

Приложение 3

УТВЕРЖДЕНЫ

приказом НКО НКЦ (АО)

от «___» _____ 2019 года

№ _____

Председатель Правления

НКО НКЦ (АО)

_____ М.П.

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

**г. Москва
2019 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 Торгового-клирингового счета 2-го уровня	8
2.3. Запрос на открытие Торгового-клирингового счета 3-го уровня	9
2.4. Постоянное поручение на возврат обеспечения	10
3. Формы (форматы) документов, предоставляемых Участниками торгов в бумажном виде или в виде документа ЭДО	11
3.1. Запрос на открытие Торгово-клирингового счета 3-го уровня.....	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)	22
5.4. Отчет о Маржинальном требовании (ССХ11).....	25
5.5. Отчет о сделках, Дата исполнения которых перенесена (ССХ14)	27
5.6. Отчет о Поручениях на управление риском (ССХ15)	30
5.7. Отчет об обязательствах по ПФИ (ССХ17).....	33
5.8. Отчет о расчетных ценах (ССХ18).....	36
5.9. Отчет о Клиринговых идентификаторах (ССХ19).....	38
5.10. Отчет о Торгово-клиринговых счетах (ССХ20).....	40
5.11. Отчет о Торгово-клиринговых счетах (2-го уровня / 3-го уровня) (ССХ20А).....	43
5.12. Отчет о требованиях/ обязательствах (ССХ37).....	47
5.13. Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (ССХ43)	50
5.14. Отчет о переданных профилях активов на валютном рынке (ССХ49)	53
5.15. Требование о погашении Задолженности (ССХ69)	55
5.16. Отчет об оценке Обеспечения (ССХ84).....	57
5.17. Отчет об Обеспечении (ССХ89)	59
5.18. Отчет о сделках своп (ССХ90).....	62
5.19. Отчет об Итоговых нетто-обязательствах, которые будут прекращены (ССХ91).....	64
5.20. Выписка из реестра Предложений (ССХ122).....	66
5.21. Выписка из реестра Внебиржевых сделок с иностранной валютой (ССХ123)	69
5.22. Выписка из реестра незарегистрированных Предложений (ССХ124).....	72
5.23. Выписка из реестра Аукционов RFS (ССХ125)	74

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

Просит, в соответствии с договором Интегрированного технологического сервиса № _____ от «__» _____ 20____, (необходимо выбрать ОДИН из вариантов А или В, или С):

А. <input type="checkbox"/> присвоить новые клиринговые идентификаторы в количестве _____	
Присваивается один или несколько новых идентификаторов ОДНОГО типа с ОДИНАКОВЫМИ полномочиями. Заполняются « Полномочия клиринговых идентификаторов » и Приложение №1 « Информация о подключении »	
В. <input type="checkbox"/> изменить полномочия по клиринговым идентификаторам	С. <input type="checkbox"/> аннулировать клиринговые идентификаторы
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 »	Не заполняются « Полномочия клиринговых идентификаторов » и Приложение №1 « Информация о подключении »
Клиринговый(е) идентификатор(ы) (необходимо указать идентификатор(ы), которому(ым) необходимо изменить полномочия или аннулировать)	
...	

Полномочия клиринговых идентификаторов

1. Клиринговые полномочия По умолчанию присваиваются полномочия оператор	клиринговый менеджер ⁽¹⁾	<input type="checkbox"/> присвоить	<input type="checkbox"/> аннулировать
	оператор ⁽²⁾	<input type="checkbox"/> присвоить	<input type="checkbox"/> аннулировать
	оператор + переводы ⁽³⁾	<input type="checkbox"/> присвоить	<input type="checkbox"/> аннулировать
	Внебиржевые сделки с иностранной валютой ⁽⁴⁾	(для изменения настроек заполняется Приложение №2)	
2. Ограничение по ТКС По умолчанию доступны все ТКС	<input type="checkbox"/> использовать со всеми ТКС ⁽⁵⁾ <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 Идентификаторам, включенным в группу, доступна информация об операциях пользователей, включенных в группу	Наименование группы		
	<input type="checkbox"/> объединить	<input type="checkbox"/> аннулировать объединение	
4. Получение информации По умолчанию, при отсутствии ограничения по ТКС, транслируется вся информация	о комиссии	<input type="checkbox"/> разрешить	<input type="checkbox"/> запретить

5. Язык интерфейса По умолчанию - русский	<input type="checkbox"/> русский	<input type="checkbox"/> английский
--	----------------------------------	-------------------------------------

С тарифами и Условиями предоставления интегрированного технологического сервиса Публичного Акционерного Общества «Московская Биржа ММВБ-РТС» ознакомлен и согласен. Оплату в соответствии с тарифами гарантирую

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

- (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»). Доступен просмотр Внебиржевых сделок с иностранной валютой
- (2) полномочия на просмотр позиций и обязательств/требований по денежным средствам/драгоценным металлам. Доступен просмотр Внебиржевых сделок с иностранной валютой
- (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). Доступен просмотр Внебиржевых сделок с иностранной валютой
- (4) полномочия на заключение Внебиржевых сделок с иностранной валютой
- (5) 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⁽¹⁾

Способ подключения	Тип терминала	<input type="checkbox"/> MOEX Trade Currency <input type="checkbox"/> Универсальное рабочее место СМА
<input type="checkbox"/> прямое подключение терминала через Интернет⁽²⁾ Указывается криптоимя с областью действия «Электронный документооборот валютного рынка». Образец формата криптоимени: INN=____, OGRN=____, SNILS=____, T=____, CN=____, OU=____, O=____, L=____, ST=____, C=____		
<input type="checkbox"/> подключение терминала через 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"/> подключение терминала через шлюз Personal ASTSBridge⁽²⁾ Указывается IP адрес шлюза DMZ сегмента закрытой корпоративной сети, через который организуется подключение всех ID с аналогичным типом подключения		
<input type="checkbox"/> подключение терминала через Hosted ASTSBridge (Выделенный канал) Указывается IP адрес шлюза CLT сегмента закрытой корпоративной сети, через который организуется подключение		
<input type="checkbox"/> подключение терминала через Hosted ASTSBridge (POP)⁽²⁾ Указывается IP адрес сегмента сети , настроенный Участнику в международной точке присутствия		

через ВПТС⁽¹⁾ на валютном рынке и рынке драгоценных металлов

Серверное приложение для подключения ВПТС к ПТК Биржи	<input type="checkbox"/> Personal ASTSBridge <input type="checkbox"/> DFServer	<input type="checkbox"/> MFIX Transactional <input type="checkbox"/> Hosted ASTSBridge (Выделенный канал)	<input type="checkbox"/> Hosted ASTSBridge (Интернет)
---	---	--	---

Фактический адрес установки серверного приложения			
IP адрес машины, на которой установлено серверное приложение			
IP адрес клиентского приложения			
Название ВПТС			
Название компании разработчика ВПТС			
Криптоимя с областью действия «Электронный документооборот валютного рынка». Образец: INN=__, OGRN=__, SNILS=__, T=__, CN=__, OU=__, O=__, L=__, ST=__, C=__			

РЕЙТЕР ⁽³⁾ _____
(Указывается код, закрепленный за Участником клиринга в РЕЙТЕР)

Блумберг ⁽³⁾ _____
(Указывается код, закрепленный за Участником клиринга в Блумберг)

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

- (1) Тип подключения (терминал, Personal ASTSBridge, MFIX Transactional, Hosted ASTSBridge, WEB2L) не может быть изменен.
(2) Данный способ подключения невозможен для универсального рабочего места СМА.
(3) Доступно только для Внебиржевых сделок с иностранной валютой

Приложение №2 к Заявлению о клиринговых идентификаторах на валютном рынке и рынке драгоценных металлов

Полномочия клиринговых идентификаторов на заключение Внебиржевых сделок с иностранной валютой/ драгоценными металлами

Просим установить для указанных / присвоенных в соответствии с настоящим Заявлением клиринговых идентификаторов следующие полномочия:

Возможность заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой/ драгоценными металлами, в которых одним из конечных контрагентов является Провайдер ликвидности	<input type="checkbox"/> не предоставлять <input type="checkbox"/> предоставить по всем кодам* <input type="checkbox"/> предоставить по указанным ниже кодам						
	<input type="checkbox"/> EURUSD_SPT	<input type="checkbox"/> GBPUSD_SPT	<input type="checkbox"/> USDCNY_SPT		<input type="checkbox"/> USDJPY_SPT	<input type="checkbox"/> XAUUSD_SPT	<input type="checkbox"/> XAURUB_SPT
			<input type="checkbox"/> USDTRY_TOM				

Возможность заключения Внебиржевых сделок спот и своп с иностранной валютой	В качестве Потребителей ликвидности	В качестве Поставщиков ликвидности
	<input type="checkbox"/> не предоставлять <input type="checkbox"/> предоставить	<input type="checkbox"/> не предоставлять <input type="checkbox"/> предоставить
<i>При необходимости ограничений по инструментам</i>	<input type="checkbox"/> предоставить по всем кодам* <input type="checkbox"/> предоставить по указанным ниже кодам	

Формы и форматы документов и отчетов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов. Часть III.

<input type="checkbox"/> USDRUB_TOD	<input type="checkbox"/> EURRUB_TOD	<input type="checkbox"/> CNYRUB_TOD	<input type="checkbox"/> EURUSD_TOD			
<input type="checkbox"/> USDRUB_TOM	<input type="checkbox"/> EURRUB_TOM	<input type="checkbox"/> CNYRUB_TOM	<input type="checkbox"/> EURUSD_TOM			
<input type="checkbox"/> USDRUB_SPT	<input type="checkbox"/> EURRUB_SPT	<input type="checkbox"/> CNYRUB_SPT	<input type="checkbox"/> EURUSD_SPT			

* В случае проставления Участником клиринга отметки в поле «предоставить по всем кодам», с даты предоставления НКО НКЦ (АО) возможности заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой с новыми кодами, не указанными в настоящем заявлении, для указанных в настоящем заявлении пользовательских идентификаторов доступно заключение Внебиржевых сделок с иностранной валютой с новыми кодами.

(Должность Руководителя Участника клиринга
или лица, действующего по доверенности)

подпись

(Фамилия И.О.)

« ____ » _____ 20__ г.
М.П.

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-клиринговые счета 2-го уровня, в состав которых будут входить Расчетные коды 2-го уровня, связанные с Расчетными кодами Участника клиринга, для:

Участника клиринга/ клиента Участника клиринга

Расчетный код Участника клиринга	Количество открываемых Торгово-клиринговых счетов 2-го уровня	Идентификационные данные клиента*

Участника торгов

Расчетный код Участника клиринга	Количество открываемых Торгово-клиринговых счетов 2-го уровня	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. Запрос на открытие Торгового-клирингового счета 3-го уровня

(На бланке организации)

В НКО НКЦ (АО)

ЗАПРОС НА ОТКРЫТИЕ ТОРГОВО-КЛИРИНГОВОГО СЧЕТА 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 открыть Торгово-клиринговые счета 3-го уровня, в состав которых будут входить Расчетные коды 3-го уровня, связанные с Расчетными кодами 2-го уровня:

Расчетный код 2-го уровня	Количество открываемых Торгово-клиринговых счетов 3-го уровня	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.

2.4. 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 _____

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-клиринговые счета 3-го уровня, в состав которых будут входить Расчетные коды 3-го уровня, связанные с Расчетными кодами 2-го уровня:

Расчетный код 2-го уровня	Количество открываемых Торгово-клиринговых счетов 3-го уровня	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.

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!nTab12сTab12!сTabEFINORD
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!nTab12сTab12!сTabEFINORDDEL
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 – технологический идентификатор процедуры формирования отчета;
- 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: T - обычная сделка, S - сделка своп, N - Внебиржевая сделка с иностранной валютой	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
	OrderNo	Номер Предложения	Да	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	
	NettoSum	Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование	Да	Number	20	2
RECORDS		Блок данных по обязательствам				
	DataType	Тип обязательств: FX_OBLIG – по сделкам с наступившей датой исполнения; PR_NETTOSUM - Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование из предыдущего отчета;	Нет	Character	1-20	

		SETTL_OBLIG – по сделкам, заключаемым в целях урегулирования неисполненных обязательств (по сделкам урегулирования); FX_FEE - по уплате комиссионного вознаграждения; FX_VM – по уплате вариационной маржи; FX_DEBT – по уплате Задолженности; FX_PEN - штрафы, пени, неустойки				
	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		
	ReportType	Назначение отчета: CLEARING - для Участника клиринга, TRADE - для Участника торгов	Да	Character		
	ClearingFirmId	Идентификатор Участника клиринга (Идентификатор Участника торгов)	Да	Character	0-12	
	ClearingFirmName	Наименование Участника клиринга (Наименование Участника торгов)	Да	Character	0-120	
	ClearingFirmNameEN	Наименование Участника клиринга (английское) (Наименование Участника торгов (английское))	Нет	Character	0-120	
SETTLE1		Блок информации по Расчетному коду				
	ExtSettleCode	Расчетный код / 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	
TYPE		Блок данных по получателям комиссии	Да			
	ComType	«1» - Комиссионное вознаграждение за организацию торгов,	Да	Character	1	

		«2» - Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, «3» - Вознаграждение за предоставление ИТС				
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/ Расчетному коду 3-го уровня				
	ExtSettleCode	Расчетный код 2-го уровня/ Расчетный код 3-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, N - Внебиржевая сделка с иностранной валютой	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
	OrderNo	Номер Предложения	Да	Number	20	0
/RECORDS						
/CURRPAIR						
/SETTLE						
/SETTLEDATE						
/CCX14						
/MICEX_DOC						

Пример отчета CCX14:

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						

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	
	OTCTr	Признак, указывающий на возможность заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой («Y» - да, «N» - нет)	Нет	Character	1	
	DataChanged	Изменения («Y» - изменен, «N» - не изменен)	Да	Character	1	
OTCID		Блок данных о доступе к Внебиржевым сделкам				
	OTCId	Доступ к Внебиржевым сделкам (указывается список инструментов, например, EURUSD_SPT, GBPUSD_SPT, USDCNY_SPT, USDTRY TOM)	Нет	Character	200	
/OTCID						
/RECORDS						
/CCX19						
/MICEX_DOC						

Пример отчета CCX19:

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	Внебиржевые сделки с иностранной валютой	

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	
	BankAccModelType	Признак Расчетного кода, указывающий на модель использования Расчетного кода: 1 - Расчетный код Участника клиринга, совпадающего в одном лице с Участником торгов; 2 - Расчетный код для заключения сделок от имени и в интересах Участника клиринга; 3 - Расчетный код Клирингового брокера.	Да	Character	1	
	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	Нет	Character	1	

		доверительное управление				
	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 оборотной части комиссионного вознаграждения («Y» - да, «N» - нет)	Нет	Character	1	
	TaxPaymentAccLink	Соответствие Расчетному коду для списания оборотной части комиссионного вознаграждения	Нет	Character	5	
	SegrClientCode	Расчетного код Обособленного клиента («Y» - да, «N» - нет)	Нет	Character	1	
	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	Модель использования Расчетного кода	Признак Расчетного кода Единого пула	Тип Расчетного кода	Торгово-клиринговый счет	Расчетный код Обособленного клиента	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	
SETTLE12		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	
	ClearingFirmId	Идентификатор Участника клиринга	Нет	Character	0-12	
	ClearingFirmName	Наименование Участника клиринга	Нет	Character	0-120	
	Details	ИНН или № паспорта клиента Участника клиринга	Нет	Character	20	
	SubDetails	ИНН или № паспорта клиента субброкера	Нет	Character	20	
	ClientInfo	Признак, указывающий на раскрытие Участнику клиринга информации о клиентах Участника торгов («Y» - раскрывать, «N» - не раскрывать)	Нет	Character	1	
SETTLE23		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	
	ClearingFirmClient	Оказание услуг по ведению клиринговых регистров 3-го уровня Участнику клиринга («Y» - да, «N» - нет)	Нет	Character	1	
	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	
	OpenDate	Дата открытия Торгово-клирингового счета 3-го уровня	Нет	Date		
SETTLE3		Блок информации по Расчетному коду 3-го уровня (Участника клиринга)				
	ExtSettleCode	Расчетный код 3-го уровня	Нет	Character	0-25	
	TrdAccId	Код Торгово-клирингового счета 3-го уровня	Нет	Character	0-12	
	Details	ИНН или № паспорта клиента	Нет	Character	20	
	SubDetails	ИНН или № паспорта клиента субброкера	Нет	Character	20	
	OpenDate	Дата открытия Торгово-клирингового счета 3-го уровня	Нет	Date		
/SETTLE3						
/SETTLE23						

/SETTLE12						
/CCX20A						
/MICEX_DOC						

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:

Наименование Участника клиринга:

Расчетный код	Торгово-клиринговый счет			
Расчетный код 2-го уровня	Торгово-клиринговый счет 2-го уровня	Идентификационные данные клиента/ Идентификатор Участника торгов	Наименование Участника торгов	Оказание услуг по ведению клиринговых регистров 3-го уровня Участнику клиринга

Расчетный код 3-го уровня	Торгово-клиринговый счет 3-го уровня	Идентификационные данные клиента	Дата открытия Торгово- клирингового счета 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 торгов:
Наименование Участника торгов:

Расчетный код 2-го уровня	Торгово-клиринговый счет 2-го уровня	Идентификатор Участника клиринга	Наименование Участника клиринга	Оказание услуг по ведению клиринговых регистров 3-го уровня Участнику клиринга	Раскрытие Участнику клиринга информации о клиентах

Расчетный код 2-го уровня	Торгово-клиринговый счет 2-го уровня		
Расчетный код 3-го уровня	Торгово-клиринговый счет 3-го уровня	Идентификационные данные клиента	Дата открытия Торгово- клирингового счета 3-го уровня

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						

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, N - Внебиржевая сделка с иностранной валютой	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
	OrderNo	Номер Предложения	Да	Number	20	0
	/RECORDS					
	/CURRPAIR					
	/SETTLEDATE					
	/SETTLE					
	/CCX43					
	/MICEX_DOC					

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 CCX89:

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					

5.18. Отчет о сделках своп (CCX90)

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						
CCX90		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата, за которую сформирован отчет	Да	Date		
	ReportType	Назначение отчета: CLEARING - для Участника клиринга, TRADE - для Участника торгов	Да	Character		
	ClearingFirmId	Идентификатор Участника клиринга	Да	Character	0-12	
	ClearingFirmName	Наименование Участника клиринга	Да	Character	0-120	
SETTLE		Блок информации по Расчетному коду				
	ExtSettleCode	Расчетный код Участника клиринга	Да	Character	20	
RECORDS		Блок данных по сделке				
	TradeNo1	Номер 1ой части сделки своп	Да	Number	20	0
	TradeDate	Дата заключения сделки	Да	Date		
	TradeTime	Время заключения сделки	Да	Time		
	SecurityId	Идентификатор инструмента	Да	Character	12	
	SecShortName	Краткое наименование инструмента	Да	Character	10	
	BuySell	Направление сделки B – Покупка S – Продажа	Да	Character	1-01	
	CurrencyId	Идентификатор валюты лота	Да	Character	4	
	CurrencyName	Наименование валюты лота	Да	Character	30	
	Quantity	Объем в валюте лота	Да	Number	20	2

	Price	Курс	Да	Number	20	6
	Decimals	Число значимых знаков после запятой в курсе сделки (атрибут Price)	Да	Number		
	Value1	Объем в сопряженной валюте, руб.	Да	Number	20	2
	TradeNo2	Номер 2ой части сделки своп	Да	Number	20	0
	Value2	Сумма 2ой части сделки своп, руб.	Да	Number	20	2
	SwapRate	Своп-разница, руб.	Да	Number	20	2
	TradeNoSrc	Номер исходной сделки. Поле заполняется для сделок SWAP с перенесенной датой исполнения второй части.	Нет	Number	20	0
/RECORDS						
/SETTLE						
/CCX90						
/MICEX_DOC						

Пример отчета ССХ90:

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

ОТЧЕТ О СДЕЛКАХ СВОП

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

Номер 1ой части сделки своп	Дата заключения сделки	Время заключения сделки	Инструмент	Направление сделки	Наименование валюты лота	Объем в валюте лота	Курс	Объем в сопряженной валюте, руб.	Номер 2ой части сделки своп	Сумма 2ой части сделки своп, руб.	Своп-разница
Итого											

5.19. 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

5.20. Выписка из реестра Предложений (CCX122)

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						
CCX122		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата регистрации Предложений	Да	Date		
CLEARPART		Блок данных по Участнику клиринга				
	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	120	
SESSION		Блок данных по типу сессии				
	AddSession	Тип сессии	Да	Character	1	
	SessionName	Наименование сессии	Да	Character		
	SessionNameEN	Наименование сессии (английское)	Да	Character		
CURRPAIR		Блок данных валютной пары				
	CurrencyId	Идентификатор валюты лота	Да	Character	4	
	CurrencyName	Наименование валюты лота	Да	Character	30	
	CurrencyNameEN	Наименование валюты лота (английское)	Да	Character	30	
	CoCurrencyId	Идентификатор сопряженной валюты	Да	Character	4	

	CoCurrencyName	Наименование сопряженной валюты	Да	Character	30	
	CoCurrencyNameEN	Наименование сопряженной валюты (английское)	Да	Character	30	
SECURITY		Блок данных по Внебиржевой сделке				
	SecurityId	Идентификатор Внебиржевой сделки	Да	Character	12	
	SecShortName	Код Внебиржевой сделки	Да	Character	10	
	FaceValue	Котировка	Да	Number	20	6
SETTLEDATE		Блок данных по дате исполнения				
	SettleDate	Дата исполнения	Да	Date		
GROUP		Блок данных по виду Предложения				
	TradeGroup	Вид Предложения: N – Предложение на заключение Внебиржевой сделки с иностранной валютой (спот), W – Предложение на заключение Внебиржевой сделки своп/ своп контракта	Да	Character	1	
RECORDS		Блок данных по Предложению				
	OrderNo	Номер Предложения	Да	Number	20	0
	UserId	Идентификатор	Да	Character	0-12	
	ASP	АСП Участника клиринга	Да	Character	0-12	
	EntryTime	Время регистрации Предложения	Да	Time		
	BuySell	Направление Предложения: B – Покупка, S – Продажа;	Да	Character	1	
	OrderType	Тип Предложения	Да	Character	3	
	BasePrice	Базовый курс	Нет	Number	20	6
	Quantity	Всего объем в валюте лота, ед. Валюты	Да	Number	20	0
	Decimals	Число значимых знаков после запятой в предельной цене Предложения (атрибут Price)	Да	Number		
	Price	Предельная цена Предложения	Нет	Number	20	6
	Status	Статус	Да	Character	1	
	AmendTime	Время снятия Предложения	Нет	Time		
	Balance	Остаток Предложения	Да	Number	20	2
	CPFirmId	Контрагент	Нет	Character	0-12	
	TrdAccId	Торгово-клиринговый счет	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	
	BoardId	Идентификатор режима заключения сделки	Да	Character	4	
	BoardName	Наименование режима заключения сделки	Да	Character	30	
	BoardNameEN	Наименование режима заключения сделки (английское)	Нет	Character	30	
/RECORDS						
/GROUP						

/SETTLEDATE														
/SECURITY														
/CURRPAIR														
/SESSION														
/SETTLE														
/CLEARPART														
/CCX122														
/MICEX_DOC														

Пример отчета CCX122:

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

ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА ПРЕДЛОЖЕНИЙ

Дата регистрации Предложений: <дата>

Идентификатор Участника клиринга:
 Наименование Участника клиринга:
 <Расчетный код N>

Предложение:<Код Внебиржевой сделки>
 Дата исполнения:<Дата>

Валюта лота:<Наименование>

Сопряженная валюта:<Наименование>

Котировки за: ед. валюты лота

Номер Предложения	Идентификатор	АСП Участника клиринга	Время регистрации Предложения	Направление	Код режима заключения сделок	Тип Предложения	Объем в валюте лота ед. Валюты	Предельная цена Предложения	Статус	Время снятия	Остаток Предложения	Контрагент	ТКС	Краткий код Клиента

5.21. Выписка из реестра Внебиржевых сделок с иностранной валютой (CCX123)

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						
CCX123		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата заключения сделок	Да	Date		
CLEARPART		Блок данных по Участнику клиринга				
	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	120	
SESSION		Блок данных по типу сессии				
	AddSession	Тип сессии	Да	Character	1	
	SessionName	Наименование сессии	Да	Character		
	SessionNameEN	Наименование сессии (английское)	Да	Character		
CURRPAIR		Блок данных валютной пары				
	CurrencyId	Идентификатор валюты лота	Да	Character	4	
	CurrencyName	Наименование валюты лота	Да	Character	30	
	CurrencyNameEN	Наименование валюты лота (английское)	Да	Character	30	
	CoCurrencyId	Идентификатор сопряженной валюты	Да	Character	4	

	CoCurrencyName	Наименование сопряженной валюты	Да	Character	30	
	CoCurrencyNameEN	Наименование сопряженной валюты (английское)	Да	Character	30	
SECURITY		Блок данных по Внебиржевой сделке				
	SecurityId	Идентификатор Внебиржевой сделки	Да	Character	12	
	SecShortName	Код Внебиржевой сделки	Да	Character	10	
	FaceValue	Котировка	Да	Number	20	6
SETTLEDATE		Блок данных по дате исполнения				
	SettleDate	Дата исполнения	Да	Date		
GROUP		Блок данных по виду Предложения				
	TradeGroup	Вид Предложения: N – Внебиржевая сделка с иностранной валютой (спот), W – внебиржевая сделка своп/ своп контракт	Да	Character	1	
RECORDS		Блок данных по Предложению				
	TradeNo	Номер сделки	Да	Number	20	0
	BuySell	Направление сделки: B – Покупка, S – Продажа;	Да	Character	1	
	OrderNo	Номер Предложения	Да	Number	20	0
	TradeDeriv	Сделка с ПФИ: Y – Да; N – Нет;	Да	Character	1	
	TradeTime	Время заключения сделки	Да	Time		
	TradeType	Тип сделки: N - внебиржевая	Да	Character	1	
	Decimals	Число значимых знаков после запятой в курсе сделки (атрибут Price)	Да	Number		
	Price	Курс сделки	Да	Number	20	6
	Quantity	Объем в валюте лота, ед. валюты	Да	Number	20	0
	Value	Объем в сопряженной валюте, ед. валюты	Да	Number	20	2
	CPFirmId	Контрагент	Нет	Character	0-12	
	Period	Период: O – период открытия; N – нормальный период; C – период закрытия;	Да	Character	1	
	SettleCode	Код расчетов	Да	Character	12	
	UserId	Идентификатор	Да	Character	0-12	
	BrokerRef	Примечание, дополнительная справочная информация	Нет	Character	20	
	ExtRef	Поле-примечание, используется для обратной связи с внешними системами	Нет	Character	12	
	ClrComm	Коммиссионное вознаграждение за клиринговое обслуживание, руб.	Нет	Number	20	2
	TrdAccId	Торгово-клиринговый счет	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	
	RepoTradeNo	Номер витринной сделки своп / своп контракта	Нет	Number	20	0

	BoardId	Идентификатор режима заключения сделки	Да	Character	4	
	BoardName	Наименование режима заключения сделки	Да	Character	30	
	BoardNameEN	Наименование режима заключения сделки (английское)	Нет	Character	30	
/RECORDS						
/GROUP						
/SETTLEDATE						
/SECURITY						
/CURRPAIR						
/SESSION						
/SETTLE						
/CLEARPART						
/CCX123						
/MICEX_DOC						

Пример отчета CCX123:

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

ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА ВНЕБИРЖЕВЫХ СДЕЛОК С ИНОСТРАННОЙ ВАЛЮТОЙ

Дата заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой: <Дата>

Идентификатор Участника клиринга:

Наименование Участника клиринга:

<Расчетный код N>

Сделка:<Код Внебиржевой сделки>

Валюта лота:<Наименование>

Дата исполнения:<Дата>

Сопряженная валюта:<Наименование>

Котировка за: ед. валюты лота

Номер сделки	Время заключения сделки	Код режима заключения сделок	Направление	Курс сделки	Объем в валюте лота, ед. валюты	Объем в сопряженной валюте, ед. валюты	Номер Предложения	Сделка с ПФИ	Контрагент	Комиссионное вознаграждение. за клиринговое обслуживание, руб.	ТКС	Краткий код Клиента

Итого покупка:

Итого продажа:

5.22. Выписка из реестра незарегистрированных Предложений (CCX124)

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						
CCX124		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата регистрации Предложений	Да	Date		
CLEARPART		Блок данных по Участнику клиринга				
	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	
RECORDS		Блок данных по незарегистрированным Предложениям				
	RecNo	Номер по порядку	Да	Number	20	
	TransNo	Номер Предложения	Да	Number	20	
	EntryTime	Время фиксации Предложения в системе	Да	Time		
	Status	Статус Предложения: Y – зарегистрировано; N – не зарегистрировано	Да	Character	1	
	MisType	Причина отказа в регистрации Предложения в торговой системе	Нет	Character	256	
	MisTypeEN	Причина отказа в регистрации Предложения в торговой системе (английское)	Нет	Character	256	
/RECORDS						
/CLEARPART						

/CCX124						
/MICEX_DOC						

Пример отчета ССХ124:

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

ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА НЕЗАРЕГИСТРИРОВАННЫХ ПРЕДЛОЖЕНИЙ

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

№	Номер Предложения	Время	Статус	Причина отказа в регистрации

5.23. Выписка из реестра Аукционов RFS (CCX125)

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						
CCX125		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата проведения аукционов RFS	Да	Date		
CLEARPART		Блок данных по Участнику клиринга				
	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	
SECURITY		Блок данных по Внебиржевой сделке				
	SecurityId	Идентификатор Внебиржевой сделки, для заключения которой проводится аукцион	Да	Character	12	
	SecShortName	Код Внебиржевой сделки	Да	Character	10	
	FaceValue	Котировка	Да	Number	20	6
	CurrencyId	Идентификатор валюты лота	Да	Character	4	
	CoCurrencyId	Идентификатор сопряженной валюты	Да	Character	4	
AUCTION		Блок информации по аукциону RFS				
	AuctionNo	Номер аукциона	Да	Number	20	
	StartTime	Время начала аукциона	Да	Time		
	EndTime	Время окончания аукциона	Да	Time		
	Quantity	Объем аукциона в валюте лота	Да	Number	20	
	BestBid	Цена на покупку	Нет	Number	20	6

	BestOffer	Цена на продажу	Нет	Number	20	6
	TranConcl	Признак, указывающий на заключение Внебиржевой сделки/ Внебиржевых сделок (Y – сделка заключена; N – сделка не заключена)	Да	Character	1	
	Comment	Комментарий	Нет	Character	20	
	TradeNo	Номер сделки	Нет	Number	20	0
	BuySell	Направление сделки: B – Покупка, S – Продажа;	Нет	Character	1	
	Price	Курс сделки	Нет	Number	20	6
	Value	Объем в сопряженной валюте, ед. валюты	Нет	Number	20	2
	UCPFirmId	Идентификатор конечного контрагента	Нет	Character	0-12	
	UCPName	Наименование конечного контрагента	Нет	Character	0-120	
	AnonymCode	Анонимный код потребителя	Нет	Character	0-12	
	/AUCTION					
	/SECURITY					
	/CLEARPART					
	/CCX125					
	/MICEX_DOC					

Пример отчета CCX125:

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

ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА АУКЦИОНОВ RFS

Идентификатор Участника клиринга:
Наименование Участника клиринга:

Идентификатор Внебиржевой сделки: <Код Внебиржевой сделки>

Котировка за: ед.валюты лота

Номер Аукциона	Время начала Аукциона	Время окончания Аукциона	Объем аукциона в валюте лота	Цена поставщика на покупку	Цена поставщика на продажу	Заключение Внебиржевой сделки	Номер сделки	Направление сделки	Курс сделки	Объем в сопряженной валюте	Контрагент	Анонимный код потребителя	Комментарий