сделки (в рублях РФ)
ext_id_b	numeric(11)	Дополнительный идентификационный номер, указанный в заявке, поданной Покупателем
ext_id_s	numeric(11)	Дополнительный идентификационный номер, указанный в заявке, поданной Продавцом
date_clr	date	Дата проведения клиринга
repo_id	numeric(11)	Не используется
fee_ex_b	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Покупателем (в рублях РФ)
vat_ex_b	numeric(16,2)	Не используется
fee_cc_b	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Покупателем (в рублях РФ)
vat_cc_b	numeric(16,2)	Не используется
fee_ex_s	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Продавцом (в рублях РФ)
vat_ex_s	numeric(16,2)	Не используется
fee_cc_s	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра,

		подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ)
vat_cc_s	numeric(16,2)	Не используется
id_mult	numeric(10)	Для Сделки из Связки – идентификационный номер Связки, в которую входит Сделка Для Сделки, не входящей в Связку, всегда пустое
signs	numeric(11)	Битовая маска признаков Сделки
counterparty	char(7)	Код контрагента по Сделке (код Расчетной фирмы или код Брокерской фирмы), заключенной на основании адресной Заявки

Для Сделок, входящих в Связку, поля fee\_buy, fee\_sell, fee\_ex\_b, fee\_cc\_b, fee\_ex\_s, fee\_cc\_s заполняются таким образом, что сумма каждого из указанных полей по каждой сделке, входящих в Связку, равна значению соответствующего поля для Связки в отчете multilegf04.

### 3. Отчет о заключенных опционных контрактах

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Брокерской фирме, имя файла – **o04\_XXYY.csv**.

При формировании отчета по разделам регистра учета позиций, по которым установлен признак формирования отчетов, имя файла – **o04clXXYYZZZ.csv**.

Структура CSV-файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
id_deal	numeric(10)	Идентификационный номер сделки
isin	char(25)	Код (обозначение) опционных контрактов
price	numeric(16,5)	Цена заключения опционных контрактов – Премия (в пунктах)
vol	numeric(10)	Количество заключенных опционных контрактов (в штуках)
kod_sell	char(7)	Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке, поданной Продавцом, на основании которой заключены опционные контракты
kod_buy	char(7)	Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке, поданной Покупателем, на основании которой заключены опционные контракты
date	char(10)	Дата регистрации опционных контрактов
time	char(8)	Время регистрации опционных контрактов
profit_usd	numeric(20,4)	Не используется
type	numeric(1)	Признак: 0 – для опционных контрактов, заключенных на основании безадресной Заявки, 2 – для опционных контрактов, заключенных на основании адресной Заявки, или для Поручений на перевод позиций при условии наличия в шлюзе битовой маски 0x8 в поле signs, 3 – для опционных контрактов, обязательства по которым возникли в ходе проведения процедуры принудительного закрытия позиций. 4 – для опционных контрактов, снятых с учета с раздела регистра учета позиций, вследствие того, что права по ним не востребованы Держателем.

user_buy	char(20)	Имя (наименование) Продавца
user_sell	char(20)	Имя (наименование) Покупателя
no_buy	numeric(15)	Идентификационный номер Заявки, поданной Покупателем, на основании которой заключены опционные контракты
no_sell	numeric(15)	Идентификационный номер Заявки, поданной Продавцом, на основании которой заключены опционные контракты
fee_buy	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ)
fee_sell	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ)
date2	date	Дата регистрации опционных контрактов
comm_buy	char(20)	Комментарий в Заявке, поданной Покупателем
comm_sell	char(20)	Комментарий в Заявке, поданной Продавцом
du_buy	numeric(1)	Признак того, что опционные контракты заключены Покупателем за счет средств, находящихся в доверительном управлении: 1 – за счет средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – не за счет средств, находящихся в доверительном управлении
du_sell	numeric(1)	Признак того, что опционные контракты заключены Продавцом за счет средств, находящихся в доверительном управлении: 1 – за счет средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – не за счет средств, находящихся в доверительном управлении
fee_ns_b	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за опционные контракты, заключенные на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ)
fee_ns_s	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за опционные контракты, заключенные на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ)
prem_buy	numeric(16,2)	Обязательства Покупателя по уплате Премий по опционным контрактам (в рублях РФ)
prem_sell	numeric(16,2)	Требования Продавца по уплате Премий по опционным контрактам (в рублях РФ)
price_rur	numeric(16,5)	Цена заключения опционных контрактов - Премия (в рублях РФ)
ext_id_b	numeric(11)	Дополнительный идентификационный номер, указанный в заявке, поданной Покупателем
ext_id_s	numeric(11)	Дополнительный идентификационный номер, указанный в заявке, поданной Продавцом
date_clr	date	Дата проведения клиринга



var_marg_b	numeric(16,5)	Обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи по опционным контрактам (в рублях РФ)
var_marg_s	numeric(16,5)	Обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи по опционным контрактам (в рублях РФ)
fee_ex_b	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Покупателем (в рублях РФ)
vat_ex_b	numeric(16,2)	Не используется
fee_cc_b	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Покупателем (в рублях РФ)
vat_cc_b	numeric(16,2)	Не используется
fee_ex_s	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Продавцом (в рублях РФ)
vat_ex_s	numeric(16,2)	Не используется
fee_cc_s	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ)
vat_cc_s	numeric(16,2)	Не используется
signs	numeric(11)	Битовая маска признаков сделки
counterparty	char(7)	Код контрагента по Сделке (код Расчетной фирмы или код Брокерской фирмы), заключенной на основании адресной Заявки

Для маржируемых опционов в полях «prem\_buy» и «prem\_sell» всегда указывается ноль.

Для немаржируемых опционов в полях «var\_marg\_b» и «var\_marg\_s» всегда указывается ноль.

#### 4. Отчет об итогах Торгов Инструментами и Связками

Отчет предоставляется по итогам дневной клиринговой сессии и по итогам вечерней клиринговой сессии.

При предоставлении отчета по итогам дневной клиринговой сессии имя файла – **dayf07.csv**.

При предоставлении отчета по итогам вечерней клиринговой сессии имя файла – **f07.csv**.

Структура CSV-файлов:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения Торгов
contract	char(25)	Код (обозначение) Инструмента / Связки
execution	char(10)	Дата исполнения Сделок / Связок
volume	numeric(10)	Количество Инструментов в заключенных Сделках / Количество заключенных Связок (в штуках)
vol_rubl	numeric(17,2)	Объем обязательств по заключенным Сделкам / Связкам (в рублях РФ)
low	numeric(16,5)	Минимальная цена Инструмента / Связки (в пунктах)
high	numeric(16,5)	Максимальная цена Инструмента / Связки (в пунктах)
open	numeric(16,5)	Цена открытия (в пунктах)
close	numeric(16,5)	Цена закрытия (в пунктах)
settl	numeric(16,5)	Расчетная цена Инструмента / Связки, определенная в ходе вечерней клиринговой сессии (в пунктах)
trades	numeric(10)	Количество записей, внесенных в Реестр сделок при

		регистрации заключенных Сделок/ Связок
interest	numeric(10)	Количество Инструментов в заключенных Сделках, обязательства по которым не прекращены, учитываемых на разделах регистра учета позиций (в штуках)
fee	numeric(16,5)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за один фьючерсный контракт (в рублях РФ) / тариф биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделки /Связки (в процентах от суммы сделки)
tick_price	numeric(16,5)	Стоимость минимального шага цены Инструмента/Связки, установленная в Торговой системе (в рублях РФ)
tick	numeric(16,5)	Минимальный шаг цены Инструмента/Связки, установленный в Торговой системе (в пунктах)
avrg	numeric(16,5)	Средневзвешенная цена Инструмента/Связки (в пунктах)
poses_rubl	numeric(17,2)	Объем непрекращенных обязательств по Сделкам , учитываемых на разделах регистра учета позиций (в рублях РФ)
limit	numeric(16,5)	Лимит колебаний цен сделок, установленный по Основному Инструменту (в пунктах)
kof	numeric(10,6)	Коэффициент, используемый для определения Базового размера гарантийного обеспечения по Инструменту в зависимости от Базового размера гарантийного обеспечения, установленного по Основному Инструменту
risk_wr	numeric(16,5)	Величина, характеризующая дополнительный риск по опционным контрактам на продажу, базовым активом которых являются фьючерсные контракты с Кодом (обозначением), указанным в поле «contract» (в рублях РФ)
coffout	numeric(7,5)	Краевой коэффициент, установленный для опционных контрактов, базовым активом которых являются фьючерсные контракты с Кодом (обозначением), указанным в поле «contract»
base_fut	char(25)	Код базового актива фьючерсного контракта, являющегося базовым активом опционного контракта / код ценной бумаги
is_spread	numeric(1)	Признак вхождения Инструмента в группу (определенную Методикой установления и изменения лимитов колебаний цен сделок, являющейся Приложением №5 к Правилам клиринга): 1 – фьючерсный контракт входит в группу, 0 – фьючерсный контракт не входит в группу.
name	char(25)	Краткий код (обозначение) Инструмента / Связки
date2	date	Дата проведения Торгов
execution2	date	Дата исполнения Сделок / Связок
deposit	numeric(16,5)	Базовый размер гарантийного обеспечения по Инструменту (в рублях РФ)

is_percent	numeric(1)	Признак того, что цена фьючерсного контракта указывается в процентах 0 – указывается не в процентах, 1 – указывается в процентах
perc_rate	numeric(7,2)	Процентная ставка для расчета Вариационной маржи по фьючерсным контрактам, цена которых указывается в процентах.
settl_rur	numeric(16,5)	Расчетная цена Инструмента/Связки, определенная в ходе вечерней клиринговой сессии (в рублях РФ)
lot_volume	numeric(10)	Лот
tick_pr_go	numeric(16,5)	Стоимость шага цены Инструмента/Связки, установленная в Торговой системе используемая для расчета Гарантийного обеспечения (в рублях РФ)
limit_l1	numeric(16,5)	Не используется
pr_settl	numeric(16,5)	Расчетная цена Инструмента/Связки, определенная в ходе дневной клиринговой сессии (в пунктах)
pr_settl_r	numeric(16,5)	Расчетная цена Инструмента/Связки, определенная в ходе дневной клиринговой сессии (в рублях РФ)
type_exec	numeric(1)	Тип Сделки: Пусто – для Связки, 0 – для расчетного фьючерсного контракта, 2 – для поставочного фьючерсного контракта
section	char(50)	Наименование Секции срочного рынка
spot	char(50)	Не используется
base	char(50)	Не используется
type_sbor	char(50)	Способ расчета биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, указанных в полях «fee» и «ns_fee»: “RUR” – в рублях РФ за один фьючерсный контракт; “PERCENT” – в процентах от суммы Сделки
ns_volume	numeric(10)	Количество Инструментов в Сделках / Связок, заключенных на основании адресных Заявок (в штуках)
ns_trades	numeric(10)	Количество записей, внесенных в Реестр сделок при регистрации Сделок / Связок, заключенных на основании адресных Заявок
ns_fee	numeric(16,5)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за один фьючерсный контракт, заключенный на основании адресной Заявки (в рублях РФ) / тариф биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделки/Связки, заключенные на основании адресной Заявки (в процентах от суммы сделки)
ns_volrubl	numeric(16,5)	Объем обязательств по Сделкам / Связкам, заключенным на основании адресных Заявок (в рублях РФ)
l_tradeday	date	Дата последнего Торгового дня, в ходе которого может быть заключена Сделка / Связка с Кодом (обозначением), указанным в поле «contract»
multileg	numeric(1)	Признак:

		0 – для Инструментов 1 – для Связок
--	--	--

В полях interest, poses\_rubl, limit, kof, risk\_wr, coffout, is\_spread, is\_percent, perc\_rate, lot\_volume, limit\_11, deposit для Связок всегда – 0.

Поля base\_fut, type\_exec, для Связок всегда пусты.

## 5. Отчет об итогах Торгов опционными контрактами

Отчет предоставляется по итогам дневной клиринговой сессии и по итогам вечерней клиринговой сессии.

При предоставлении отчета по итогам дневной клиринговой сессии имя файла – **day07.csv**.

При предоставлении отчета по итогам вечерней клиринговой сессии имя файла – **o07.csv**.

Структура CSV-файлов:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения Торгов
contract	char(25)	Код (обозначение) опционного контракта
execution	char(10)	Дата окончания Срока действия опционного контракта (в формате строки символов «YYYY/MM/DD»)
volume	numeric(10)	Количество заключенных опционных контрактов (в штуках)
vol_rubl	numeric(16,2)	Объем обязательств по заключенным опционным контрактам (в рублях РФ)
low	numeric(16,5)	Минимальная цена опционных контрактов (в пунктах)
high	numeric(16,5)	Максимальная цена опционных контрактов (в пунктах)
open	numeric(16,5)	Цена открытия (в пунктах)
close	numeric(16,5)	Цена закрытия (в пунктах)
avrg	numeric(16,5)	Средневзвешенная цена заключенных опционных контрактов (в пунктах)
trades	numeric(10)	Количество записей, внесенных в Реестр сделок при регистрации заключенных опционных контрактов
interest	numeric(10)	Количество опционных контрактов, обязательства по которым не прекращены, учитываемых на разделах регистра учета позиций (в штуках)
fee	numeric(16,5)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за один опционный контракт (в рублях РФ)
tick_price	numeric(16,5)	Стоимость шага цены опционного контракта, установленная в Торговой системе (в рублях РФ)
tick	numeric(16,5)	Минимальный шаг цены опционного контракта, установленный в Торговой системе (в пунктах)
poses_rubl	numeric(17,2)	Объем непрекращенных обязательств по опционным контрактам, учитываемых на разделах регистра учета позиций (в рублях РФ)
depo_uncov	numeric(16,5)	Лимит колебаний цен сделок по опционному контракту (по непокрытой позиции) (в рублях РФ)
depo_cov	numeric(16,5)	Лимит колебаний цен сделок по опционному контракту и фьючерсному контракту, являющемуся

		базовым активом опционного контракта (по синтетической позиции) (в рублях РФ)
fut_contr	char(25)	Код (обозначение) фьючерсного контракта, являющегося базовым активом опционного контракта
strike	numeric(16,5)	Цена исполнения опционного контракта (страйк) (в пунктах)
put	char(1)	Тип опционного контракта: 'P' – PUT; 'C' – CALL
evrop	char(1)	Категория опционного контракта: 'E' – европейский; 'A' – американский
date2	date	Дата проведения Торгов
execution2	date	Дата окончания Срока действия опционного контракта (в формате date)
name	char(25)	Краткий код (обозначение) опционного контракта
close_time	char(8)	Время, до которого могут заключаться опционные контракты в дату окончания Срока действия опционного контракта
volat	numeric(16,5)	Волатильность опционного контракта, определенная в ходе вечерней клиринговой сессии
theorprice	numeric(16,5)	Теоретическая цена опционного контракта, определенная на момент начала вечерней клиринговой сессии (в пунктах)
tick_pr_go	numeric(16,5)	Стоимость шага цены опционного контракта для расчета Лимита колебаний цен сделок, установленная в Торговой системе, используемая для расчета Гарантийного обеспечения (в рублях РФ)
pr_volat	numeric(16,5)	Волатильность опционного контракта, определенная в ходе дневной клиринговой сессии
pr_theopr	numeric(16,5)	Теоретическая цена опционного контракта, определенная на момент начала дневной клиринговой сессии (в пунктах)
fut_type	char(1)	Признак маржируемости опционного контракта: 0 – немаржируемый опционный контракт; 1 – маржируемый опционный контракт
basegobuy	numeric(16,2)	Базовый размер Гарантийного обеспечения под покупку маржируемых опционных контрактов

## 6. Отчет об обязательствах по Сделкам

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Брокерской фирме, имя файла – **fposXXYY.csv**.

При формировании отчета по разделам регистра учета позиций, по которым установлен признак формирования отчетов, имя файла – **fposclXXYYZZZ.csv**.

Структура CSV-файлов:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	date	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
kod	char(7)	Код Расчетной фирмы / Брокерской фирмы / раздела

		регистра учета позиций
account	char(2)	Признак обязательств: 'RF' – суммарные обязательства, учитываемые на разделах регистра учета позиций, имеющих код Расчетной фирмы, указанный в поле «kod»; 'BF' – суммарные обязательства, учитываемые на разделах регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы, указанный в поле «kod»; 'CL' – обязательства, учитываемые на разделе регистра учета позиций, имеющем код, указанный в поле «kod».
isin	char(25)	Код (обозначение) Инструмента
pos_beg	numeric(11)	Количество Инструментов в заключенных Сделках, обязательства по которым не прекращены, учитываемых на разделах регистра учета позиций на начало отчетного дня (в штуках)
pos_end	numeric(11)	Количество Инструментов в заключенных Сделках, обязательства по которым не прекращены, учитываемых на разделах регистра учета позиций на конец отчетного дня (в штуках)
var_marg_p	numeric(16,2)	Вариационная маржа по Сделкам, обязательства по которым не прекращены на начало отчетного дня (в рублях РФ)
var_marg_d	numeric(16,2)	Вариационная маржа по Сделкам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)
sbor	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра по Сделкам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)
go_netto	numeric(16,2)	Не используется
go_brutto	numeric(16,2)	Гарантийное обеспечение, рассчитанное по брутто-принципу (в рублях РФ)
pos_exec	numeric(11)	Количество исполненных Инструментов (больше нуля – исполняется продажа; меньше нуля - покупка)
du	numeric(1)	Признак того, что раздел денежного регистра, код которого совпадает кодом раздела регистра учета позиций, предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении
sbor_exec	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за исполнение фьючерсных контрактов (в рублях РФ)
sbor_nosys	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделки, заключенные в течение отчетного дня на основании адресных Заявок (в рублях РФ)
fee_exec	numeric(16,2)	Пени за просрочку исполнения фьючерсных контрактов (в рублях РФ)
fine_exec	numeric(16,2)	Штраф за неисполнение фьючерсных контрактов (в рублях РФ)

accum_go	numeric(16,2)	Не используется
fee_trans	numeric(16,2)	Не используется
sbor_ex	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора по Сделкам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)
vat_ex	numeric(16,2)	Не используется
sbor_cc	numeric(16,2)	Сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра по Сделкам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)
vat_cc	numeric(16,2)	Не используется
pos_failed	numeric(11)	Количество позиций, по которым не исполнено обязательство в день исполнения

## 7. Отчет об обязательствах по опционным контрактам

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Брокерской фирме, имя файла – **oposXXYY.csv**.

При формировании отчета по разделам регистра учета позиций, по которым установлен признак формирования отчетов, имя файла – **oposclXXYYZZZ.csv**.

Структура CSV-файлов:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	date	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
kod	char(7)	Код Расчетной фирмы / Брокерской фирмы / раздела регистра учета позиций
account	char(2)	Признак обязательств: 'RF' – суммарные обязательства, учитываемые на разделах регистра учета позиций, имеющих код Расчетной фирмы, указанный в поле «kod»; 'BF' – суммарные обязательства, учитываемые на разделах регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы, указанный в поле «kod»; 'CL' – обязательства, учитываемые на разделе регистра учета позиций, имеющем код, указанный в поле «kod».
isin	char(25)	Код (обозначение) опционного контракта
pos_beg	numeric(11)	Количество опционных контрактов, обязательства по которым не прекращены, учитываемых на разделах регистра учета позиций на начало отчетного дня (в штуках)
pos_end	numeric(11)	Количество опционных контрактов, обязательства по которым не прекращены, учитываемых на разделах регистра учета позиций на конец отчетного дня (в штуках)
prem	numeric(16,2)	Сумма Премий по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)
sbor	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)
go	numeric(16,2)	Гарантийное обеспечение, рассчитанное по брутто-

		принципу (в рублях РФ)
pos_exec	numeric(11)	Количество исполненных опционных контрактов (больше нуля – опционных контрактов на продажу; меньше нуля – опционных контрактов на покупку)
pos_endcir	numeric(11)	Количество опционных контрактов, снятых с учета с раздела регистра учета позиций в следствие истечения Срока действия опционных контрактов, права по которым не востребованы Держателями (больше нуля – опционных контрактов на продажу; меньше нуля – опционных контрактов на покупку)
du	numeric(1)	Признак того, что раздел денежного регистра предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении
sbor_exec	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за исполнение опционных контрактов (в рублях РФ)
sbor_nosys	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за опционные контракты, заключенные в течение отчетного дня на основании адресных Заявок (в рублях РФ)
var_marg_p	numeric(16,2)	Вариационная маржа по опционным контрактам, обязательства по которым не прекращены на начало отчетного дня (в рублях РФ)
var_marg_d	numeric(16,2)	Вариационная маржа по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)
sbor_ex	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)
vat_ex	numeric(16,2)	Не используется
sbor_cc	numeric(16,2)	Сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)
vat_cc	numeric(16,2)	Не используется

## 8. Отчет о денежных средствах в рублях, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Средствами гарантийного обеспечения

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Расчетной фирме, имя файла – **monXX00.csv**.

При формировании отчета по Брокерской фирме, имя файла – **monXXYY.csv**.

При формировании отчета по разделам регистра учета позиций, по которым установлен признак формирования отчетов, имя файла – **monclXXYYZZZ.csv**.

Структура CSV-файлов:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	date	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
kod	char(12)	Код Расчетной фирмы / Брокерской фирмы / раздела денежного регистра (депо регистра обеспечения) /



		Расчетный код
account	char(2)	Признак Средств гарантийного обеспечения: 'RF' – суммарные средства Расчетной фирмы; 'BF' – суммарные средства Брокерской фирмы; 'CL' – средства, учитываемые на разделе денежного регистра (депо регистра обеспечения); 'RK' – средства, учитываемые на Расчетном коде
type	char(2)	Тип Средств гарантийного обеспечения: 'MN' – денежные средства в рублях РФ и/или иностранной валюте; 'PL' – ценные бумаги
amount_beg	numeric(16,2)	Сумма денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты/оценочная стоимость ценных бумаг на начало отчетного дня (в рублях РФ)
var_marg	numeric(16,2)	Сумма обязательств по перечислению Вариационной маржи (в рублях РФ)
prem	numeric(16,2)	Сумма обязательств по перечислению Премий по опционным контрактам (в рублях РФ)
pay	numeric(16,2)	Изменение суммы денежных средств в рублях РФ и/или оценочной стоимости иностранной валюты/оценочной стоимости ценных бумаг в течение дня (в рублях РФ) (рассчитывается как «amount_end» - «amount_beg»)
fut_sbor	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделки (в рублях РФ)
opt_sbor	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за опционные контракты (в рублях РФ)
go	numeric(16,2)	Сумма гарантийного обеспечения (в рублях РФ)
amount_end	numeric(16,2)	Сумма денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты/оценочная стоимость ценных бумаг на конец отчетного дня (в рублях РФ)
free	numeric(16,2)	Сумма свободных денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты /оценочная стоимость свободных ценных бумаг (в рублях РФ) (рассчитывается как «amount_end» – «go»)
du	numeric(1)	Признак того, что раздел денежного регистра (депо регистра обеспечения) предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении
gowide	numeric(16,2)	Не используется
freewide	numeric(16,2)	Не используется
margincall	char(1)	Не используется
sbor_ex	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора (в рублях РФ)

vat_ex	numeric(16,2)	Не используется
sbor_cc	numeric(16,2)	Сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра (в рублях РФ)
vat_cc	numeric(16,2)	Не используется
rub_beg	numeric(16,2)	Сумма денежных средств в рублях РФ на начало отчетного дня
rub_pay	numeric(16,2)	Изменение суммы денежных средств в рублях РФ в течение дня
rub_end	numeric(16,2)	Сумма денежных средств в рублях РФ на конец отчетного дня
com_pl_beg	numeric(16,2)	Оценочная стоимость иностранной валюты на начало отчетного дня (в рублях РФ)
com_pl_pay	numeric(16,2)	Изменение оценочной стоимости иностранной валюты в течение дня (в рублях РФ)
com_pl_end	numeric(16,2)	Оценочная стоимость иностранной валюты на конец отчетного дня (в рублях РФ)
ext_rez	numeric(20,2)	Сумма, блокируемая в вечерний клиринг у участников, имеющих позиции по контрактам на RUONIA (в рублях РФ). Резервируется под изменения ставки RUONIA (используется при расчете вариационной маржи по позициям), публикуемой Банком России

Оценочная стоимость ценных бумаг или иностранной валюты, указываемая в полях «amount\_beg» и «amount\_end», определяется в соответствии с Методикой выбора и оценки иностранных валют и ценных бумаг, принимаемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, утверждаемой Клиринговым центром.

В файле **monXX00.csv** отображаются:

- общая сумма соответствующего актива Средств гарантийного обеспечения (определяется по полю «type») по Расчетной фирме - в поле «amount\_end» в записи, в поле «account» которой указан признак 'RF';
- суммы соответствующего актива Средств гарантийного обеспечения (определяется по полю «type») по каждой Брокерской фирме - в поле «amount\_end» в записях, в поля «account» которых указан признак 'BF'.

Сумма денежных средств в рублях Российской Федерации, подлежащих возврату Доверенному владельцу счетов Обособленной Брокерской фирмы отражается в поле «amount\_end» записи, у которой в поле «kod» указан код основного раздела данной Обособленной Брокерской фирмы, в поле «account» указан признак 'BF', в поле «type» указан тип 'MN'.

Сумма денежных средств в рублях Российской Федерации, подлежащих возврату Участнику клиринга, которому присвоен код данной Расчетной фирмы, рассчитывается как общая сумма денежных средств в рублях Российской Федерации по Расчетной фирме за минусом сумм денежных средств в рублях Российской Федерации, подлежащих возврату Доверенным владельцам счетов Обособленных Брокерских фирм, зарегистрированных в рамках данной Расчетной фирмы.

**9. Предварительный отчет о денежных средствах в рублях РФ, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Средствами гарантийного обеспечения**

Отчет предоставляется по итогам дневной клиринговой сессии.

При формировании отчета по Расчетной фирме, имя файла – **daymonXX00.csv**.

При формировании отчета по Брокерской фирме, имя файла – **daymonXXYY.csv**.

Структура CSV-файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	date	Дата проведения клиринга
kod	char(12)	Код Расчетной фирмы / Брокерской фирмы / раздела денежного регистра (депо регистра обеспечения) / Расчетный код
account	char(2)	Признак Средств гарантийного обеспечения: 'RF' – суммарные средства Расчетной фирмы; 'BF' – суммарные средства Брокерской фирмы; 'CL' – средства, учитываемые на разделе денежного регистра (депо регистра обеспечения); 'RK' – средства, учитываемые на Расчетном коде
type	char(2)	Тип Средств гарантийного обеспечения: 'MN' –денежные средства в рублях РФ и/или иностранной валюте; 'PL' –ценные бумаги
amount_beg	numeric(16,2)	Сумма денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты/ оценочная стоимость ценных бумаг на начало отчетного дня (в рублях РФ)
var_marg	numeric(16,2)	Сумма обязательств по перечислению Вариационной маржи по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ)
prem	numeric(16,2)	Сумма обязательств по перечислению Премий по опционным контрактам по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ)
pay	numeric(16,2)	Изменение суммы денежных средств в рублях РФ и/или оценочной стоимости иностранной валюты/ оценочной стоимости ценных бумаг по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ)
fut_sbor	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделки по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ)
opt_sbor	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за опционные контракты по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ)
res_vm	numeric(16,2)	Значение отрицательной вариационной маржи по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ)
exp_vm	numeric(16,2)	Не используется
gol2	numeric(16,2)	Сумма гарантийного обеспечения по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ)
gowide	numeric(16,2)	Не используется
amountl2	numeric(16,2)	Сумма денежных средств в рублях РФ и/или

		оценочная стоимость иностранной валюты/ оценочная стоимость ценных бумаг по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ). Рассчитывается как $amount\_beg + var\_marg + prem + pay - fut\_sbor - opt\_sbor$
amountwide	numeric(16,2)	Не используется
freel2	numeric(16,2)	Сумма свободных денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты/ оценочная стоимость свободных ценных бумаг по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) (amountl2 - gol2)
freewide	numeric(16,2)	Не используется
margincall	char(1)	Не используется
du	numeric(1)	Признак того, что раздел денежного регистра (депо регистра обеспечения) предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении
rub_beg	numeric(16,2)	Сумма денежных средств в рублях РФ на начало отчетного дня
rub_pay	numeric(16,2)	Изменение суммы денежных средств в рублях РФ по итогам дневной клиринговой сессии
rubl2	numeric(16,2)	Сумма денежных средств в рублях РФ по итогам дневной клиринговой сессии
com_pl_beg	numeric(16,2)	Оценочная стоимость иностранной валюты на начало отчетного дня (в рублях РФ)
com_pl_pay	numeric(16,2)	Изменение оценочной стоимости иностранной валюты по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ)
com_pll2	numeric(16,2)	Оценочная стоимость иностранной валюты по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ)
ext_rez	numeric(20,2)	Сумма, блокируемая в вечерний клиринг у участников, имеющих позиции по контрактам на RUONIA (в рублях РФ). Резервируется под изменения ставки RUONIA (используется при расчете вариационной маржи по позициям), публикуемой Банком России

#### 10. Отчет об операциях по разделам денежного регистра и депо регистра обеспечения

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Брокерской фирме, имя файла – **payXX00.csv**.

При формировании отчета по разделам регистра учета позиций, по которым установлен признак формирования отчетов, имя файла – **payclXXYYZZZ.csv**.

Структура CSV файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
---------------	----------	---------------

date	char(10)	Дата проведения клиринга
kod	char(7)	Код раздела денежного регистра (депо регистра обеспечения)
account	char(2)	Признак раздела: Всегда 'CL'
type	char(2)	Тип средств: 'MN' – денежные средства; 'PL' – ценные бумаги
id_pay	numeric(10)	Идентификатор операции
type_pay	numeric(10)	Тип операции
pay	numeric(16,2)	Сумма операции (в рублях РФ) с учетом знаком: <0 – уменьшение значение раздела клирингового регистра, >0 – увеличение значения раздела клирингового регистра
name	char(75)	Наименование операции
comment	char(50)	Примечание
du	numeric(1)	Признак того, что раздел денежного регистра (депо регистра обеспечения) предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении
payer	char(200)	Наименование плательщика
inn	char(12)	ИНН плательщика
bik	char(9)	БИК банка плательщика
purpose	char(255)	Назначение платежа

Поля «payer», «inn», «bik», «purpose» заполняется только в случае увеличения значения, учитываемого на разделе денежного регистра, произведенного за счет зачисления денежных средств на счет Клирингового центра в НКО ЗАО НРД.

#### 11. Отчет об операциях с иностранной валютой и ценными бумагами, учитываемыми в качестве Средств гарантийного обеспечения

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **paycbXX00.csv**.

Структура CSV-файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения клиринга
kod	char(7)	Код раздела денежного регистра (депо регистра обеспечения)
account	char(2)	Признак раздела: Всегда 'CL'.
type	char(2)	Тип средств, являющихся Средствами гарантийного обеспечения, выраженные в рублях РФ: 'MN' – денежные средства в иностранной валюте; 'PL' – ценные бумаги
id_pay	numeric(10)	Идентификатор операции

type_pay	numeric(10)	Тип операции
asset	char(60)	Код иностранной валюты / ценной бумаги
pay	numeric(16,5)	Количество внесенного/ выведенного обеспечения в иностранной валюте/ ценных бумагах
rub_equ	numeric(16,2)	Оценочная стоимость единицы иностранной валюты или одной ценной бумаги (в рублях РФ)
purpose	char(255)	Назначение платежа

Примечание:

В случае внесения обеспечение поле «pay» принимает положительное значение, в случае вывода обеспечения – отрицательное.

Поле «purpose» заполняется в случае зачисления иностранной валюты на счет в НКО ЗАО НРД.

## 12. Отчет о разделах клиринговых регистров

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **clientsXX00.csv**.

Структура CSV-файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения клиринга
kod	char(7)	Код раздела регистра учета позиций
account	char(2)	Признак раздела: Всегда 'CL'
name	char(50)	Наименование раздела
id_code	char(50)	ИНН (код, заменяющий ИНН)
date_open	date	Дата открытия раздела
reports	numeric(1)	Признак формирования отчетов по разделу: 1 – отчеты формируются, 0 – отчеты не формируются
date_begin	date	Дата начала формирования отчетов по разделу
date_end	date	Дата окончания рассылки формирования отчетов по разделу
send_kod	char(7)	Код раздела денежного регистра для учета обязательств по оплате клиринговых услуг за формирование отчетов по разделу
code_adr	char(7)	Код раздела регистра учета позиций для заключения адресных сделок
du	numeric(1)	Признак того, что раздел денежного регистра (депо регистра обеспечения) предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении,
segr	numeric(1)	Признак Обособленной Брокерской фирмы 1 – является Обособленной Брокерской фирмой
isrepo	numeric(1)	Не используется
rk	char(12)	Расчетный код, соответствующий Брокерской фирме
rk_type	char(1)	Признак Расчетного кода:

		«S» – Собственный «L» – Клиентский «D» – ДУ
cross_trade	numeric(1)	Признак возможности заключения кросс-сделок: 1 – кросс-сделки разрешены
account_forts	char(30)	Номер Счета FORTS (торговый раздел типа «Блокировано для клиринга FORTS»)
margin_type	numeric(1)	Информация о действующих правилах расчета Гарантийного обеспечения по каждому Расчетному коду: 2 – Полунеттинг БФ 3 – Полунеттинг РК

### 13. Отчет о разделах клиринговых регистров, имеющих признак «Индивидуальный Инвестиционный Счет»

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.  
Имя файла – **persinvestXX00.csv**.

Структура CSV-файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения клиринга
kod	char(7)	Код раздела регистра учета позиций
account	char(2)	Признак раздела: Всегда 'CL'

### 14. Отчет о сборах за транзакции

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.  
Имя файла – **tranfeeXXYY.csv**.

Структура CSV-файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	date	Дата проведения клиринга
kod	char(7)	Код раздела клиринговых регистров Расчетной фирмы / Брокерской фирмы / клиента
account	char(2)	Признак обязательств: 'RF' – суммарные обязательства по Расчетной фирме; 'BF' – суммарные обязательства по Брокерской фирме; 'CL' – обязательства, учитываемые на разделе регистра учета позиций клиента
futopt	numeric(1)	Значение «0», поле не используется
mm	numeric(1)	Значение «0», поле не используется
addr	numeric(10)	Значение «0», поле не используется
fee	numeric(16,2)	Значение «0», поле не используется
sbortr	numeric(16,2)	Сумма сбора Технического центра за транзакции типа trantype, которая будет списана в следующий Расчетный день с раздела клиринговых регистров с признаком 'CL' (руб.)
vat_sbortr	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе сбора Технического центра за транзакции (в рублях РФ)*

trantype	Numeric(1)	Тип транзакции («0» - сбор за неэффективные транзакции, «1» - сбор за ошибочные транзакции)
----------	------------	---

Ключевые поля: «date», «kod», «account», «sbortr», «trantype».

За ошибочные транзакции сбор менее 1000 рублей не взимается, поле «sbortr» не заполняется.

## 15. Отчет о сборах за неэффективные транзакции

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **tranfeupdXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения клиринга
bf	char(4)	Код Брокерской фирмы
inn	char(50)	ИНН или код, его заменяющий
tranpoints	numeric(16,2)	Сумма баллов всех неэффективных транзакций, попавших в orders_log
feepoints	numeric(16,2)	Сумма биржевых сборов сделок, умноженных на присвоенные сделкам баллы
sbortr	numeric(16,2)	Сбор за неэффективные транзакции, попавших в orders_log

Примечание:

1. Включены пары (bf, inn), для которых значения полей «feepoints» и «tranpoints» не равны «0» одновременно.
2. Поле «tranpoints» заполняется в соответствии с [Параметрами для расчёта сборов за неэффективные и ошибочные транзакции](#).

## 16. Отчет детализированный о сборах за неэффективные транзакции

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **tranfeupddetailsXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения клиринга
inn	char(50)	ИНН или код, его заменяющий
kod	char(7)	Код раздела клиринговых регистров
mm	numeric(1)	Признак действия: 1 – совершено с раздела маркет-мейкера, 0 – иначе
futoptspot	numeric(1)	Признак действия: 0 – с фьючерсом 1 – с опционом
lowliquid	numeric(1)	Признак действия: 1 – с низколиквидным инструментом 0 – иначе
tran_count	numeric(1)	Количество транзакций с тремя



		признаками (mm, futoptspot, lowliquid)
fee_sum	numeric(16,2)	Биржевой сбор по сделкам с тремя признаками (mm, futoptspot, lowliquid)

Примечание:

1. Под действием понимается торговая транзакция или сделка, имеющая три признака в соответствии с инструментом, по которому произошло действие.
2. Включены комбинации (kod, mm, futoptspot, lowliquid), для которых значения полей «tran\_count» и «fee\_sum» не равны «0» одновременно.

**17. Отчет о сборах за неэффективные транзакции, подлежащих списанию**

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **tranfeeshareXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения клиринга
inn	char(50)	ИНН или код, его заменяющий
kod	char(7)	Код раздела клиринговых регистров
trannumber	numeric(10)	Количество транзакций, совершенных с данного раздела клиринговых регистров и попавших в orders_log
fee_share	numeric(16,2)	Доля сбора за транзакции, попавшие в orders_log, списываемая с данного раздела клиринговых регистров

**18. Отчет о сборах за ошибочные транзакции по каждому клиентскому логину, подлежащих списанию**

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии при условии, что сбор за транзакции составил более 1000 рублей.

Имя файла – **usersXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения клиринга
kod	char(7)	Код раздела клиринговых регистров РФ/БФ/клиента
account	char(2)	Признак РФ/БФ/клиента ('RF' - РФ; 'BF' - БФ; 'CL' - клиент)
login	char(50)	Наименование логина
maxmsg	numeric(10)	Пропускная способность логина на конец торговой сессии
sbor_err	numeric(16,2)	Сбор за ошибочные транзакции (руб.)

**19. Отчет о количестве ошибочных транзакций по каждому клиентскому логину**

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **tranerrXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения клиринга
moment	datetime	Время совершения ошибочной транзакции (гггг-мм-дд чч:мм:сс)
kod	char(7)	Код раздела клиринговых регистров РФ/БФ/клиента
account	char(2)	Признак РФ/БФ/клиента ('RF' - РФ; 'BF' - БФ; 'CL' - клиент)
login	char(50)	Наименование логина
tran_type	char(20)	Тип транзакции
err_code	numeric(10)	Код ошибки
err_cnt	numeric(10)	Количество транзакций данного типа с данной ошибкой

Примечание:

1. Включены комбинации (login, moment), по которым достигнут лимит.
2. Поля «tran\_type» и «err\_code» заполняются в соответствии с Параметрами для расчёта сборов за неэффективные и ошибочные транзакции.

**20. Отчет о сборах за ошибочные транзакции по каждому клиентскому логину**

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **tranerrfeeXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения клиринга
moment	datetime	Время совершения ошибочной транзакции (гггг-мм-дд чч:мм:сс)
kod	char(7)	Код раздела клиринговых регистров РФ/БФ/клиента
account	char(2)	Признак РФ/БФ/клиента ('RF' - РФ; 'BF' - БФ; 'CL' - клиент)
login	char(50)	Наименование логина
err_count	numeric(10)	Количество ошибочных транзакций
points	numeric(10)	Сумма баллов по ошибочным транзакциям
sbor_err	numeric(16,2)	Сбор за количество ошибочных транзакций, совершенное на момент времени «moment»

Примечание:

1. Включены комбинации (login, moment), по которым достигнут лимит.
2. Поле «points» заполняется в соответствии с Параметрами для расчёта сборов за неэффективные и ошибочные транзакции.

**21. Отчет о заключенных Связках**

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Брокерской фирме, имя файла – **multilegf04\_XXYY.csv**.

При формировании отчета по разделам регистра учета позиций, по которым установлен признак формирования отчетов, имя файла – **multilegf04clXXYYZZZ.csv**.

Структура CSV-файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
Id_deal	numeric(10)	Идентификационный номер Связки
isin	char(25)	Код (обозначение) Связки
Price1	numeric(16,5)	Цена заключения первой Сделки в Связке (в пунктах)
Price	numeric(16,5)	Цена заключения Связки (в пунктах).
vol	numeric(10)	Количество заключенных Связок (в штуках)
rate	numeric(16,2)	Для Связок с количеством Сделок равным 2 – ставка Связки (в процентах годовых)
days	numeric(4)	Для Связок с количеством Сделок равным 2 – срок Связки (в календарных днях)
kod_sell	char(7)	Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке по Связке, поданной Продавцом, на основании которой заключена Связка
kod_rts_sell	char(7)	Код участника торгов Продавца
kod_buy	char(7)	Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке по Связке, поданной Покупателем, на основании которой заключена Связка
kod_rts_buy	char(7)	Код участника торгов Покупателя
date	char(10)	Дата регистрации Связки
time	char(8)	Время регистрации Связки
type	numeric(1)	Признак: 2 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки 3 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании безадресной Заявки
signs	numeric(11)	Битовая маска признаков сделки
var_marg_b	numeric(16,2)	Не используется
var_marg_s	numeric(16,2)	Не используется
user_sell	char(20)	Имя (наименование) Продавца по Связке
user_buy	char(20)	Имя (наименование) Покупателя по Связке
no_buy	numeric(15)	Идентификационный номер Заявки по Связке, поданной Покупателем, на основании которой заключена Связка
no_sell	numeric(15)	Идентификационный номер Заявки по Связке, поданной Продавцом, на основании которой заключена Связка
fee_buy	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ)
fee_sell	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ)
date2	Date	Дата регистрации Связки
comm_buy	char(20)	Комментарий в Заявке по связке, поданной Покупателем
comm_sell	char(20)	Комментарий в Заявке по связке, поданной Продавцом
du_buy	numeric(1)	Признак того, что Связка заключена Покупателем за счет средств, находящихся в доверительном управлении:

		1 – за счет средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – не за счет средств, находящихся в доверительном управлении
du_sell	numeric(1)	Признак того, Связка заключена Продавцом за счет средств, находящихся в доверительном управлении: 1 – за счет средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – не за счет средств, находящихся в доверительном управлении
fee_ns_b	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Связку, заключенную на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ)
fee_ns_s	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Связку, заключенную на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ)
price_rur1	numeric(16,5)	Цена заключения первой Сделки в Связке (в рублях РФ)
price_rur	numeric(16,5)	Цена заключения Связки (в рублях РФ). Для Связок с количеством Сделок равным 2 – своп-цена
ext_id_b	numeric(11)	Дополнительный идентификационный номер, указанный в Заявке, поданной Покупателем
ext_id_s	numeric(11)	Дополнительный идентификационный номер, указанный в Заявке, поданной Продавцом
date_clr	Date	Дата проведения клиринга
fee_ex_b	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Покупателем (в рублях РФ)
vat_ex_b	numeric(16,2)	Не используется
fee_cc_b	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Покупателем (в рублях РФ)
vat_cc_b	numeric(16,2)	Не используется
fee_ex_s	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Продавцом (в рублях РФ)
vat_ex_s	numeric(16,2)	Не используется
fee_cc_s	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Продавцом (в рублях РФ)
vat_cc_s	numeric(16,2)	Не используется
id_trade	numeric(10)	Идентификационный номер первой Сделки в Связке
price_rur2	numeric(16,5)	Не используется

Под своп-ценой понимается разница между ценой первой Сделки в Связке и ценой второй Сделки в Связке (возможно отрицательная).

## 22. Информация о Сделках, составляющих Связку

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.  
Имя файла – **multileg\_dict.csv**.

Структура CSV-файлов:

Название	Тип поля	Описание поля
----------	----------	---------------

ПОЛЯ		
date	date	Дата Торгового дня, в ходе которого возможно заключение сделок с данной Связкой
isin	char(25)	Код (обозначение) Связки
Num_legs	numeric(10)	Количество Сделок в Связке
isin_leg	char(25)	Код (обозначение) Инструмента, входящего в Связку
Vol	numeric(10)	Количество Инструментов, входящих в Связку (в штуках)

Отчет раскрывает информацию о Сделках, составляющих данную Связку.

Количество полей «isin\_leg» и «Vol» соответствует количеству сделок в Связке.

Поле «Vol» может принимать как положительное значение (в случае покупки), так и отрицательное (в случае продажи).

### 23. Отчет об иностранной валюте и ценных бумагах, предоставленных в качестве Средств гарантийного обеспечения

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **moncbXXYY.csv**.

Структура CSV-файлов:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	date	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
kod	char(7)	Код раздела денежного регистра (депо регистра обеспечения)
account	char(2)	Признак учета иностранной валюты / ценных бумаг: 'RF' – иностранная валюта / ценные бумаги, учитываемые на всех разделах денежного регистра / депо регистра обеспечения Расчетной фирмы; 'BF' – иностранная валюта / ценные бумаги, учитываемые на всех разделах денежного регистра / депо регистра обеспечения Брокерской фирмы; 'CL' – иностранная валюта / ценные бумаги, учитываемое на разделе денежного регистра / депо регистра обеспечения
type	char(60)	Код иностранной валюты / ценной бумаги
amount_beg	numeric(10)	Количество ценных бумаг / иностранной валюты на начало отчетного дня
amt_beg_cb	numeric(16,2)	Стоимость иностранной валюты на начало отчетного дня (в рублях РФ) по курсу ЦБ РФ на предыдущий отчетный день. Для ценных бумаг равно 0.
pay	numeric(16,2)	Изменение количества ценных бумаг или суммы иностранной валюты в течение дня (рассчитывается как «amount_end» - «amount_beg»)
pay_rub	numeric(16,2)	Изменение стоимости иностранной валюты в течение дня (в рублях РФ) (рассчитывается как «amount_end_rub» - «amount_beg_rub»). Для ценных бумаг равно 0
amount_end	numeric(10)	Количество ценных бумаг / иностранной валюты на конец отчетного дня
amt_end_cb	numeric(16,2)	Стоимость иностранной валюты на конец отчетного дня (в рублях РФ) по курсу ЦБ РФ на отчетный день. Для

		ценных бумаг равно 0
rate_cb	numeric(16,5)	Курс ЦБ РФ иностранной валюты на отчетный день. Для ценных бумаг равно 0
rate	numeric(16,2)	Оценочная стоимость единицы иностранной валюты или одной ценной бумаги (в рублях РФ)
go	numeric(16,2)	Оценочная стоимость иностранной валюты и ценных бумаг в рублях РФ (рассчитывается как «amount_end» * «rate»)
com_ensure	numeric(1)	Тип Средств обеспечения: 1 – денежные средства в иностранной валюте; 0 – ценные бумаги

Оценочная стоимость ценных бумаг или иностранной валюты, указываемая в полях «rate» и «go», определяется в соответствии с Методикой выбора и оценки иностранных валют и ценных бумаг, принимаемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, утверждаемой Клиринговым центром.

#### 24. Отчет о позициях по инструментам

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.  
Имя файла – **riskposXXYY.csv**.

Структура CSV-файлов:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения клиринга
kod	char(7)	Код раздела клиринговых регистров РФ/БФ/клиента
account	char(2)	Признак РФ/БФ/клиента ('RF' - РФ; 'BF' - БФ; 'CL' - клиент)
isin	char(25)	Уникальный код инструмента
type	char(1)	Тип инструмента ('R' – Поручение на управление риском, 'F' – фьючерсный контракт, 'O' – опционный контракт)
pos_beg	numeric(11)	Количество инструмента на начало дня
pos_end	numeric(11)	Количество инструмента на конец дня
go_brutto	numeric(16,2)	Гарантийное обеспечение, рассчитанное по брутто-принципу (в рублях РФ)
fee_risk	numeric(16,2)	Сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра по Поручениям на управление риском (в рублях РФ)
sbor	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за исключением Поручений на управление риском (в рублях РФ)

Примечание:

Ключевые поля: «date», «kod», «account», «isin».

#### 25. Отчет о соответствии Брокерской фирмы Расчетному коду валютного рынка

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.  
Имя файла – **tofxXXYY.csv**.

Структура CSV-файлов:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения клиринга
kod_bf	char(7)	Код Брокерской фирмы
kod_tks	char(12)	Расчетный код валютного рынка

## 26. Отчет о соответствии Торгово-клирингового счета Брокерской фирме/ разделу регистра учета позиций

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **toeqXXYY.csv**.

Структура CSV-файлов:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения клиринга
kod	char(7)	Код Брокерской фирмы/ раздела регистра учета позиций
account	char(2)	Тип Брокерской фирмы/ раздела регистра учета позиций
kod_tks	char(12)	Код Торгово-клирингового счета
kod_client	char(12)	Краткий код клиента на фондовом рынке
fav_tks_own	char(12)	Торгово-клиринговый счет, соответствующий Собственным Брокерским фирмам
fav_tks_client	char(12)	Торгово-клиринговый счет, соответствующий Клиентским Брокерским фирмам
fav_tks_du	char(12)	Торгово-клиринговый счет, соответствующий Брокерским фирмам ДУ
broker_ref	char(20)	Примечание к сделке поставки

## 27. Сводная финансовая ведомость

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – F14\_XX00.xls.

Структура XLS файла:

Банк НКЦ (АО)  
Сводная финансовая ведомость за

по Расчетной фирме N\_\_

(наименование Расчетной фирмы)

Наименование регистра	Баланс на начало дня		Оборот за день		Баланс на конец дня	
	Дебет	Кредит	Дебет	Кредит	Дебет	Кредит
<b>ДЕНЕЖНЫЙ РЕГИСТР ОБЕСПЕЧЕНИЯ в российских рублях и в иностранной валюте</b>						
<b>Собственные разделы</b>						
Движение по разделам в российских рублях						
Движение по разделам в иностранной валюте						
Вариационная маржа						
Премия по опционам						
Бирж. сбор						
в т.ч. НДС*						
Комиссионное вознаграждение КЦ						
в т.ч. НДС*						
Итого в российских рублях						
Итого в иностранной валюте						
<b>ИТОГО по собств. разделам</b>						
<b>Суммарно клиентские разделы</b>						
Движение по разделам в российских рублях						
Движение по разделам в иностранной валюте						
Вариационная маржа						
Премия по опционам						



Бирж. сбор в т.ч. НДС*						
Комиссионное вознаграждение КЦ в т.ч. НДС*						
Итого в российских рублях						
Итого в иностранной валюте						
<b>ИТОГО по клиентским разделам</b>						
Суммарно разделы ДУ						
Движение по разделам в российских рублях						
Движение по разделам в иностранной валюте						
Вариационная маржа						
Премия по опционам						
Бирж. сбор в т.ч. НДС*						
Комиссионное вознаграждение КЦ в т.ч. НДС*						
Итого в российских рублях						
Итого в иностранной валюте						
<b>ИТОГО по разделам ДУ</b>						
<b>ИТОГО по ДЕНЕЖНОМУ РЕГИСТРУ ОБЕСПЕЧЕНИЯ в российских рублях и в иностранной валюте</b>						
<b>ДЕПО РЕГИСТР ОБЕСПЕЧЕНИЯ</b>						
Собственные разделы						
Движение по разделам						
<b>ИТОГО по собств. разделам</b>						
Суммарно клиентские разделы						
Движение по разделам						
<b>ИТОГО по суммарным клиентским регистрам</b>						
Суммарно разделы ДУ						
Движение по разделам						
<b>ИТОГО по разделам ДУ</b>						
<b>ИТОГО по ДЕПО РЕГИСТРУ ОБЕСПЕЧЕНИЯ</b>						

Биржевой сбор  
в т.ч. НДС\*  
Комиссионное вознаграждение КЦ  
в т.ч. НДС\*

Итого по денежному регистру обеспечения

Итого по депо регистру обеспечения:

в российских рублях и в иностранной валюте:  
 на конец дня: в российских рублях  
 в иностранной валюте  
 Гарантийное обеспечение в российских рублях  
 и в иностранной валюте  
 сумма свободных средств в российских рублях  
 и в иностранной валюте

на конец дня  
 Гарантийное обеспечение  
 сумма свободных средств

Аналитика "Движение по счету"

Код разде ла	Дебет	Кредит	Основание	Примечание		

Для депо регистра обеспечения и денежного регистра в иностранной валюте в полях «Баланс на начало дня» и «Баланс на конец дня» указывается оценочная стоимость ценных бумаг или иностранной валюты, определяемая в соответствии с Методикой выбора и оценки иностранных валют и ценных бумаг, принимаемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, утверждаемой Клиринговым центром.

**28. Отчет об обязательствах по поставочным фьючерсным контрактам на облигации**

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **DELINFO\_OFZ\_XX00.xls**.

Структура XLS файла:

В Расчетную фирму \_\_\_\_\_  
Код РФ

\_\_\_\_\_  
Наименование РФ

Уведомление о приближении срока исполнения поставочных фьючерсных контрактов на ценные бумаги с поставкой через ММВБ

Расчетная фирма: *Участник*

*дата*

Дата начала периода исполнения	Код инструмента	Номер раздела регистра учета позиций	Количество открытых позиций		Идентификатор Участника торгов	Исполнение
			покупка	продажа		

\* – В отчетах информация о сумме НДС является справочной

Всего прошито, пронумеровано и скреплено  
печатью 35 ( тридцать пять ) лист 05

И. о. Председателя Правления Банка  
«Национальный Клиринговый Центр»  
(Акционерное общество)

  
Демушкина Е.С.  
(подпись)

