

УТВЕРЖДЕНЫ

решением Правления
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»
от «30» мая 2014 года (Протокол № 62)

Председатель Правления
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»





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

Москва, 2014г.

СОДЕРЖАНИЕ

| | | |
|---------|---|----|
| I. | Общие положения..... | 4 |
| II. | Отчет о заключенных Сделках..... | 6 |
| III. | Отчет о заключенных опционных контрактах..... | 8 |
| IV. | Отчет об итогах Торгов Инструментами и Связками..... | 11 |
| V. | Отчет об итогах Торгов опционными контрактами..... | 14 |
| VI. | Отчет об обязательствах по Сделкам..... | 15 |
| VII. | Отчет об обязательствах по опционным контрактам..... | 17 |
| VIII. | Отчет о денежных средствах в рублях, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Средствами обеспечения..... | 18 |
| IX. | Предварительный отчет о денежных средствах в рублях, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Средствами гарантийного обеспечения..... | 21 |
| X. | Отчет об операциях по разделам денежного регистра и депо регистра обеспечения..... | 23 |
| XI. | Отчет об операциях с иностранной валютой и ценными бумагами, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения..... | 25 |
| XII. | Отчет о торговых счетах, закрепленных за разделом регистра учета позиций..... | 25 |
| XIII. | Отчет о разделах регистра учета позиций..... | 26 |
| XIV. | Отчет о сборах за транзакции..... | 27 |
| XV. | Отчет о сборах за неэффективные транзакции..... | 27 |
| XVI. | Отчет детализированный о сборах за неэффективные транзакции..... | 28 |
| XVII. | Отчет о сборах за неэффективные транзакции, подлежащих списанию..... | 28 |
| XVIII. | Отчет о сборах за ошибочные транзакции по каждому клиентскому логину, подлежащих списанию..... | 29 |
| XIX. | Отчет о количестве ошибочных транзакций по каждому клиентскому логину..... | 29 |
| XX. | Отчет о сборах за ошибочные транзакции по каждому клиентскому логину..... | 30 |
| XXI. | Отчет о заключенных Связках..... | 30 |
| XXII. | Информация о Сделках составляющих Связку..... | 33 |
| XXIII. | Отчет об иностранной валюте и ценных бумагах, предоставленных в качестве Средств гарантийного обеспечения..... | 33 |
| XXIV. | Отчет о позициях по инструментам..... | 34 |
| XXV. | Отчет о соответствии Брокерской фирмы Расчетному коду валютного рынка..... | 35 |
| XXVI. | Отчет о соответствии Торгово-клирингового счета Брокерской фирме/ разделу регистра учета позиций..... | 35 |
| XXVII. | Сводная финансовая ведомость..... | 36 |
| XXVIII. | Отчёт об обязательствах по Сделкам Т+ в разрезе торговых счетов..... | 39 |
| XXIX. | Отчет об обязательствах по поставочным фьючерсным контрактам на облигации федерального займа..... | 40 |

Форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга, которым присвоен код Расчетной фирмы, в соответствии с Правилами клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на срочном рынке

I. Общие положения

1. Настоящий документ «Форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга, которым присвоен код Расчетной фирмы, 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 II – XXVI предоставляются в виде файлов формата CSV. В имени файлов XX означает код Расчетной фирмы, XXYY – код Брокерской фирмы, XXYYZZZ – 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 |

В целях настоящего Приложения:

Инструментом именуется предмет и условия сделок, определяемые кодом инструмента:

Сделками в отношении Инструмента именуются сделки, заключенные в отношении предмета сделки и на условиях, определяемых кодом инструмента, а именно:

- Срочный контракт с определенным кодом;
- Сделка T+ с определенной ценной бумагой с определенным сроком исполнения обязательств;
- Поручение на управление риском.

Под торгами Инструментом понимаются заключение соответствующих сделок в Торговой системе.

Сделками купли-продажи именуется сделки купли-продажи ценных бумаг, являющиеся Сделками T+ (Сделки купли-продажи T+);

Сделками репо T+ именуется сделки репо, являющиеся Сделками T+;

Сделки репо, заключенные при наличии Необеспеченной позиции Участника клиринга или Клирингового центра по Сделкам T+, и Сделки репо T+ вместе именуется Сделки репо.

Сделкой именуется:

- Срочный контракт;
- Сделка купли-продажи.
- Сделки купли-продажи ценных бумаг, заключенные при наличии Необеспеченной позиции Участника клиринга или Клирингового центра по Сделкам T+;
- часть Сделки репо.

Связкой именуется несколько Срочных контрактов и/или Сделок купли-продажи, заключенных на основании одной заявки, или Сделка репо.

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, Сделок купли-продажи и Сделок репо.

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 на Срочном рынке ОАО Московская Биржа.

II. 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, 3 – для фьючерсных контрактов или Сделки купли-продажи T+, обязательства по которым возникли в ходе проведения процедуры принудительного закрытия позиций, 4 – для первой части сделки репо, заключенной при наличии Необеспеченной позиции Участника клиринга, или Клирингового центра по Сделкам T+, 5 – для второй части сделки репо, заключенной при наличии Необеспеченной позиции Участника клиринга или Клирингового центра по Сделкам T+, 7 – для сделки купли-продажи, заключенной в соответствии с Правилами клиринга при наличии Необеспеченной позиции Участника клиринга или Клирингового центра по Сделкам T+, 8 – для сделки исполнения поставочного фьючерсного контракта (Сделка T+), 9 – для первой части Сделки репо T+, 10 - для второй части Сделки репо T+. |

| | | |
|------------|---------------|--|
| | | 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 / Гарантийного перевода по Сделке (в рублях РФ) |
| var_marg_s | numeric(16,2) | Обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи по фьючерсным контрактам / Гарантийного перевода по Сделке (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) | Идентификационный номер второй части Сделки репо для первой части Сделки репо или номер первой части Сделки репо для второй части Сделки репо |
| fee_ex_b | numeric(16,2) | Биржевой сбор, подлежащий уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| vat_ex_b | numeric(16,2) | Сумма НДС в составе биржевого сбора, подлежащего уплате Покупателем (в рублях РФ)* |
| fee_cc_b | numeric(16,2) | Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| vat_cc_b | numeric(16,2) | Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащего уплате Покупателем (в рублях РФ)* |
| fee_ex_s | numeric(16,2) | Биржевой сбор, подлежащий уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| vat_ex_s | numeric(16,2) | Сумма НДС в составе биржевого сбора, подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ)* |
| fee_cc_s | numeric(16,2) | Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| vat_cc_s | numeric(16,2) | Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ)* |
| 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) | Не используется |

Для Сделок, входящих в Связку, поля fee_buy, fee_sell, fee_ex_b, vat_ex_b, fee_cc_b, vat_cc_b, fee_ex_s, vat_ex_s, fee_cc_s, vat_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.

III. 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, 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, в следствии 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) | Сумма НДС в составе биржевого сбора, подлежащего уплате Покупателем (в рублях РФ)* |
| fee_cc_b | numeric(16,2) | Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| vat_cc_b | numeric(16,2) | Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащего уплате Покупателем (в рублях РФ)* |
| fee_ex_s | numeric(16,2) | Биржевой сбор, подлежащий уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| vat_ex_s | numeric(16,2) | Сумма НДС в составе биржевого сбора, подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ)* |
| fee_cc_s | numeric(16,2) | Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| vat_cc_s | numeric(16,2) | Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ)* |
| signs | numeric(11) | Не используется |

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.

IV. 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 в Положении о порядке установления и изменения лимитов колебаний цен сделок и принудительного закрытия Позиций, являющемся Приложением Ф5 к Правилам клиринга): 1 – фьючерсный контракт / ценная бумага входит в группу, 0 – фьючерсный контракт / ценная бумага 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_11 | numeric(16,5) | Не используется |
| pr_settl | numeric(16,5) | Расчетная цена Инструмента/Связки, определенная в |

Форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга, которым присвоен код Расчетной фирмы, в соответствии с Правилами клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на срочном рынке

| | | |
|------------|---------------|--|
| | | 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 и Сделки T+ |
| section | char(50) | Наименование Секции срочного рынка |
| spot | char(50) | “SPOT” – для ценных бумаг, в иных случаях – пустое поле. |
| base | char(50) | Код ценной бумаги для итогов Торгов ценными бумагами, в иных случаях – пустое поле |
| 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 |

Код ценной бумаги, указываемый в поле «contract», включает в себя дату исполнения Сделки T+, заключенной с указанием данного кода ценной бумаги.

Код ценной бумаги, указываемый в полях «base_fut», «base», соответствует коду ценной бумаги присвоенному Организатором торговли.

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, spot, base для Связок всегда пусты.

V. 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 - **dayo07.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 |

VI. 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, или Гарантийный перевод по Сделкам, обязательства по которым не прекращены на начало отчетного дня (в рублях РФ) |
| var_marg_d | numeric(16,2) | Вариационная маржа, или Гарантийный перевод 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) | Сумма всех перечисленных Гарантийных переводов по Сделкам T+, обязательства по которым не |

| | | |
|------------|---------------|--|
| | | прекращены, с учетом знака (в рублях РФ) |
| fee_trans | numeric(16,2) | Штраф за наличие Необеспеченной позиции по Сделкам Т+ (в рублях РФ) |
| sbor_ex | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора по Сделкам , заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ) |
| vat_ex | numeric(16,2) | Сумма НДС в составе биржевого сбора (в рублях РФ)* |
| 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) | Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра (в рублях РФ)* |
| pos_failed | numeric(11) | Количество позиций, по которым не исполнено обязательство в день исполнения |

VII. 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) | Сумма НДС в составе биржевого сбора (в рублях РФ)* |
| 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) | Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра (в рублях РФ)* |

VIII. Отчет о денежных средствах в рублях, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Средствами 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(7) | Код Расчетной фирмы / Брокерской фирмы / раздела денежного регистра (депо регистра обеспечения) / Расчетный код |
| account | char(2) | Признак Средств 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 обеспечения: 'MN' – денежные средства в рублях РФ и/или долларах США; 'PL' – ценные бумаги и/или иностранная валюта, за исключением долларов США |
| amount_beg | numeric(16,2) | Сумма денежных средств в рублях РФ и/или долларах США/оценочная стоимость ценных бумаг и/или иностранной валюты, за исключением долларов США, на начало отчетного дня (в рублях РФ) |
| var_marg | numeric(16,2) | Сумма обязательств по перечислению Вариационной маржи и Гарантийных переводов (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 долларах США/оценочной стоимости ценных бумаг и/или иностранной валюты, за исключением долларов США, 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 долларах США/оценочная стоимость ценных бумаг и/или иностранной валюты, за исключением долларов США, на конец отчетного дня (в рублях РФ) |
| free | numeric(16,2) | Сумма свободных денежных средств в рублях РФ и/или долларах США /оценочная стоимость свободных ценных бумаг и/или свободной иностранной валюты, за исключением долларов США, (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) | Сумма НДС в составе биржевого сбора (в рублях РФ)* |
| sbor_cc | numeric(16,2) | Сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра (в рублях РФ) |
| vat_cc | numeric(16,2) | Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра (в рублях РФ)* |
| 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 долларов США на начало отчетного дня (в рублях РФ) |
| com_pl_pay | numeric(16,2) | Изменение оценочной стоимости долларов США в течение дня (в рублях РФ) |
| com_pl_end | numeric(16,2) | Оценочная стоимость долларов США 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 иностранной валюты и ценных бумаг, принимаемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, утверждаемой Клиринговым центром.

В файле monXX00.csv отображаются:

- общая сумма соответствующего актива Средств 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 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.

IX. Предварительный отчет о денежных средствах в рублях, 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**.

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

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|--|
| date | date | Дата проведения клиринга |
| kod | char(7) | 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 долларах США; 'PL' –ценные бумаги и/или иностранная валюта, выраженные в рублях РФ, за исключением долларов США |
| amount_beg | numeric(16,2) | Сумма денежных средств в рублях РФ и/или долларах США/ оценочная стоимость ценных бумаг и/или иностранной валюты, за исключением долларов США, на начало отчетного дня (в рублях РФ) |
| var_marg | numeric(16,2) | Сумма обязательств по перечислению Вариационной маржи и Гарантийных переводов 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 долларах США/ оценочной стоимости ценных бумаг и/или иностранной валюты, за исключением долларов США, 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) | Не используется |
| 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 долларах США/ оценочная стоимость ценных бумаг и/или иностранной валюты, за исключением долларов США, 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 долларах США/ оценочная стоимость свободных ценных бумаг и/или свободной иностранной валюты, за исключением долларов США, 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 долларов США на начало отчетного дня (в рублях РФ) |
| com_pl_pay | numeric(16,2) | Изменение оценочной стоимости долларов США по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) |
| com_pll2 | numeric(16,2) | Оценочная стоимость долларов США 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 |

Х. 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 / иностранная валюта, являющиеся Средствами гарантийного обеспечения, выраженные в рублях РФ |
| 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 |

Форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга, которым присвоен код Расчетной фирмы, в соответствии с Правилами клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на срочном рынке

| | | |
|---------|-----------|--------------------------|
| 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.

XI. Отчет об операциях с иностранной валютой и ценными бумагами, учитываемых 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 обеспечения поле «pay» принимает положительное значение, в случае вывода обеспечения - отрицательное.

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

XII. Отчет о торговых счетах, закрепленных за разделом регистра учета позиций

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – delinfoXX00.csv.

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|------------|---|
| date | date | Дата проведения клиринга |
| kod | char(7) | Код раздела регистра учета позиций |
| account | char(2) | Признак раздела: Всегда 'CL' |
| code_rdep | char(10) | Код Расчетного депозитария |
| depo_acc | char(32) | Номер торгового счета депо |
| code_rorg | char(10) | Код Расчетной организации |
| money_acc | char(20) | Номер денежного торгового счета |
| check | numeric(1) | Возможность проведения расчетов по торговым счетам / Поставочным счетам: 0 - проведение расчетов невозможно; |

| | | |
|-----------|----------|--|
| | | 1 - проведение расчетов возможно. |
| id | char(25) | Идентификатор Участника торгов на ЗАО «ФБ ММВБ» для поставки по контрактам на ОФЗ. В случае если на поставку выходит клиент, то через точку с запятой указывается краткий код клиента Участника торгов на ЗАО «ФБ ММВБ». |
| shortname | char(12) | Краткое наименование Участника торгов на ЗАО «ФБ ММВБ» для поставки по контрактам на ОФЗ |

ХIII. Отчет о разделах регистра учета позиций

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(30) | 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 |
| spot | numeric(1) | Возможность заключения Сделок Т+: 0 – заключение Сделок Т+ не возможно, 1 – заключение Сделок Т+ возможно |
| 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 |
| segr | numeric(1) | Признак Обособленной Брокерской фирмы 0 – не является Обособленной Брокерской фирмой 1 – является Обособленной Брокерской фирмой |
| isrepo | numeric(1) | Признак возможности заключения Сделки репо при наличии Необеспеченной позиции по Сделкам Т+ |

Форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга, которым присвоен код Расчетной фирмы, в соответствии с Правилами клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на срочном рынке

| | | |
|---------|---------|--|
| | | 0 – заключение сделки репо не возможно, 1 – заключение Сделки репо возможно |
| rk | char(5) | Расчетный код, соответствующий Брокерской фирме |
| rk_type | char(1) | Признак Расчетного кода: «L» - Собственный «S» - Клиентский «D» - ДУ «B» - Расчетный код соответствует Брокерской фирме неопределенного типа |

XIV. 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.

XV. Отчет о сборах за неэффективные транзакции

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **tranfeeupdXXYY.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](#).

XVI. 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 2 – со Сделкой T+ |
| 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.

XVII. Отчет о сборах за неэффективные транзакции, подлежащих списанию

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **tranfeeshareXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

Форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга, которым присвоен код Расчетной фирмы, в соответствии с Правилами клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на срочном рынке

| 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 |

XVIII. 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.) |

XIX. 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 |

Форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга, которым присвоен код Расчетной фирмы, в соответствии с Правилами клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на срочном рынке

| | | |
|---------|-------------|---|
| 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.

XX. 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.

XXI. 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: 0 – для Сделки репо, заключенной на основании безадресной Заявки, 1 – для Сделки репо, заключенной на основании адресной Заявки, 2 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки (кроме Сделок репо) 3 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании безадресной Заявки (кроме Сделок репо) |
| signs | numeric(11) | не используется |
| var_marg_b | numeric(16,2) | Обязательства Покупателя по уплате Гарантийного перевода по Связке (в рублях РФ) |
| var_marg_s | numeric(16,2) | Обязательства Продавца по уплате Гарантийного перевода по Связке (в рублях РФ) |
| 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) | Сумма НДС в составе биржевого сбора, подлежащего уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| fee_cc_b | numeric(16,2) | Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| vat_cc_b | numeric(16,2) | Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащего уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| fee_ex_s | numeric(16,2) | Биржевой сбор, подлежащий уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| vat_ex_s | numeric(16,2) | Сумма НДС в составе биржевого сбора, подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| fee_cc_s | numeric(16,2) | Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| vat_cc_s | numeric(16,2) | Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| id_trade | numeric(10) | Идентификационный номер первой Сделки в Связке |
| price_rur2 | numeric(16,5) | Сумма второй части Сделки репо T+ |

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

Для Связок, не являющихся Сделками репо, поле price_rur2 всегда пустое.

XXII. Информация о Сделках составляющих Связку

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **multileg_dict.csv**.

Структура CSV-файлов:

| Название поля | Тип поля | Описание 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).

XXIII. 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 или 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 долларах США; 0 – ценные бумаги и/или иностранная валюта, за исключением долларов США |

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

XXIV. 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, 'S' – Сделка T+) |
| 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) |

Форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга, которым присвоен код Расчетной фирмы, в соответствии с Правилами клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на срочном рынке

| | | |
|------|---------------|---|
| | | 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».

XXV. 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 |

XXVI. 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 |

XXVII. Сводная финансовая ведомость

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – F14XX00.xls.

Структура XLS файла:

ЗАО АКБ "Национальный Клиринговый Центр"
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 |
| ДЕНЕЖНЫЙ РЕГИСТР ОБЕСПЕЧЕНИЯ в российских рублях и в иностранной валюте | | | | | | |
| Собственные разделы | | | | | | |
| Движение по разделам в российских рублях | | | | | | |
| Движение по разделам в иностранной валюте | | | | | | |
| Вариационная маржа | | | | | | |
| Гарантийный перевод | | | | | | |
| Премия по опционам | | | | | | |
| Бирж. сбор | | | | | | |
| в т.ч. НДС* | | | | | | |
| Комиссионное вознаграждение КЦ | | | | | | |
| в т.ч. НДС* | | | | | | |
| Итого в российских рублях | | | | | | |
| Итого в иностранной валюте | | | | | | |
| ИТОГО по собств. разделам | | | | | | |
| Суммарно клиентские разделы | | | | | | |
| Движение по разделам в российских рублях | | | | | | |
| Движение по разделам в иностранной валюте | | | | | | |
| Вариационная маржа | | | | | | |

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

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

в т.ч. НДС*

**Итого по денежному 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
сумма вноса в Гарантийный фонд
сумма к внесению (задолженность)
сумма к внесению по разделам ДУ
в том числе задолженность перед Гарантийным
фондом
в том числе задолженность перед ФОО
в том числе задолженность перед РФ
в том числе задолженность перед СФПУ**

Итого по депо регистру обеспечения:

**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 иностранной валюты и ценных бумаг, принимаемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, утверждаемой Клиринговым центром.

XXVIII. Отчёт об обязательствах по Сделкам Т+ в разрезе торговых счетов

Отчет предоставляется в 16:05.

Имя файла – **DXX00.xls**.

Структура XLS файла:

| Отчёт о количестве активов, требуемых для поставки по сделкам Т+ | | | | Дата |
|--|--|-------|--------------------------------|----------------------------------|
| по участнику <i>Участник</i> | | | | |
| Торговый счёт для поставки | Цена ценной бумаги для расчета обязательства по поставке | Актив | Нетто-требования (к получению) | Нетто-обязательства (к поставке) |
| | | | | |

XXIX. Отчет об обязательствах по поставочным фьючерсным контрактам на облигации федерального займа

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