

УТВЕРЖДЕНЫ

Решением Председателя Правления
НКО НКЦ (АО)

01-01/50
Приказ № от 10 мая 2018 года

Председатель Правления
НКО НКЦ (АО)



А.С. Хавин

М.П.

**ФОРМЫ И ФОРМАТЫ ДОКУМЕНТОВ И ОТЧЕТОВ
НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ И РЫНКЕ ДРАГОЦЕННЫХ МЕТАЛЛОВ.
ЧАСТЬ III.**

г. Москва
2018 г.

СОДЕРЖАНИЕ

1. Общие положения.....	3
2. Формы (форматы) документов, предоставляемых Участниками клиринга в бумажном виде или в виде документа ЭДО	4
2.1. Заявление о клиринговых идентификаторах на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ..	4
2.2. Запрос на открытие Торгово-клирингового счета 2-го уровня	7
2.3. Постоянное поручение на возврат обеспечения	8
2.4. Заявление о порядке предоставления информации о комиссионных вознаграждениях	9
3. Формы (форматы) документов, предоставляемых Участниками торгов в бумажном виде или в виде документа ЭДО	10
3.1. Запрос на открытие Торгово-клирингового счета 3-го уровня.....	10
3.2. Заявление о порядке предоставления информации о комиссионных вознаграждениях	11
4. Форматы электронных документов, предоставляемых Участниками клиринга и Клиринговым центром.....	12
4.1. Запрос на проведение ранних расчетов	13
4.2. Постоянное поручение на проведение ранних расчетов	13
4.3. Запрос на отмену Постоянного поручения на проведение ранних расчетов	13
4.4. Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром	13
4.5. Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром	13
4.6. Запрос об отмене Постоянного поручения на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром	14
5. Формы и форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга и Участникам торгов Клиринговым центром	15
5.1. Клиринговый отчет (ССХ03, ССХ3А)	16
5.2. Отчет об Итоговых нетто-обязательствах/Итоговых нетто-требованиях (ССХ04, ССХ4А, ССХ4Р)	19
5.3. Отчет о комиссионных вознаграждениях (ССХ10)	21
5.4. Отчет о Маржинальном требовании (ССХ11).....	24
5.5. Отчет о сделках, Дата исполнения которых перенесена (ССХ14)	26
5.6. Отчет о Поручениях на управление риском (ССХ15)	29
5.7. Отчет об обязательствах по ПФИ (ССХ17).....	32
5.8. Отчет о расчетных ценах (ССХ18).....	35
5.9. Отчет о Клиринговых идентификаторах (ССХ19).....	37
5.10. Отчет о Торгово-клиринговых счетах (ССХ20).....	39
5.11. Отчет о Торгово-клиринговых счетах (2-го уровня / 3-го уровня) (ССХ20А)	41
5.12. Отчет о требованиях/ обязательствах (ССХ37).....	44
5.13. Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (ССХ43)	47
5.14. Отчет о переданных профилях активов на валютном рынке (ССХ49)	50
5.15. Требование о погашении Задолженности (ССХ69)	53
5.16. Отчет об оценке Обеспечения (ССХ84).....	55
5.17. Отчет об Обеспечении (ССХ89).....	57
5.18. Отчет об Итоговых нетто-обязательствах, которые будут прекращены (ССХ91).....	61

1. Общие положения

- 1.1. Настоящий документ «Формы и форматы документов и отчетов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов. Часть III» (далее – Формы и форматы документов и отчетов на валютном рынке) совместно с «Формами и форматами документов и отчетов. Часть I. Общая часть» описывают формы и форматы документов и отчетов, предоставляемых Участниками клиринга, клиентами Участников клиринга и иными лицами на валютном рынке и рынке драгоценных металлов в адрес НКО НКЦ (АО) (далее – Клиринговый центр), а также Клиринговым центром в адрес указанных лиц в соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) утвержденными уполномоченным органом Клирингового центра и зарегистрированными Банком России, с учетом требований законодательства Российской Федерации.

2. Формы (форматы) документов, предоставляемых Участниками клиринга в бумажном виде или в виде документа ЭДО

2.1. Заявление о клиринговых идентификаторах на валютном рынке и рынке драгоценных металлов

В ПАО Московская Биржа
В НКО НКЦ (АО)

**ЗАЯВЛЕНИЕ О КЛИРИНГОВЫХ ИДЕНТИФИКАТОРАХ
на валютном рынке и рынке драгоценных металлов**

Участник клиринга	Указывается полное наименование организации – Участника клиринга
Идентификатор	Указывается идентификатор Участника клиринга

Просим (необходимо выбрать **ОДИН** из вариантов А или В, или С):

А. <input type="checkbox"/> присвоить новый(е) клиринговый(ые) идентификатор(ы) в количестве _____ Присваивается один или несколько новых идентификаторов ОДНОГО типа с ОДИНАКОВЫМИ полномочиями на выбранном рынке. Заполняются « Полномочия клиринговых идентификаторов » и Приложение №1 «Информация о подключении»	
В. <input type="checkbox"/> изменить полномочия по клиринговому идентификатору(ам) ³ Изменяются полномочия по одному или нескольким идентификаторам на выбранном рынке, для нескольких идентификаторов устанавливаются ОДИНАКОВЫЕ полномочия. Заполняется « Полномочия клиринговых идентификаторов » и/или Приложение №1 «Информация о подключении»	С. <input type="checkbox"/> аннулировать клиринговые идентификатор(ы) Не заполняются « Полномочия клиринговых идентификаторов » и Приложение №1 «Информация о подключении»
Клиринговый(е) идентификатор(ы) (необходимо указать идентификатор(ы) на выбранном рынке, которому(ым) необходимо изменить полномочия или аннулировать)	
...	

Полномочия клиринговых идентификаторов

1. Клиринговые полномочия <i>Обязательно для заполнения</i>	<input type="checkbox"/> клиринговый менеджер ⁽¹⁾	<input type="checkbox"/> оператор ⁽²⁾	<input type="checkbox"/> оператор+переводы ⁽³⁾
2. Ограничение по ТКС <i>По умолчанию доступны все ТКС</i>	<input type="checkbox"/> использовать со всеми ТКС ⁽⁴⁾ <input type="checkbox"/> использовать только со следующими ТКС: <input type="checkbox"/> удалить следующие ТКС из перечня используемых: <input type="checkbox"/> добавить к используемым следующие ТКС: ...		
3. Объединение в группу <i>Идентификаторам, включенным в группу, доступна информация об операциях пользователей, включенных в группу</i>	Наименование группы		
	<input type="checkbox"/> объединить	<input type="checkbox"/> аннулировать объединение	
4. Получение информации <i>По умолчанию, при отсутствии ограничения по ТКС, транслируется вся информация</i>	о комиссии	<input type="checkbox"/> разрешить	<input type="checkbox"/> запретить
5. Язык интерфейса <i>По умолчанию - русский</i>	<input type="checkbox"/> русский	<input type="checkbox"/> английский	

(Должность Руководителя Участника торгов)

подпись

(Фамилия И.О.)

«___» _____ 20__ г.
М.П.

или лица, действующего по доверенности)

- (1) полномочия на установку с использованием Клиринговой системы ограничений по ТКС по допуску к клирингу с частичным обеспечением по денежным средствам/ драгоценным металлам, а также полномочия «оператор+переводы» (идентификатор при этом не может быть ограничен по ТКС. При ограничении по ТКС полномочия автоматически изменяются на «оператор+переводы»)
- (2) полномочия на просмотр позиций и обязательств/требований по денежным средствам/драгоценным металлам
- (3) полномочия на осуществление переводов денежных средств/драгоценных металлов между Расчетными кодами/ТКС в Клиринговой системе (перевод осуществляется между Расчетными кодами 1-го и 2-го уровня или Расчетными кодами 2-го и 3-го уровня).
- (4) в случае снятия ранее установленного ограничения для идентификатора по ТКС

Приложение №1
к Заявлению о клиринговых идентификаторах
на валютном рынке и рынке драгоценных металлов

Информация о подключении

через терминал

Способ подключения	Тип терминала	<input type="checkbox"/> MICEX Trade Currency <input type="checkbox"/> MICEX Currency Analytic <input type="checkbox"/> Универсальное рабочее место СМА
<input type="checkbox"/> Интернет Указывается Криптоимя ⁽¹⁾ с областью действия «Электронный документооборот валютного рынка».. Данный тип подключения невозможен для рабочего места СМА		
<input type="checkbox"/> Выделенный канал Указывается IP адрес DMZ сегмента закрытой корпоративной сети, с которого обеспечивается возможность подключения всех ID с аналогичным типом подключения		
<input type="checkbox"/> Colocation Указывается IP адрес в Дата-центре Технического Центра, с которого обеспечивается возможность подключения указанных в заявлении ID		
<input type="checkbox"/> Интернет до шлюза Указывается IP адрес шлюза DMZ сегмента закрытой корпоративной сети, через который организуется подключение всех ID с аналогичным типом подключения		

через ВПТС на валютном рынке и рынке драгоценных металлов

Серверное приложение для подключения ВПТС к ПТК Биржи	<input type="checkbox"/> MICEX Bridge TEAP <input type="checkbox"/> DFServer	<input type="checkbox"/> MFIX Transactional <input type="checkbox"/> Hosted ASTSBridge (Выделенный канал, POP)	<input type="checkbox"/> Hosted ASTSBridge (Интернет) <input type="checkbox"/> WEB2L
Фактический адрес установки серверного приложения			
IP адрес машины, на которой установлено серверное приложение			
IP адрес клиентского приложения			
Название ВПТС для подключения к Hosted ASTSBridge на POP могут быть использованы только терминалы MICEX Trade			
Название компании разработчика ВПТС			
Криптоимя ⁽¹⁾			

_____ «____» _____ 20__ г.
(Должность Руководителя Участника торгов подпись (Фамилия И.О.) М.П.
или лица, действующего по доверенности)

⁽¹⁾ используемый формат:
Криптоимя на физическое лицо: INN=____, OGRN=____, SNILS=____, T=____, CN=____, OU=____, O=____, L=____, ST=____,
C=____
или
Криптоимя на юридическое лицо: INN=____, OGRN=____, CN=____, O=____, L=____, ST=____, C=____

2.2. Запрос на открытие Торгового-клирингового счета 2-го уровня

(На бланке организации)

В НКО НКЦ (АО)

ЗАПРОС НА ОТКРЫТИЕ ТОРГОВО-КЛИРИНГОВОГО СЧЕТА 2-ГО УРОВНЯ

(полное наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга: _____,

В соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) просим зарегистрировать нашей Организации Торгово-клиринговый счет 2-го уровня, в состав которого будет входить Расчетный код 2-го уровня, связанный с Расчетным кодом Участника клиринга _____ для:

- клиента Участника клиринга;

Идентификационные данные клиента*	
-----------------------------------	--

- Участника торгов для заключения сделок от имени Участника клиринга;
- Участника торгов, в заявках на заключение сделок которого Участник клиринга будет указан в качестве Клирингового брокера.

Регистрационный код (идентификатор) Участника торгов	Наименование Участника торгов

(Должность руководителя) _____ / Ф.И.О. /

М.П.

«__» _____ 20__ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

* Поле «Идентификационные данные клиента» не является обязательным и заполняется в соответствии с требованиями, предъявляемыми Биржей при регистрации клиентов Участников торгов. В случае регистрации клиента, являющегося клиентом брокера, указываются идентификационные данные как конечного клиента, так и клиента, являющегося брокером.

2.3. Постоянное поручение на возврат обеспечения

(На бланке организации)

В НКО НКЦ (АО)

ПОСТОЯННОЕ ПОРУЧЕНИЕ НА ВОЗВРАТ ОБЕСПЕЧЕНИЯ
(с Расчетного кода 2-го уровня / Расчетного кода 3-го уровня)

(полное наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга: _____,

В соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) просим на постоянной основе осуществлять возврат денежных средств / драгоценных металлов с Расчетного кода 2-го уровня / Расчетного кода 3-го уровня:

(указать Расчетный код(-ы) 2-го/ 3-го уровня или фразу «для всех Расчетных кодов 2-го/ 3-го уровня»)

соответствующего Расчетному коду Участника клиринга: _____.
(указать Расчетный код)

- возврат денежных средств во всех валютах / возврат всех драгоценных металлов;
- возврат денежных средств в указанных валютах / возврат указанных драгоценных металлов _____

(указать необходимые валюты / драгоценные металлы)

В следующем размере:

- в размере Итогового нетто-требования без учета комиссионного вознаграждения;
- в размере Итогового нетто-требования;
- в размере всей доступной суммы денежных средств / всего доступного количества драгоценного металла

путем перечисления на соответствующий(ие) счет(а), зарегистрированный(е) нашей Организацией в качестве Счета(ов) для возврата.

Настоящее поручение действительно до его письменной отмены.

(Должность руководителя)

_____/ Ф.И.О. /
М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

2.4. Заявление о порядке предоставления информации о комиссионных вознаграждениях

(На бланке организации)

В НКО НКЦ (АО)

**ЗАЯВЛЕНИЕ О ПОРЯДКЕ ПРЕДОСТАВЛЕНИЯ ИНФОРМАЦИИ О
КОМИССИОННЫХ ВОЗНАГРАЖДЕНИЯХ**

(полное наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга: _____,

В соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) просим не предоставлять Участникам торгов информацию об оборотных частях комиссионных вознаграждений по Сделкам, заключенным с указанием следующих Торгово-клиринговых счетов 2-го уровня: _____

(Должность руководителя) _____ / *Ф.И.О.* /

М.П.

«__» _____ 20__ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

3. Формы (форматы) документов, предоставляемых Участниками торгов в бумажном виде или в виде документа ЭДО

3.1. Запрос на открытие Торгово-клирингового счета 3-го уровня

(На бланке организации)

В НКО НКЦ (АО)

ЗАПРОС НА ОТКРЫТИЕ ТОРГОВО-КЛИРИНГОВОГО СЧЕТА 3-ГО УРОВНЯ

_____,
(полное наименование Участника торгов)

Идентификатор Участника торгов: _____

В соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) просим открыть Торгово-клиринговый счет 3-го уровня, в состав которого будет входить Расчетный код 3-го уровня, связанный с Расчетным кодом 2-го уровня _____ для следующего клиента:

Идентификационные данные клиента *	
------------------------------------	--

(Должность руководителя) _____ / Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20__ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

* Поле «Идентификационные данные клиента» не является обязательным и заполняется в соответствии с требованиями, предъявляемыми Биржей при регистрации клиентов Участников торгов. В случае регистрации клиента, являющегося клиентом брокера, указываются идентификационные данные как конечного клиента, так и клиента, являющегося брокером.

3.2. Заявление о порядке предоставления информации о комиссионных вознаграждениях

(На бланке организации)

В НКО НКЦ (АО)

**ЗАЯВЛЕНИЕ О ПОРЯДКЕ ПРЕДОСТАВЛЕНИЯ ИНФОРМАЦИИ О
КОМИССИОННЫХ ВОЗНАГРАЖДЕНИЯХ**

_____.
(полное наименование Участника торгов)

Идентификатор Участника торгов: _____,

В соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) просим не предоставлять клиентам нашей Организации информацию об оборотных частях комиссионных вознаграждений по Сделкам, заключенным с указанием следующих Торгово-клиринговых счетов 3-го уровня:

_____ / *Ф.И.О.* /
(Должность руководителя)

М.П.

«___» _____ 20__ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

4. Форматы электронных документов, предоставляемых Участниками клиринга и Клиринговым центром

При описании форматов электронных документов используются следующие символы:

A B C D E F G H I J K L M N O P Q R S T U V W X Y Z А Б В Г Д Е Ж З И К Л М Н О П Р
С Т У Ф Х Ц Ч Ш Щ Ъ Ы Ь Э Ю Я

0 1 2 3 4 5 6 7 8 9

/ — ? : () . , ‘ + а также: Space

Условные обозначения

!	Указывает на обязательное количество символов, содержащихся в строке
[]	Необязательная последовательность символов
a	Допускается использование любых букв из вышеприведенного списка
n	Допускается использование любых цифр из вышеприведенного списка
x	Допускается использование любых символов из вышеприведенного списка
c	Допускается использование любых букв из вышеприведенного списка и цифр
d	Обозначение суммы денежных средств. Десятичная часть должна быть отделена символом «,».
g	Допускается использование любых букв из вышеприведенного списка, цифр и символа <_>
Tab	Символ табуляции
12!c	Идентификатор Участника клиринга
O	Обязательное поле
H	Необязательное поле
GO	Обязательное поле в составе группы
GH	Необязательное поле в составе группы

4.1. Запрос на проведение ранних расчетов

Формат документа ECLRRQ

О/Н	Передаваемая информация	Используемые служебные слова	Формат / Значение
О	Заголовок документа		2!n.2!n.2!nTab12cTab12!cTabECLRRQ
О	Расчетный код	UVR_CODE	5!n
О	Дата действия	DATE	2!n.2!n.2!n

4.2. Постоянное поручение на проведение ранних расчетов

Формат документа ECLRORD

О/Н	Передаваемая информация	Используемые служебные слова	Формат / Значение
О	Заголовок файла		2!n.2!n.2!nTab12cTab12!cTabECLRORD
О	Расчетный код	UVR_CODE	5!n
О	Дата начала действия поручения	BEGIN_DATE	2!n.2!n.2!n
О	Время начала расчетов	SETTLETIME	2!n:2!n 11:00 15:15 18:00

4.3. Запрос на отмену Постоянного поручения на проведение ранних расчетов

Формат документа ECLRORDDEL

О/Н	Передаваемая информация	Используемые служебные слова	Формат / Значение
О	Заголовок документа		2!n.2!n.2!nTab12cTab12!cTabECLRORDDEL
О	Расчетный код	UVR_CODE	5!n
О	Дата окончания действия поручения	END_DATE	2!n.2!n.2!n

4.4. Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром

Формат документа EFINRQ

О/Н	Передаваемая информация	Используемые служебные слова	Формат / Значение
О	Заголовок документа		2!n.2!n.2!nTab12cTab12!cTabEFINRQ
О	Расчетный код	UVR_CODE	5!n
О	Дата действия	DATE	2!n.2!n.2!n
О	Время завершения торгов	FIN_DATE	2!n:2!n, время в формате ЧЧ:ММ Может принимать следующие значения: 18:00, 19:00

4.5. Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром

Формат документа EFINORD

О/Н	Передаваемая информация	Используемые служебные слова	Формат / Значение
О	Заголовок документа		2!n.2!n.2!n Tab 12 cTab 12! cTab EFINORD
О	Расчетный код	UVR_CODE	5!n
О	Дата начала действия поручения	BEGIN_DATE	2!n.2!n.2!n
О	Время завершения торгов	FIN_DATE	2!n:2!n, время в формате ЧЧ:ММ Может принимать следующие значения: 18:00, 19:00

4.6. Запрос об отмене Постоянного поручения на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром

Формат документа EFINORDDEL

О/Н	Передаваемая информация	Используемые служебные слова	Формат / Значение
О	Заголовок документа		2!n.2!n.2!n Tab 12 cTab 12! cTab EFINORDDEL
О	Расчетный код	UVR_CODE	5!n
О	Дата окончания действия поручения	END_DATE	2!n.2!n.2!n

5. Формы и форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга и Участникам торгов Клиринговым центром

Отчетные документы формируются в Клиринговой системе в соответствии с Правилами клиринга и направляются Участникам клиринга в форме электронных документов категории «В».

Данные электронные документы являются документами, сформированными в соответствии с требованиями языка XML версии 1.0.

Структура имен XML-файла с отчетным документом имеет вид: FFFFFFFF_TTTTT_SSS_DDMMYY_NNNNNNNNN.RRR, где:

- FFFFFFFF – первые 7 символов идентификатора организации – адресата (либо MM00001 для электронных документов, предназначенных для всех организаций, например, для биржевой информации);
- TTTTT – тип электронного документа, включая 2 символа идентификатора рынка (например «EQM06» для Выписки из реестра сделок, принятых на клиринг, или «EQM6C» для Выписки из реестра сделок, принятых на клиринг (по сделкам клиентов) и т.д.);
- SSS – идентификатор сессии: «00Т»;
- DDMMYY – дата, за которую подготовлен отчетный документ;
- NNNNNNNNN – уникальный номер электронного документа в Подсистеме ЭДО НКЦ;
- RRR = xml.p7s.zip.p7e - сложное расширение файла, состоящее из цепочки расширений, означающее последовательность действий по расшифровке (p7e), разархивированию (zip) и снятию цифровой подписи (p7s), необходимых для получения исходного XML-файла.

Полная спецификация языка XML версии 1.0 приводится в документе Extensible Markup Language (XML) 1.0 (Second Edition), разработанном W3C и опубликованном в сети Интернет по адресу <http://www.w3.org/TR/REC-xml>.

Каждый электронный документ содержит заголовок в виде текстовых строк и содержательную часть, представляющую собой строки с данными.

Каждая строка с данными представляет собой последовательность полей, разделенных символом табуляции (шестнадцатеричный код 09). Строки должны заканчиваться сочетанием символов «возврат каретки - перевод строки» (шестнадцатеричные коды 0D,0A).

Отчетный документ в формате XML может быть преобразован в любой удобный получателю формат (в том числе, формат TXT с разделителями) путем обработки собственными программными средствами бэк-офиса и/или стандартными программными средствами (MS Excel).

Отчетный документ в формате XML может быть преобразован в печатную форму путем открытия в Microsoft Internet Explorer.

-

5.1. Клиринговый отчет (CCX03, CCX3A)

Структура XML-файла:

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Нет	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES						
CCX03		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата, за которую сформирован отчет	Да	Date		
	ClearingFirmId	Идентификатор Участника клиринга	Да	Character	0-12	
	ClearingFirmName	Наименование Участника клиринга	Да	Character	0-120	
	ClearingFirmNameEN	Наименование Участника клиринга (английское)	Нет	Character	0-120	
SETTLE		Блок информации по расчетному коду				
	ExtSettleCode	Расчетный код Участника клиринга	Да	Character	20	
	ExtSettleCodeUnifiedPool	Признак Расчетного кода Единого пула («Y» - да, «N» - нет)	Нет	Character	1	
CURRPAIR		Блок данных валютной пары				
	CurrencyId	Идентификатор валюты лота /драгоценного металла	Да	Character	4	
	CurrencyName	Наименование валюты лота /драгоценного металла	Да	Character	30	
	CurrencyNameEN	Наименование валюты лота /драгоценного металла (английское)	Да	Character	30	
	CoCurrencyId	Идентификатор сопряженной валюты	Да	Character	4	
	CoCurrencyName	Наименование сопряженной валюты	Да	Character	30	
	CoCurrencyNameEN	Наименование сопряженной валюты (английское)	Нет	Character	30	
RECORDS		Блок данных по сделке				
	TradeNo	Номер сделки	Да	Number	20	0

	SecurityId	Идентификатор инструмента	Да	Character	12	
	SecShortName	Краткое наименование инструмента	Да	Character	10	
	TradeGroup	Вид сделки: Т - обычная сделка, S - сделка своп, В - сделка бивалютной корзины F – сделка фикс	Да	Character	1	
	BuySell	Направление сделки В – Покупка S – Продажа	Да	Character	1-01	
	TradeDate	Дата заключения сделки	Да	Date		
	TradeTime	Время заключения сделки	Да	Time		
	TradeType	Тип сделки	Да	Character	1	
	Decimals	Число значимых знаков после запятой в курсе сделки (атрибут Price)	Да	Number		
	Quantity	Объем в валюте лота (в единицах валюты / в граммах)	Да	Number	20	2
	Value	Объем в сопряженной валюте	Да	Number	20	2
	Price	Курс	Да	Number	20	6
	TrdAccId	Код Торгово-клирингового счета	Да	Character	0-12	
	ClientCode	Краткий код клиента	Нет	Character	12	
	Details	ИНН или № паспорта клиента	Нет	Character	20	
	SubDetails	ИНН или № паспорта клиента субброкера	Нет	Character	20	
	TradeNoSrc	Номер исходной сделки. Поле заполняется для сделок SWAP с перенесенной датой исполнения второй части.	Нет	Number	20	0
	/RECORDS					
	/CURRPAIR					
	/SETTLE					
	/CCX03					
	/MICEX_DOC					

5.2. Отчет об Итоговых нетто-обязательствах/Итоговых нетто-требованиях (ССХ04, ССХ4А, ССХ4Р)

Структура XML-файла:

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Нет	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES						
ССХ04		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата, за которую сформирован отчет	Да	Date		
	ClearingFirmId	Идентификатор Участника клиринга	Да	Character	0-12	
	ClearingFirmName	Наименование Участника клиринга	Да	Character	0-120	
	ClearingFirmNameEN	Наименование Участника клиринга (английское)	Нет	Character	0-120	
SETTLE		Блок информации по расчетному коду				
	ExtSettleCode	Расчетный код Участника клиринга	Да	Character	20	
	ExtSettleCodeUnifiedPool	Признак Расчетного кода Единого пула («Y» - да, «N» - нет)	Нет	Character	1	
CURRENCY		Блок информации по валюте				
	NccRealAccount	Номер Счета обеспечения	Нет	Character	0-25	
	CurrencyId	Идентификатор валюты /драгоценного металла	Да	Character	4	
RECORDS		Блок данных по обязательствам				
	DataType	Тип обязательств: FX_OBLIG – по сделкам с наступившей датой исполнения; FX_VM – по уплате вариационной маржи FX_DEBT – по уплате Задолженности	Нет	Character	1-20	
	Debit	Итоговое обязательство	Да	Number	20	2

	Credit	Итоговое требование	Да	Number	20	2
/RECORDS						
/CURRENCY						
/SETTLE						
/CCX04						
/MICEX_DOC						

Пример отчета ССХ04, ССХ4А, ССХ4Р:

Дата и Время формирования отчета <Дата> <Время>
НКО НКЦ (АО)

ОТЧЕТ ОБ ИТОГОВЫХ НЕТТО-ОБЯЗАТЕЛЬСТВАХ / ИТОГОВЫХ НЕТТО-ТРЕБОВАНИЯХ

Дата, за которую сформирован отчет: <Дата>
Идентификатор Участника клиринга:
Наименование Участника клиринга:

<Расчетный код N>

<Код валюты/ драгоценного металла>

Тип обязательства	Обязательство	Требование
Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование		

Расчеты осуществляются в сроки, установленные Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество).

5.3. Отчет о комиссионных вознаграждениях (CCX10)

Структура XML-файла:

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Нет	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES						
CCX10		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата, за которую сформирован отчет	Да	Date		
	ClearingFirmId	Идентификатор Участника клиринга	Да	Character	0-12	
	ClearingFirmName	Наименование Участника клиринга	Да	Character	0-120	
	ClearingFirmNameEN	Наименование Участника клиринга (английское)	Нет	Character	0-120	
SETTLE1		Блок информации по Расчетному коду 1-го уровня				
	ExtSettleCode	Расчетный код Участника клиринга	Да	Character	20	
	NccRealAccount	Номер Счета обеспечения	Нет	Character	0-25	
	ExtSettleCodeUnifiedPool	Признак Расчетного кода Единого пула («Y» - да, «N» - нет)	Нет	Character	1	
TYPE		Блок данных по получателям комиссии	Да			
	ComType	«1» - Комиссионное вознаграждение за организацию торгов, «2» - Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, «3» - Вознаграждение за предоставление ИТС	Да	Character	1	
RECORDS		Блок данных по комиссии по Расчетному коду 1-го уровня				
	CommisType	Вид комиссии	Да	Number		0
	CommisName	Описание комиссии	Да	Character	255	

	CommisNameEN	Описание комиссии (английское)	Нет	Character	255	
	DateFrom	Дата начала периода, за который начислена комиссия	Да	Date		
	DateTo	Дата окончания периода, за который начислена комиссия	Да	Date		
	Comm	Сумма комиссионного вознаграждения, руб.	Да	Number	20	2
	ITSVAT	в т.ч. НДС	Нет	Number	20	2
SETTLE2		Блок информации по Расчетному коду 2-го уровня				
	ExtSettleCode	Расчетный код 2-го уровня	Да	Character	20	
	Comm	Сумма комиссионного вознаграждения, руб.	Да	Number	20	2
/SETTLE2						
/RECORDS						
/TYPE						
/SETTLE1						
/CCX10						
/MICEX_DOC						

Пример отчета ССХ10:

Дата и Время формирования отчета <Дата> <Время>
НКО НКЦ (АО)

ОТЧЕТ О КОМИССИОННЫХ ВОЗНАГРАЖДЕНИЯХ

Дата, за которую сформирован отчет: <Дата>
Идентификатор Участника клиринга:
Наименование Участника клиринга:

<Расчетный код N>

Комиссионное вознаграждение за организацию торгов

Вид комиссионного вознаграждения	Описание	Дата начала периода начисления	Дата окончания периода начисления	Сумма, руб.

Комиссионное вознаграждение Клирингового центра

Вид комиссионного вознаграждения	Описание	Дата начала периода начисления	Дата окончания периода начисления	Сумма, руб.

Вознаграждение за предоставление ИТС

Вид комиссионного вознаграждения	Описание	Дата начала периода начисления	Дата окончания периода начисления	Сумма, руб.	в т.ч. НДС*

* НДС начисляется для Участников клиринга, не являющихся Участниками торгов, на сумму фиксированной ставки за предоставление ИТС

5.4. Отчет о Маржинальном требовании (CCX11)

Структура XML-файла:

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Нет	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES						
CCX11		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата, за которую сформирован отчет	Да	Date		
	MaxMarginDate	Максимальная дата исполнения Маржинального требования	Да	Date		
	ClearingFirmId	Идентификатор Участника торгов	Да	Character	0-12	
	ClearingFirmName	Наименование Участника клиринга	Да	Character	0-120	
	ClearingFirmNameEN	Наименование Участника клиринга (английское)	Нет	Character	0-120	
SETTLE		Блок информации по расчетному коду				
	ExtSettleCode	Расчетный код Участника клиринга	Да	Character	20	
	MarginSum	Сумма Маржинального требования, руб.	Да	Number	20	2
/SETTLE						
/CCX11						
/MICEX_DOC						

Пример отчета ССХ11:

Дата и Время формирования отчета <Дата> <Время>
НКО НКЦ (АО)

ОТЧЕТ О МАРЖИНАЛЬНОМ ТРЕБОВАНИИ

Дата, за которую сформирован отчет: <Дата>

Идентификатор Участника клиринга:

Наименование Участника клиринга:

Маржинальное требование должно быть исполнено в срок до: 17:30 мск. <Дата>

Расчетный код	Сумма Маржинального требования, руб.

Исполнение Маржинального требования Участником клиринга осуществляется в соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество).

5.5. Отчет о сделках, Дата исполнения которых перенесена (CCX14)

Структура XML-файла:

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Нет	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES						
CCX14		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата, за которую сформирован отчет	Да	Date		
	ReportType	Назначение отчета: CLEARING - для Участника клиринга, TRADE - для Участника торгов	Да	Character		
	FirmId	Идентификатор Участника клиринга (Идентификатор Участника торгов)	Да	Character	0-12	
	FirmName	Наименование Участника клиринга (Наименование Участника торгов)	Да	Character	0-120	
	FirmNameEN	Наименование Участника клиринга (английское) (Наименование Участника торгов (английское))	Нет	Character	0-120	
SETTLEDATE		Блок данных по дате исполнения				
	SettleDate	Дата исполнения	Да	Date		
SETTLE		Блок информации по расчетному коду				
	ExtSettleCode	Расчетный код	Да	Character	20	
CURRPAIR		Блок данных валютной пары				
	CurrencyId	Идентификатор валюты лота /драгоценного металла	Да	Character	4	
	CurrencyName	Наименование валюты лота /драгоценного металла	Да	Character	30	

	CurrencyNameEN	Наименование валюты лота /драгоценного металла (английское)	Нет	Character	30	
	CoCurrencyId	Идентификатор сопряженной валюты	Да	Character	4	
	CoCurrencyName	Наименование сопряженной валюты	Да	Character	30	
	CoCurrencyNameEN	Наименование сопряженной валюты (английское)	Нет	Character	30	
RECORDS		Блок данных по сделке				
	TradeNo	Номер сделки	Да	Number	20	0
	SecurityId	Идентификатор инструмента	Да	Character	12	
	SecShortName	Краткое наименование инструмента	Да	Character	10	
	TradeGroup	Вид сделки: Т - обычная сделка S - сделка своп В - сделка бивалютной корзины F – сделка фикс	Да	Character	1	
	BuySell	Направление сделки В – Покупка S – Продажа	Да	Character	1	
	TradeDate	Дата заключения сделки	Да	Date		
	TradeTime	Время заключения сделки	Да	Time		
	TradeType	Тип сделки	Да	Character	1	
	Decimals	Число значимых знаков после запятой в курсе сделки (атрибут Price)	Да	Number		
	Quantity	Объем в валюте лота (в единицах валюты / в граммах)	Да	Number	20	2
	Value	Объем в сопряженной валюте	Да	Number	20	2
	Price	Курс	Да	Number	20	6
	TrdAccId	Код Торгово-клирингового счета соответствующего уровня	Да	Character	0-12	
	ClientCode	Краткий код клиента	Нет	Character	12	
	Details	ИНН или № паспорта клиента	Нет	Character	20	
	SubDetails	ИНН или № паспорта клиента субброкера	Нет	Character	20	
	TradeNoSrc	Номер исходной сделки. Поле заполняется для сделок SWAP с перенесенной датой исполнения второй части.	Нет	Number	20	0
/RECORDS						
/CURRPAIR						
/SETTLE						
/SETTLEDATE						
/CCX14						
/MICEX_DOC						

Отчет, формируемый для Участника клиринга, содержит информацию в отношении Расчетных кодов и/или Торгово-клиринговых счетов 1-го и 2-го уровня. Отчет, формируемый для Участника торгов, содержит информацию в отношении Расчетных кодов и/или Торгово-клиринговых счетов 2-го и 3-го уровня.

Пример отчета ССХ14:

Дата и Время формирования отчета <Дата> <Время>
НКО НКЦ (АО)

ОТЧЕТ О СДЕЛКАХ, ДАТА ИСПОЛНЕНИЯ КОТОРЫХ ПЕРЕНЕСЕНА

Дата, за которую сформирован отчет: <Дата>

Идентификатор Участника клиринга (Идентификатор Участника торгов):

Наименование Участника клиринга (Наименование Участника торгов):

Дата исполнения сделок <Дата N>

<Расчетный код N>

Наименование валюты лота/ драгоценного металла:

Наименование сопряженной валюты:

Номер сделки	Дата заключения сделки	Время заключения сделки	Инструмент	Тип сделки	Направление сделки	Объем в валюте лота (в единицах валюты / в граммах)	Объем в сопряженной валюте	Курс	Код ТКС	Код клиента	Номер исходной сделки*	
<i>Итого покупка</i>												
<i>Итого продажа</i>												

* В случае если поле «Номер исходной сделки» заполнено, то данная строка отчета содержит информацию об измененных условиях сделки, номер которой указан в данном поле.

5.6. Отчет о Поручениях на управление риском (CCX15)

Структура XML-файла:

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Нет	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES						
CCX15		Блок данных отчета				
	TradeDate	Дата, за которую сформирован отчет (Расчетного дня)	Да	Date		
	ClearingFirmId	Идентификатор Участника клиринга	Да	Character	0-12	
	ClearingFirmName	Наименование Участника клиринга	Да	Character	0-120	
	ClearingFirmNameEN	Наименование Участника клиринга (английское)	Нет	Character	0-120	
SETTLE		Блок информации по расчетному коду				
	ExtSettleCode	Расчетный код Участника клиринга	Да	Character	20	
SECURITY		Блок данных по инструменту				
	SecurityId	Идентификатор инструмента	Да	Character	12	
	SecShortName	Краткое наименование инструмента (USDRUB_RSK, EURRUB_RSK)	Да	Character	10	
	CurrencyId	Идентификатор валюты лота	Да	Character	4	
	CoCurrencyId	Идентификатор сопряженной валюты	Да	Character	4	
	CentralRate	Центральный курс RUB/EUR или RUB/USD	Да	Number	20	6
	OpeningBalance1	Нетто-обязательство / нетто-требование по Поручениям на управление риском на начало торгового дня в валюте лота	Да	Number	20	2
	OpeningBalance2	Нетто-обязательство / нетто-требование по Поручениям на	Да	Number	20	2

		управление риском на начало торгового дня в сопряженной валюте				
	ClosingBalance1	Нетто-обязательство / нетто-требование по Поручениям на управление риском на конец торгового дня в валюте лота	Да	Number	20	2
	ClosingBalance2	Нетто-обязательство / нетто-требование по Поручениям на управление риском на конец торгового дня в сопряженной валюте	Да	Number	20	2
	RECORDS	Блок данных по Поручениям на управление риском				
	TradeNo	Номер Поручения на управление риском	Да	Number	20	0
	TradeTime	Время подачи Поручения на управление риском	Да	Time		
	BuySell	Направление Поручения на управление риском В – Покупка S – Продажа	Да	Character	1	
	Quantity	Объем в валюте лота	Да	Number	20	2
	Value	Объем в сопряженной валюте	Да	Number	20	2
	/RECORDS					
	/SECURITY					
	/SETTLE					
	/CCX15					
	/MICEX_DOC					

Пример отчета ССХ15:

Дата и Время формирования отчета <Дата> <Время>
 НКО НКЦ (АО)

ОТЧЕТ О ПОРУЧЕНИЯХ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКОМ

Дата, за которую сформирован отчет: <Дата>
 Идентификатор Участника клиринга:
 Наименование Участника клиринга:

<Расчетный код N>
 <Инструмент N>
 <Центральный курс N>

№	Номер поручения	Время регистрации поручения	Обязательства / требования по поручениям на управление риском	
			Объем в валюте лота	Объем в сопряженной валюте
Нетто-обязательство / нетто-требование по Поручениям на управление риском на начало Расчетного дня:				
1				
2				
n				
Нетто-обязательство / нетто-требование по Поручениям на управление риском на конец Расчетного дня:				

5.7. Отчет об обязательствах по ПФИ (ССХ17)

Структура XML-файла:

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Нет	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
/DOC_REQUISITES						
ССХ17		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата, за которую сформирован отчет	Да	Date		
	ReportType	Назначение отчета: CLEARING - для Участника клиринга, TRADE - для Участника торгов	Да	Character		
	FirmId	Идентификатор Участника клиринга (Идентификатор Участника торгов)	Да	Character	0-12	
	FirmName	Наименование Участника клиринга (Наименование Участника торгов)	Да	Character	0-120	
	FirmNameEN	Наименование Участника клиринга (английское) (Наименование Участника торгов (английское))	Нет	Character	0-120	
SETTLE		Блок информации по Расчетному коду				
	ExtSettleCode	Расчетный код 1-го уровня (Расчетный код 2-го уровня)	Да	Character	20	
	NccRealAccount	Номер Счета обеспечения	Нет	Character	0-25	
	ExtSettleCodeUnifiedPool	Признак Расчетного кода Единого пула («Y» - да, «N» - нет)	Нет	Character	1	
CURRENCY		Блок данных по валюте/ драгоценному металлу				
	CurrencyId	Код базисного актива	Да	Character	4	
	CurrencyName	Наименование базисного актива	Нет	Character	30	

	CurrencyNameEN	Наименование базисного актива (английское)	Нет	Character	30	
TRADE		Блок информации по Расчетному коду 2-го уровня (Расчетному коду 3-го уровня)				
	ExtTradeCode	Расчетный код 2-го уровня (Расчетный код 3-го уровня)	Да	Character	20	
SETTLEDATE		Блок данных по Дате исполнения				
	SettleDate	Дата исполнения	Да	Date		
	SettlePrice	Текущая расчетная цена	Да	Number	20	6
RECORDS		Блок данных по обязательствам и сделкам				
	TradeDate	Дата заключения сделки	Да	Date		
	TradeTime	Время заключения сделки	Да	Time		
	TradeNo	Номер записи в реестре сделок	Нет	Number	20	
	Price	Предыдущая расчетная цена (для сделок, заключенных раньше предыдущего торгового дня) / Цена сделки (для сделок, заключенных в предыдущий торговый день)	Нет	Number	20	6
	TradeGroup	Вид обязательств/ требований: F – по фьючерсному контракту; S – по своп контракту (2ой части)	Да	Character	1-15	
	BuySell	Направление обязательств/ сделки: B – Покупка, S – Продажа	Да	Character	1	
	Quantity	Объем обязательств/ требований в единицах базисного актива (указывается со знаком)	Да	Number	20	2
	Value	Объем обязательств / требований в рублях (указывается со знаком)	Да	Number	20	2
	Varm	Обязательство/ Требование по уплате вариационной маржи (указывается со знаком)	Да	Number	20	2
	TrdAccId	Код Торгово-клирингового счета соответствующего уровня	Да	Character	0-12	
	TermQuantity	Объем обязательств/ требований, прекращенных в ходе клиринговой сессии, проведенной в дату, за которую сформирован отчет, в единицах базисного актива	Да	Number	20	2
	TermValue	Объем обязательств/ требований, прекращенных в ходе клиринговой сессии, проведенной в дату, за которую сформирован отчет, в рублях	Да	Number	20	2
/RECORDS						
/SETTLEDATE						
/TRADE						
/CURRENCY						
/SETTLE						
/CCX17						

/MICEX_DOC						
------------	--	--	--	--	--	--

Отчет, формируемый для Участника клиринга, содержит информацию в отношении Расчетных кодов и/или Торгово-клиринговых счетов 1-го и 2-го уровня. Отчет, формируемый для Участника торгов, содержит информацию в отношении Расчетных кодов и/или Торгово-клиринговых счетов 2-го и 3-го уровня.

Пример отчета ССХ17:

Дата и Время формирования отчета <Дата> <Время>
 Банк НКЦ (АО)

ОТЧЕТ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬСТВАХ ПО ПФИ

Дата, за которую сформирован отчет: <Дата>
 Идентификатор Участника клиринга (Идентификатор Участника торгов):
 Наименование Участника клиринга (Наименование Участника торгов):

<Расчетный код N>
 <Код базисного актива N>

Дата исполнения	Вид требований / обязательств	Дата и время заключения сделки	Номер записи в Реестре сделок	Предыдущая Расчетная цена / Цена сделки	Текущая Расчетная цена	Покупка			Продажа			Прекращенные Требования / Обязательства в единицах базисного актива	Прекращенные Требования / Обязательства в руб.	ТКС	Расчетный код	
						Требования в единицах базисного актива	Обязательство в руб.	Вар. маржа в руб.	Обязательство в единицах базисного актива	Требование в руб.	Вар. маржа в руб.					
						Итого			Итого							
Итого вариационная маржа, руб.				Расчетный код												

5.8. Отчет о расчетных ценах (CCX18)

Структура XML-файла:

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Нет	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
/DOC_REQUISITES						
CCX18		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата, за которую сформирован отчет	Да	Date		
CURRENCY		Блок данных по валюте/ драгоценному металлу				
	CurrencyId	Код валюты/ драгоценного металла	Да	Character	4	
	CurrencyName	Наименование валюты/ драгоценного металла	Нет	Character	30	
	CurrencyNameEN	Наименование валюты /драгоценного металла (английское)	Нет	Character	30	
SETTLEDATE		Блок данных по Дате исполнения				
	SettleDate	Дата исполнения	Да	Date		
	SettlePrice	Текущая расчетная цена	Да	Number	20	6
	Price	Предыдущая расчетная цена	Нет	Number	20	6
/SETTLEDATE						
/CURRENCY						
/CCX18						
/MICEX_DOC						

Пример отчета CCX18:

Дата и Время формирования отчета <Дата> <Время>
НКО НКЦ (АО)

ОТЧЕТ О РАСЧЕТНЫХ ЦЕНАХ

Дата, за которую сформирован отчет: <Дата>

Код валюты/ драгоценного металла	Дата исполнения	Предыдущая Расчетная цена	Текущая Расчетная цена
<код валюты/ драгоценного металла>			
<код валюты/ драгоценного металла>			

5.9. Отчет о Клиринговых идентификаторах (CCX19)

Структура XML-файла:

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа.				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Нет	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES						
CCX19		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата, за которую формируется отчет	Да	Date		
	ReportType	Назначение отчета: CLEARING - для Участника клиринга, TRADE - для Участника торгов	Да	Character		
	FirmId	Идентификатор Участника клиринга (Идентификатор Участника торгов)	Да	Character	0-12	
	FirmName	Наименование Участника клиринга (Наименование Участника торгов)	Да	Character	0-120	
	FirmNameEN	Наименование Участника клиринга (английское) (Наименование Участника торгов (английское))	Нет	Character	0-120	
RECORDS		Блок данных по Клиринговому идентификатору				
	UserId	Полномочия клирингового идентификатора	Да	Character	12	

	UserIdCM	Клиринговый менеджер («Y» - да, «N» - нет)	Нет	Character	1	
	UserIdOp	Оператор («Y» - да, «N» - нет)	Нет	Character	1	
	UserIdTr	Переводы («Y» - да, «N» - нет)	Нет	Character	1	
	DataChanged	Изменения («Y» - изменен, «N» - не изменен)	Да	Character	1	
/RECORDS						
/CCX19						
/MICEX_DOC						

Пример отчета ССХ19:

Дата и Время формирования отчета <Дата> <Время>
НКО НКЦ (АО)

ОТЧЕТ О КЛИРИНГОВЫХ ИДЕНТИФИКАТОРАХ

Дата, за которую сформирован отчет: <Дата>
Идентификатор Участника клиринга (Идентификатор Участника торгов):
Наименование Участника клиринга (Наименование Участника торгов):

№	Клиринговый идентификатор	Полномочия Клирингового идентификатора			Изменения
		Клиринговый менеджер	Оператор	Переводы	

5.10. Отчет о Торгово-клиринговых счетах (CCX20)

Структура XML-файла:

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Нет	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES						
CCX20		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата, за которую сформирован отчет	Да	Date		
	FirmId	Идентификатор Участника клиринга	Да	Character	0-12	
	FirmName	Наименование Участника клиринга	Да	Character	0-120	
	FirmNameEN	Наименование Участника клиринга (английское)	Нет	Character	0-120	
SETTLE		Блок информации по Расчетному коду				
	ExtSettleCode	Расчетный код Участника клиринга	Да	Character	20	
	ExtSettleCodeUnifiedPool	Признак Расчетного кода Единого пула («Y» - да, «N» - нет)	Нет	Character	1	
	ExtSettleCodeType	Тип Расчетного кода: S - для учета собственных средств; L - для учета средств клиентов; D - для учета средств, переданных в доверительное управление	Нет	Character	1	
	TrdAccId	Код Торгово-клирингового счета	Да	Character	0-12	
	Details	ИНН или № паспорта клиента Участника клиринга	Нет	Character	20	
	SubDetails	ИНН или № паспорта клиента субброкера	Нет	Character	20	
	CommPaymentAcc	Признак Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений («Y» - да, «N» - нет)	Нет	Character	1	
	TaxPaymentAcc	Признак, указывающий на списание с Расчетного кода	Нет	Character	1	

		оборотной части комиссионного вознаграждения («Y» - да, «N» - нет)				
	TaxPaymentAccLink	Соответствие Расчетному коду для списания оборотной части комиссионного вознаграждения	Нет	Character	5	
RECORDS		Блок данных по Счетам обеспечения				
	CurrencyId	Идентификатор валюты	Нет	Character	0-4	
	NccRealAccount	Номер Счета обеспечения	Нет	Character	0-25	
/RECORDS						
/SETTLE						
/CCX20						
/MICEX_DOC						

Пример отчета CCX20:

Дата и Время формирования отчета <Дата> <Время>
НКО НКЦ (АО)

ОТЧЕТ О ТОРГОВО-КЛИРИНГОВЫХ СЧЕТАХ

Дата, за которую сформирован отчет: <Дата>
Идентификатор Участника клиринга:
Наименование Участника клиринга:

Расчетный код	Тип Расчетного кода	Торгово-клиринговый счет	Идентификационные данные	Расчетный код для списания комиссионных вознаграждений	Взимается оборотная часть комиссионного вознаграждения	Соответствие Расчетному коду для списания оборотной части комиссионного вознаграждения

Идентификатор валюты	Номер Счета обеспечения

5.11. Отчет о Торгово-клиринговых счетах (2-го уровня / 3-го уровня) (CCX20A)

Структура XML-файла:

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа.	Да			
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе	Да			
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Нет	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES			Да			
CCX20A		Блок данных отчета	Да			
	ReportDate	Дата, за которую сформирован отчет	Да	Date		
	ReportType	Назначение отчета: CLEARING - для Участника клиринга, TRADE - для Участника торгов	Да	Character		
	FirmId	Идентификатор Участника клиринга (Идентификатор Участника торгов)	Да	Character	0-12	
	FirmName	Наименование Участника клиринга (Наименование Участника торгов)	Да	Character	0-120	
	FirmNameEN	Наименование Участника клиринга (английское) (Наименование Участника торгов (английское))	Нет	Character	0-120	
SETTLE1		Блок информации по Расчетному коду 1-го уровня (Расчетному коду 2-го уровня)				

	ExtSettleCode	Расчетный код 1-го уровня (Расчетный код 2-го уровня)	Да	Character	20	
	TrdAccId	Код Торгово-клирингового счета	Да	Character	0-12	
	Details	ИНН или № паспорта клиента Участника клиринга	Нет	Character	20	
	SubDetails	ИНН или № паспорта клиента субброкера	Нет	Character	20	
SETTLE2		Блок информации по Расчетному коду 2-го уровня (Расчетному коду 3-го уровня)				
	ExtSettleCode	Расчетный код 2-го уровня (Расчетный код 3-го уровня)	Да	Character	20	
	TrdAccId	Код Торгово-клирингового счета 2-го уровня	Да	Character	0-12	
	TrdFirmId	Идентификатор Участника торгов	Нет	Character	0-12	
	TrdFirmName	Наименование Участника торгов	Нет	Character	0-120	
	TrdFirmNameEN	Наименование Участника торгов (английское)	Нет	Character	0-120	
	Details	ИНН или № паспорта клиента Участника клиринга	Нет	Character	20	
	SubDetails	ИНН или № паспорта клиента субброкера	Нет	Character	20	
/SETTLE2						
/SETTLE1						
/CCX20A						
/MICEX_DOC						

Отчет, формируемый для Участника клиринга, содержит информацию в отношении Расчетных кодов и/или Торгово-клиринговых счетов 1-го и 2-го уровня. Отчет, формируемый для Участника торгов, содержит информацию в отношении Расчетных кодов и/или Торгово-клиринговых счетов 2-го и 3-го уровня.

Пример отчета ССХ20А:

Дата и Время формирования отчета <Дата> <Время>
НКО НКЦ (АО)

ОТЧЕТ О ТОРГОВО-КЛИРИНГОВЫХ СЧЕТАХ

Дата, за которую сформирован отчет: <Дата>

Идентификатор Участника клиринга (Идентификатор Участника торгов):

Наименование Участника клиринга (Наименование Участника торгов):

Расчетный код	Торгово-клиринговый счет

(Идентификатор Участника торгов:)

(Наименование Участника торгов:)

Расчетный код	Торгово-клиринговый счет	Идентификационные данные

5.12. Отчет о требованиях/ обязательствах (CCX37)

Структура XML-файла:

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Нет	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES						
CCX37		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата, за которую сформирован отчет	Да	Date		
	ReportType	Назначение отчета: CLEARING - для Участника клиринга, TRADE - для Участника торгов	Да	Character		
	FirmId	Идентификатор Участника клиринга (Идентификатор Участника торгов)	Да	Character	0-12	
	FirmName	Наименование Участника клиринга (Наименование Участника торгов)	Да	Character	0-120	
	FirmNameEN	Наименование Участника клиринга (английское) (Наименование Участника торгов (английское))	Нет	Character	0-120	
SETTLE		Блок информации по расчетному коду				
	ExtSettleCode	Расчетный код 1-го уровня (Расчетный код 2-го уровня)	Да	Character	20	
	ExtSettleCodeUnifiedPool	Признак Расчетного кода Единого пула («Y» - да, «N» - нет)	Нет	Character	1	
SETTLEDATE		Блок информации по дате исполнения				
	SettleDate	Дата исполнения	Да	Date		
SECURITY		Блок данных по инструменту				
	SecurityId	Идентификатор инструмента	Да	Character	12	

	SettlePrice	Текущая расчетная цена	Да	Number	20	6
	Price	Предыдущая расчетная цена	Нет	Number	20	6
TRDACC		Блок данных по ТКС				
	TrdAccId	Код Торгово-клирингового счета соответствующего уровня	Да	Character	0-12	
RECORDS		Блок данных по позициям				
	QuantityBegC	Требование по итогам клиринговой сессии предыдущего Расчетного дня в единицах базисного актива	Да	Number	20	2
	ValueBegRURD	Обязательство по итогам клиринговой сессии предыдущего Расчетного дня в рублях (указывается со знаком)	Да	Number	20	2
	QuantityBegD	Обязательство по итогам клиринговой сессии предыдущего Расчетного дня в единицах базисного актива (указывается со знаком)	Да	Number	20	2
	ValueBegRURC	Требование по итогам клиринговой сессии предыдущего Расчетного дня в рублях	Да	Number	20	2
	QuantityMidC	Требование по сделкам, заключенным в ходе предыдущего Расчетного дня, в единицах базисного актива	Да	Number	20	2
	ValueMidRURD	Обязательство по сделкам, заключенным в ходе предыдущего Расчетного дня, в рублях (указывается со знаком)	Да	Number	20	2
	QuantityMidD	Обязательство по сделкам, заключенным в ходе предыдущего Расчетного дня, в единицах базисного актива (указывается со знаком)	Да	Number	20	2
	ValueMidRURC	Требование по сделкам, заключенным в ходе предыдущего Расчетного дня, в рублях	Да	Number	20	2
	QuantityFinC	Требование по итогам клиринговой сессии текущего Расчетного дня в единицах базисного актива	Да	Number	20	2
	ValueFinD	Обязательство по итогам клиринговой сессии текущего Расчетного дня в рублях (указывается со знаком)	Да	Number	20	2
	QuantityFinD	Обязательство по итогам клиринговой сессии текущего Расчетного дня в единицах базисного актива (указывается со знаком)	Да	Number	20	2
	ValueFinC	Требование по итогам клиринговой сессии текущего Расчетного дня в рублях	Да	Number	20	2
	Varm	Вариационная маржа по позиции (указывается со знаком)	Да	Number	20	2
/RECORDS						
/TRDACC						
/SECURITY						
/SETTLEDATE						
/SETTLE						
/CCX37						

/MICEX_DOC																			
------------	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

Отчет, формируемый для Участника клиринга, содержит информацию в отношении Расчетных кодов 1-го уровня и Торгово-клиринговых счетов 1-го и 2-го уровня. Отчет, формируемый для Участника торгов, содержит информацию в отношении Расчетных кодов 2-го уровня и Торгово-клиринговых счетов 2-го и 3-го уровня.

Пример отчета ССХ37:

Дата и Время формирования отчета <Дата> <Время>
 НКО НКЦ (АО)

ОТЧЕТ О ТРЕБОВАНИЯХ/ ОБЯЗАТЕЛЬСТВАХ

Дата, за которую сформирован отчет: <Дата>
 Идентификатор Участника клиринга (Идентификатор Участника торгов):
 Наименование Участника клиринга (Наименование Участника торгов):

<Расчетный код N>

Дата исполнения	Код инструмента	ТКС	По итогам клиринговой сессии предыдущего Расчетного дня				По сделкам, заключенным в ходе предыдущего Расчетного дня				По итогам клиринговой сессии текущего Расчетного дня				Предыдущая Расчетная цена	Текущая Расчетная цена	Вариационная маржа	
			Требование в единицах базисного актива	Обязательство в руб.	Обязательство в единицах базисного актива	Требование в руб.	Требование в единицах базисного актива	Обязательство в руб.	Обязательство в единицах базисного актива	Требование в руб.	Требование в единицах базисного актива	Обязательство в руб.	Обязательство в единицах базисного актива	Требование в руб.				

5.13. Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (CCX43)

Структура XML-файла:

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Нет	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES						
CCX43		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата, за которую сформирован отчет	Да	Date		
	ReportType	Назначение отчета: CLEARING - для Участника клиринга, TRADE - для Участника торгов	Да	Character		
	FirmId	Идентификатор Участника клиринга (Идентификатор Участника торгов)	Да	Character	0-12	
	FirmName	Наименование Участника клиринга (Наименование Участника торгов)	Да	Character	0-120	
	FirmNameEN	Наименование Участника клиринга (английское) (Наименование Участника торгов (английское))	Нет	Character	0-120	
SETTLE		Блок информации по Расчетному коду				
	ExtSettleCode	Расчетный код 1-го уровня (Расчетный код 2-го уровня)	Да	Character	20	
	ExtSettleCodeUnifiedPool	Признак Расчетного кода Единого пула («Y» - да, «N» - нет)	Нет	Character	1	
SETTLEDATE		Блок данных по дате исполнения	Да			
	SettleDate	Дата исполнения обязательств	Да	Date		
CURRPAIR		Блок данных валютной пары				
	CurrencyId	Идентификатор валюты лота / драгоценного металла	Да	Character	4	

	CurrencyName	Наименование валюты лота / драгоценного металла	Да	Character	30	
	CurrencyNameEN	Наименование валюты лота / драгоценного металла (английское)	Да	Character	30	
	CoCurrencyId	Идентификатор сопряженной валюты	Да	Character	4	
	CoCurrencyName	Наименование сопряженной валюты	Да	Character	30	
	CoCurrencyNameEN	Наименование сопряженной валюты (английское)	Нет	Character	30	
RECORDS		Блок данных по сделке				
	TradeNo	Номер сделки	Да	Number	20	0
	SecurityId	Идентификатор инструмента	Да	Character	12	
	SecShortName	Краткое наименование инструмента	Да	Character	10	
	TradeGroup	Вид сделки: Т - обычная сделка, S - сделка своп, В - сделка бивалютной корзины, F – сделка фикс	Да	Character	1	
	BuySell	Направление сделки В – Покупка S – Продажа	Да	Character	1-01	
	TradeDate	Дата заключения сделки	Да	Date		
	TradeTime	Время заключения сделки	Да	Time		
	TradeType	Тип сделки	Да	Character	1	
	Decimals	Число значимых знаков после запятой в курсе сделки (атрибут Price)	Да	Number		
	Quantity	Объем в валюте лота (в единицах валюты / в граммах)	Да	Number	20	2
	Value	Объем в сопряженной валюте	Да	Number	20	2
	Price	Курс	Да	Number	20	6
	ClrComm	Комиссионного вознаграждение за клиринговое обслуживание, руб.	Нет	Number	20	2
	ExchComm	Комиссионное вознаграждение за организацию торгов, руб.	Нет	Number	20	2
	ITSComm	Вознаграждение за предоставление ИТС, руб.	Нет	Number	20	2
	TrdAccId	Код Торгово-клирингового счета соответствующего уровня	Да	Character	0-12	
	ClientCode	Краткий код клиента	Нет	Character	12	
	Details	ИНН или № паспорта клиента	Нет	Character	20	
	SubDetails	ИНН или № паспорта клиента субброкера	Нет	Character	20	
	TradeNoSrc	Номер исходной сделки. Поле заполняется для сделок SWAP с перенесенной датой исполнения второй части.	Нет	Number	20	0
	/RECORDS					
	/CURRPAIR					
	/SETTLEDATE					
	/SETTLE					
	/CCX43					
	/MICEX_DOC					

Отчет, формируемый для Участника клиринга, содержит информацию в отношении Расчетных кодов и/или Торгово-клиринговых счетов 1-го и 2-го уровня. Отчет, формируемый для Участника торгов, содержит информацию в отношении Расчетных кодов и/или Торгово-клиринговых счетов 2-го и 3-го уровня.

Пример отчета ССХ43:

Дата и Время формирования отчета <Дата> <Время>
 НКО НКЦ (АО)

ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА СДЕЛОК, ПРИНЯТЫХ В КЛИРИНГ

Дата, за которую сформирован отчет: <Дата>
 Идентификатор Участника клиринга (Идентификатор Участника торгов):
 Наименование Участника клиринга (Наименование Участника торгов):
 <Расчетный код N>
 <Дата N>

Наименование валюты лота/ драгоценного металла:
 Наименование сопряженной валюты:

Номер сделки	Дата заключения сделки	Время заключения сделки	Инструмент	Тип сделки	Направление сделки	Объем в валюте лота (в единицах валюты / в граммах)	Объем в сопряженной валюте	Курс	Комиссионное вознаграждение			Код ТКС	Код клиента	
									за клиринговое обслуживание	за организацию торгов	за ИТС			
<i>Итого покупка</i>														
<i>Итого продажа</i>														

5.14. Отчет о переданных профилях активов на валютном рынке (CCX49)

Структура XML-файла:

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Нет	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES						
CCX43		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата, за которую сформирован отчет	Да	Date		
	ReportTime	Время формирования отчета	Да	Time		
	ClearingFirmId	Идентификатор Участника клиринга	Да	Character	0-12	
	ClearingFirmName	Наименование Участника клиринга	Да	Character	0-120	
	ClearingFirmNameEN	Наименование Участника клиринга (английское)	Нет	Character	0-120	
SETTLE		Блок информации по Расчетному коду				
	ExtSettleCode	Расчетный код Единого пула	Да	Character	5	
PROFINFO		Блок информации по профилю актива				
	AssetID	Идентификатор актива	Да	Character	4	
	AssetName	Наименование актива	Да	Character	30	
	AssetNameEN	Наименование актива (английское)	Да	Character	30	
	OpeningBalance	Входящий остаток	Да	Number	20	2
	ClosingBalance	Исходящий/ текущий остаток	Да	Number	20	2
RECORDS		Данные по операции				
	ProfilTran	Сумма/ количество передаваемого профиля	Да	Number	20	2

	TranType	Признак перевода профиля актива: 1 – перевод профиля по инициативе Участника клиринга; 2 – перевод профиля по инициативе НКЦ	Да	Number	1	
	OperationTime	Время операции	Да	Time		
	TranNo	Номер транзакции	Да	Character	0-20	
	ExtSettleCode2	Расчетный код 2-го уровня	Нет	Character	20	
	/RECORDS					
	/PROFINFO					
	/SETTLE					
	/FIRM					
	/CCX49					
	/MICEX_DOC					

Пример отчета ССХ49:

Дата и Время формирования отчета <Дата> <Время>
НКО НКЦ (АО)

ОТЧЕТ О ПЕРЕДАННЫХ ПРОФИЛЯХ АКТИВОВ НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ

Дата, за которую сформирован отчет: <Дата>
Время формирования отчета
Идентификатор Участника клиринга:
Наименование Участника клиринга:

Расчетный код Единого пула
Наименование актива, по которому передан профиль

Комментарий	Сумма / Количество	Признак перевода профиля	Время операции	Номер операции	Расчетный код 2-го уровня
Входящий остаток					
Перевод профиля					

Исходящий/ текущий остаток					

5.15. Требование о погашении Задолженности (CCX69)

Структура XML-файла:

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Нет	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES						
CCX69		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата, за которую сформирован отчет	Да	Date		
	MaxDebtsDate	Максимальная дата погашения задолженности	Да	Date		
	MaxDebtsTime	Максимальное время погашения задолженности	Да	Date		
	ClearingFirmId	Идентификатор Участника клиринга	Да	Character	0-12	
	ClearingFirmName	Наименование Участника клиринга	Да	Character	0-120	
	ClearingFirmNameEN	Наименование Участника клиринга (английское)	Нет	Character	0-120	
SETTLE		Блок информации по расчетному коду				
	ExtSettleCode	Расчетный код Участника клиринга	Да	Character	20	
	DebtsSum	Сумма Задолженности	Да	Number	20	2
/SETTLE						
/CCX69						
/MICEX_DOC						

Пример отчета CCX69:

Дата и Время формирования отчета <Дата> <Время>
НКО НКЦ (АО)

ТРЕБОВАНИЕ О ПОГАШЕНИИ ЗАДОЛЖЕННОСТИ

Дата, за которую сформирован отчет: <Дата>
Идентификатор Участника клиринга:
Наименование Участника клиринга:

<Расчетный код N>

Задолженность должна быть погашена в срок до: 20:00 мск. <Дата>

Расчетный код	Сумма Задолженности, руб.

5.16. Отчет об оценке Обеспечения (CCX84)

Структура XML-файла:

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Да	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Да	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES						
CCX84		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата, за которую сформирован отчет	Да	Date		
	ClearingFirmId	Идентификатор Участника клиринга	Да	Character	0-12	
	ClearingFirmName	Наименование Участника клиринга	Да	Character	0-120	
	ClearingFirmNameEN	Наименование Участника клиринга (eng)	Нет	Character	0-120	
SETTLE		Блок информации по Расчетному коду				
	ExtSettleCode	Расчетный код Участника клиринга	Да	Character	20	
	SumValue	Общая стоимость Обеспечения в рублях	Да	Number	20	2
	LockValue	Стоимость Обеспечения, недоступного для вывода, в рублях	Да	Number	20	2
	FreeValue	Стоимость Обеспечения, доступного для вывода, в рублях	Да	Number	20	2
	SingleLimit	Единый лимит	Да	Number	20	2
RECORDS		Блок данных об Обеспечении				
	NccRealAccount	Номер Счета обеспечения	Нет	Character	0-25	
	CurrencyId	Идентификатор валюты /драгоценного металла	Да	Character	4	
	CurrencyName	Наименование валюты /драгоценного металла	Да	Character	30	
	CurrencyNameEN	Наименование валюты/ драгоценного металла (eng)	Нет	Character	30	

	Quantity	Количество/ сумма актива, внесенного в качестве Обеспечения (в единицах валюты /в граммах)	Да	Number	20	2
	LockQuantity	Количество/ сумма актива, недоступного для вывода (в единицах валюты /в граммах)	Да	Number	20	2
	FreeQuantity	Количество/ сумма актива, доступного для вывода (в единицах валюты /в граммах)	Да	Number	20	2
	Value	Стоимость Обеспечения в рублях	Да	Number	20	2
	/RECORDS					
	/SETTLE					
	/FIRM					
	/CCX84					
	/MICEX_DOC					

Пример отчета ССХ84:

Дата и Время формирования отчета <Дата> <Время>
НКО НКЦ (АО)

ОТЧЕТ ОБ ОЦЕНКЕ ОБЕСПЕЧЕНИЯ

Дата, за которую сформирован отчет: <Дата>

Идентификатор Участника клиринга:

Наименование Участника клиринга:

<Расчетный код N>

Код валюты / драгоценного металла	Наименование валюты / драгоценного металла	Количество/ сумма актива, внесенного в качестве Обеспечения	Количество/ сумма актива, недоступного для вывода	Стоимость Обеспечения, руб.
Общая стоимость Обеспечения, руб.				
Стоимость Обеспечения, доступного для вывода, руб.				
Стоимость Обеспечения, недоступного для вывода, руб.				
Единый лимит				

5.17. Отчет об Обеспечении (CCX89)

Структура XML-файла:

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Нет	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES						
CCX89		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата, за которую сформирован отчет	Да	Date		
	ReportType	Назначение отчета: CLEARING - для Участника клиринга, TRADE - для Участника торгов	Да	Character		
	FirmId	Идентификатор Участника клиринга (Идентификатор Участника торгов)	Да	Character	0-12	
	FirmName	Наименование Участника клиринга (Наименование Участника торгов)	Да	Character	0-120	
	FirmNameEN	Наименование Участника клиринга (английское) (Наименование Участника торгов (английское))	Нет	Character	0-120	
SETTLE		Блок информации по расчетному коду				
	ExtSettleCode	Расчетный код	Да	Character	20	
	LevelType	Признак, указывающий на соответствие Расчетному коду соответствующего уровня: 1 – Расчетный код 1-го уровня; 2 – Расчетный код 2-го уровня; 3 – Расчетный код 3-го уровня	Да	Number	1	

RECORDS		Блок данных по обязательствам				
	CurrencyId	Идентификатор валюты/ драгоценного металла	Да	Character	4	
	CurrencyName	Наименование валюты / драгоценного металла	Да	Character	30	
	CurrencyNameEN	Наименование валюты /драгоценного металла (английское)	Да	Character	30	
	OpeningBalance	Входящий остаток	Да	Number	20	2
	ClosingBalance	Исходящий остаток	Да	Number	20	2
	DebitSum	Итого по дебету	Да	Number	20	2
	CreditSum	Итого по кредиту	Да	Number	20	2
	NettoSum	Суммарное нетто-обязательство / нетто-требование	Да	Number	20	2
ENTRY		Данные по операции				
	OperationCode	Код операции с Обеспечением: 1 – внесение / возврат Обеспечения; 2 – изменение информации об Обеспечении с использованием Клиринговой системы; 3 – исполнение итоговых нетто-обязательств/нетто-требований; 4 – исполнение обязательств/ требований по уплате вариационной маржи 5 – исполнение обязательств по уплате комиссионного вознаграждения за организацию торгов; 6 - исполнение обязательств по уплате комиссионного вознаграждения Клирингового центра 7 – исполнение обязательств по уплате вознаграждения за предоставление ИТС	Да	Number	0-2	
	OperationTime	Время операции / время исполнения	Нет	Time		
	DocNo	Номер операции	Нет	Character	0-20	
	Debit	Обороты по дебету	Да	Number	20	2
	Credit	Обороты по кредиту	Да	Number	20	2
	Netto	Нетто-обязательство / нетто-требование	Да	Number	20	2
/ENTRY						
/RECORDS						
/SETTLE						
/CCX89						
/MICEX_DOC						

Пример отчета ССХ89:

Дата и Время формирования отчета <Дата> <Время>
НКО НКЦ (АО)

ОТЧЕТ ОБ ОБЕСПЕЧЕНИИ

Дата, за которую сформирован отчет: <Дата>
Идентификатор Участника клиринга (Идентификатор Участника торгов):
Наименование Участника клиринга (Наименование Участника торгов):

<Расчетный код N>

Расчетный код (2-го) уровня
Наименование валюты расчётов:

Код операции	Комментарии	Сумма операции	Обороты по дебету	Обороты по кредиту	Номер операции	Время операции/исполнения
	Входящий остаток					
	Итого обороты					
	Исходящий остаток					

<Расчетный код N>

Расчетный код (3-го) уровня
Наименование валюты расчётов:

Код операции	Комментарии	Сумма операции	Обороты по дебету	Обороты по кредиту	Номер операции	Время операции/исполнения
	Входящий остаток					
	Итого обороты					
	Исходящий остаток					

Отчет, формируемый для Участника клиринга, содержит информацию в отношении Расчетных кодов 2-го уровня. Отчет, формируемый для Участника торгов, содержит информацию в отношении Расчетных кодов 2-го и 3-го уровня.

5.18. Отчет об Итоговых нетто-обязательствах, которые будут прекращены (CCX91)

Структура XML-файла:

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Нет	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
/DOC_REQUISITES						
CCX91		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата, за которую формируется отчет	Да	Date		
	ClearingFirmID	Идентификатор Участника клиринга	Да	Character	0-12	
	ClearingFirmName	Наименование Участника клиринга	Да	Character	0-120	
	ClearingFirmNameEN	Наименование Участника клиринга (английское)	Нет	Character	0-120	
SETTLE		Блок информации по Расчетному коду				
	RealAccount	Расчетный код Участника клиринга	Да	Character	120	
RECORDS		Блок данных по обязательствам				
	CurrencyId	Идентификатор валюты / драгоценного металла	Да	Character	4	
	CurrencyName	Наименование валюты / драгоценного металла	Да	Character	30	
	CurrencyNameEN	Наименование валюты/ драгоценного металла (eng)	Нет	Character	30	
	FixBalanceTime	Время, на которое зафиксирован исходящий остаток по денежным средствам или драгоценным металлам	Да	Time		
	Balance	Обеспечение в денежных средствах / драгоценных металлах	Да	Number	20	2
	Netto	Итоговое нетто-обязательство	Да	Number	20	2
	UnsecuredLiabilities	Итоговое нетто-обязательство, не обеспеченное средствами под исполнение	Да	Number	20	2
	Penalty	Штраф	Да	Number	20	2

/RECORDS						
/SETTLE						
/CCX91						
/MICEX_DOC						

Пример отчета ССХ91:

Дата и Время формирования отчета <Дата> <Время>
НКО НКЦ (АО)

ОТЧЕТ ОБ ИТоговых нетто-обязательствах, которые будут прекращены

Дата, за которую сформирован отчет: <Дата>

Идентификатор Участника клиринга:

Наименование Участника клиринга:

Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам / драгоценным металлам, не обеспеченные средствами под исполнение по итогам двух Расчетных дней подряд:

Расчетный код	Идентификатор валюты/ драгоценного металла	Наименование валюты/ драгоценного металла	Итоговое нетто-обязательство	Обеспечение в денежных средствах / драгоценных металлах	Итоговое нетто-обязательство, не обеспеченное средствами под исполнение	Время фиксации	Штраф