

Приложение 4

УТВЕРЖДЕНЫ

приказом НКО НКЦ (АО)

от «01» декабря 2021 года

№ 01-01/325

**ФОРМЫ И ФОРМАТЫ ДОКУМЕНТОВ И ОТЧЕТОВ
НА СРОЧНОМ РЫНКЕ.
ЧАСТЬ IV**

г. Москва
2021 г.

СОДЕРЖАНИЕ

| | |
|--|----------|
| 1. Общие положения..... | 5 |
| 2. Формы (форматы) документов, предоставляемых Участниками клиринга, Доверенными владельцами счетов в бумажном виде или в виде документа ЭДО..... | 6 |
| 2.1. Заявление на открытие Брокерской фирмы | 6 |
| 2.2. Заявление на открытие Брокерской фирмы (для Участника торгов) | 7 |
| 2.3. Заявление на открытие Обособленной Брокерской фирмы | 8 |
| 2.4. Заявление на изменение типа Брокерской фирмы..... | 10 |
| 2.5. Заявление на закрепление Доверенного владельца счетов..... | 11 |
| 2.6. Запрос на возврат обеспечения в российских рублях Обособленной Брокерской фирмы..... | 12 |
| 2.7. Запрос на регистрацию реквизитов Счета для возврата обеспечения Обособленной Брокерской фирме | 13 |
| 2.8. Запрос на изменение регистрации реквизитов Счета для возврата обеспечения Обособленной Брокерской фирме | 14 |
| 2.9. Запрос на аннулирование регистрации реквизитов Счета для возврата обеспечения Обособленной Брокерской фирме | 15 |
| 2.10. Письмо для уточнения назначения платежа | 16 |
| 2.11. Запрос на регистрацию реквизитов Счета для возврата обеспечения в иностранной валюте Обособленной Брокерской фирме..... | 17 |
| 2.12. Запрос на возврат обеспечения в иностранной валюте Обособленной Брокерской фирме | 18 |
| 2.13. Запрос на аннулирование регистрации реквизитов Счета для возврата обеспечения в иностранной валюте Обособленной Брокерской фирме..... | 19 |
| 2.14. Запрос на изменение регистрации реквизитов Счета для возврата обеспечения в иностранной валюте Обособленной Брокерской фирме..... | 20 |
| 2.15. Заявление на формирование отчетов по разделу клиринговых регистров | 21 |
| 2.16. Заявление на закрытие разделов клиринговых регистров | 22 |
| 2.17. Запрос на предоставление отчетов..... | 23 |
| 2.18. Уведомление об изменении указанных сведений по разделу клиринговых регистров..... | 24 |
| 2.19. Заявление на получение статуса Доверенного владельца счетов | 25 |
| 2.20. Заявление на аннулирование статуса Доверенного владельца счетов | 26 |
| 2.21. Заявление от Базового Участника клиринга на перевод позиций и Обеспечения | 27 |
| 2.22. Заявление на перевод позиций и Обеспечения | 28 |
| 2.23. Заявление об отзыве | 29 |
| 2.24. Согласие на прием | 30 |
| 2.25. Заявление на регистрацию Торгово-клирингового счета для поставки (на фондовом рынке)..... | 31 |
| 2.26. Заявление о соответствии Торгово-клирингового счета для поставки Брокерской фирме (на фондовом рынке) | 32 |
| 2.27. Заявление о соответствии Торгово-клирингового счета для поставки разделу регистра учета позиций (на фондовом рынке) | 34 |
| 2.28. Уведомление продавца о намерении поставки (на спот-рынке АО НТБ) | 36 |
| 2.29. Заявление на регистрацию Торгово-клирингового счета для поставки (на валютном рынке и рынке драгоценных металлов) | 37 |

| | |
|--|-----------|
| 2.30. Заявление о соответствии Торгово-клирингового счета для поставки Брокерской фирме (на валютном рынке и рынке драгоценных металлов)..... | 38 |
| 2.31. Заявление о соответствии Торгово-клирингового счета для поставки разделу регистра учета позиций (на валютном рынке и рынке драгоценных металлов) | 40 |
| 2.32. Заявление об открытии Расчетного кода для Брокерской фирмы | 42 |
| 2.33. Заявление о соответствии Брокерской фирмы Расчетному коду..... | 43 |
| 2.34. Заявление на установление параметров учета рисков исполнения опционных контрактов..... | 44 |
| 2.35. Заявление о выборе параметров Брокерской фирмы | 45 |
| 2.36. Поручение на установление ограничения на открытие позиций / ограничения на объявление заявок | 46 |
| 3. Форматы отчетов в форме электронных документов, предоставляемые Участникам клиринга, Участникам торгов, Доверенным владельцам счетов, Клиентам Участников клиринга | 47 |
| 3.1. Отчет о заключенных Сделках | 48 |
| 3.2. Отчет о заключенных опционных контрактах..... | 52 |
| 3.3. Отчет об итогах Торгов Инструментами и Связками | 55 |
| 3.4. Отчет об итогах Торгов опционными контрактами | 59 |
| 3.5. Отчет об обязательствах по Сделкам..... | 61 |
| 3.6. Отчет об обязательствах по опционным контрактам..... | 63 |
| 3.7. Отчет о денежных средствах в рублях и иностранной валюте, являющихся Обеспечением | 65 |
| 3.8. Предварительный отчет о денежных средствах в рублях РФ и иностранной валюте, являющихся Обеспечением..... | 68 |
| 3.9. Отчет об операциях по разделам денежного регистра обеспечения | 71 |
| 3.10. Отчет об операциях с иностранной валютой, учитываемой в качестве Обеспечения | 73 |
| 3.11. Отчет о разделах клиринговых регистров..... | 75 |
| 3.12. Отчет о разделах клиринговых регистров, имеющих признак «Индивидуальный Инвестиционный Счет» | 78 |
| 3.13. Отчет о сборах за транзакции | 79 |
| 3.14. Отчет о сборах за неэффективные транзакции | 80 |
| 3.15. Отчет детализированный о сборах за неэффективные транзакции | 81 |
| 3.16. Отчет о сборах за неэффективные транзакции, подлежащих списанию | 82 |
| 3.17. Отчет о сборах за ошибочные транзакции, отличных от ошибок Flood Control, по каждому клиентскому логину (идентификатору), подлежащих списанию | 83 |
| 3.18. Отчет о количестве ошибочных транзакций, отличных от ошибок Flood Control, по каждому клиентскому логину (идентификатору) | 84 |
| 3.19. Отчет о сборах за ошибочные транзакции, отличных от ошибок Flood Control, по каждому клиентскому логину (идентификатору)..... | 85 |
| 3.20. Отчет о сборах за ошибочные транзакции Flood Control, по каждому клиентскому логину (идентификатору), подлежащих списанию | 86 |
| 3.21. Отчет о сборах за ошибочные транзакции Flood Control, по каждому клиентскому логину (идентификатору) | 87 |
| 3.22. Отчет о заключенных Связках..... | 88 |
| 3.23. Информация о Сделках, составляющих Связку | 91 |
| 3.24. Отчет об иностранной валюте, предоставленных в качестве Обеспечения | 92 |
| 3.25. Отчет о позициях по инструментам..... | 94 |
| 3.26. Отчет о соответствии Торгово-клирингового счета Участнику клиринга/ Брокерской фирме/ разделу регистра учета позиций | 96 |

| | |
|---|-----|
| 3.27. Отчет об установлении параметров ограничения на открытие позиций/ограничения на объявления заявок | 98 |
| 3.28. Сводная финансовая ведомость | 100 |
| 3.29. Отчет об обязательствах по поставочным фьючерсным контрактам на облигации.. | 103 |
| | 103 |

1. Общие положения

Настоящий документ «Формы и форматы документов и отчетов на срочном рынке. Часть IV» (далее – Формы и форматы документов и отчетов на срочном 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, Доверенными владельцами счетов и иными лицами 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.

Предоставление документов в Клиринговый центр в соответствии с Формами и форматами документов и отчетов на срочном рынке посредством Подсистемы ЭДО НКЦ (Универсального Файлового шлюза) осуществляется в формате электронного документа Microsoft Word, Excel, подписанного электронно-цифровой подписью отправителя, если иное явно не установлено Формами и форматами документов и отчетов на срочном рынке.

Термины, используемые в настоящих Формах и форматах документов и отчетов на срочном рынке, используются в значениях, определенных Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) и Правилами организованных торгов на Срочном рынке ПАО Московская Биржа.

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

2.1. **Заявление на открытие Брокерской фирмы**

В НКО НКЦ (АО)

ЗАЯВЛЕНИЕ НА ОТКРЫТИЕ БРОКЕРСКОЙ ФИРМЫ

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга: ИНН Участника клиринга: _____,

Настоящим просим открыть Брокерскую фирму с кодом раздела клиринговых регистров № ХХУУ000:

Тип (отметить нужное):

- Собственная Брокерская фирма (для Участника клиринга)**
 Клиентская Брокерская фирма (для клиента Участника клиринга):

Тип (отметить нужное):

_____ **ИНН** _____
(клиент Участника клиринга, являющийся брокером)

_____ **ИНН** _____
(клиент Участника клиринга, являющийся ДУ)

_____ **#** _____¹
(клиент-иностранное юридическое лицо Участника клиринга, являющийся брокером)²

- Клиентская Брокерская фирма**
 Брокерская фирма ДУ (для Участника клиринга)

Плату за формирование отчетов по разделу клиринговых регистров просим удерживать с внесенных на раздел денежного регистра обеспечения № ХХУУZZZ денежных средств Обеспечения.

Связать Брокерскую фирму:

- с Расчетным кодом _____
 с новым Расчетным кодом (открыть новый Расчетный код)

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

¹ **Порядок заполнения:** Указывается код, состоящий из символа «#», без пробела далее 3х-значный цифровой код страны иностранного юридического лица, соответствующий Общероссийскому классификатору стран мира, пробел, символ “U” для иностранного юридического лица, пробел и код иностранного юридического лица, присвоенный Участником клиринга.

² Клиент-иностранное юридическое лицо, учрежденное в одном из государств, указанных в п.п.1,2 п.2 ст.51.1 Федерального закона от 22.04.1996 № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг» и имеющий право в соответствии с личным законом осуществлять брокерскую деятельность.

2.2. Заявление на открытие Брокерской фирмы (для Участника торгов)

В НКО НКЦ (АО)

**ЗАЯВЛЕНИЕ НА ОТКРЫТИЕ БРОКЕРСКОЙ ФИРМЫ
(ДЛЯ УЧАСТНИКА ТОРГОВ)**

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

ИНН (или код, заменяющий ИНН) Участника клиринга: _____,

Настоящим просим открыть Брокерскую фирму с кодом раздела клиринговых регистров № ХХУУ000 для:

- Участника торгов, который вправе подавать заявки на заключение Срочных контрактов от имени и в интересах Участника клиринга
- Участника торгов, в заявках на заключение Срочных контрактов которого Участник клиринга будет указан в качестве Клирингового брокера

| Идентификатор Участника торгов | Наименование Участника торгов | ИНН Участника торгов |
|-----------------------------------|----------------------------------|-------------------------|
| | | |

Тип (отметить нужное):

- Собственная Брокерская фирма**
- Клиентская Брокерская фирма**
- Брокерская фирма ДУ (для Участника клиринга)**

Плату за формирование отчетов по разделу клиринговых регистров просим удерживать с внесенных на раздел денежного регистра обеспечения № ХХУУZZZ денежных средств Обеспечения.

Связать Брокерскую фирму:

- с Расчетным кодом _____
- с новым Расчетным кодом (открыть новый Расчетный код)

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

2.3. Заявление на открытие Обособленной Брокерской фирмы

В НКО НКЦ (АО)

ЗАЯВЛЕНИЕ¹ НА ОТКРЫТИЕ ОБОСОБЛЕННОЙ БРОКЕРСКОЙ ФИРМЫ

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

| | |
|--|--|
| | |
|--|--|

(наименование Доверенного владельца счетов)

Настоящим просим открыть Обособленную Брокерскую фирму с кодом раздела клиринговых регистров № ХХУУ000 (отметить нужное):

- для _____ ИНН _____
(клиент Участника клиринга, являющийся брокером)
- для _____ # _____²
(клиент-иностранное юридическое лицо Участника клиринга, являющийся брокером)
- для _____ ИНН _____
(клиент Участника клиринга, являющийся ДУ)
- Клиентская Брокерская фирма
- Брокерская фирма ДУ (для Участника клиринга)

Плату за формирование отчетов по Обособленной Брокерской фирме просим удерживать с внесенных на раздел денежного регистра обеспечения № ХХУУZZZ денежных средств Обеспечения.

Связать Брокерскую фирму с новым Расчетным кодом (открыть новый Расчетный код).

Закрепить за данной Обособленной Брокерской фирмой следующего Доверенного владельца счетов: _____

(наименование Доверенного владельца счетов, ИНН (или код, заменяющий ИНН))

От имени Участника клиринга:

_____/_____/_____

М.П.

От имени Доверенного владельца счетов:

_____/_____/_____

М.П.

¹ **Порядок оформления:** Заявление должно быть предоставлено в соответствии с Правилами клиринга Клирингового центра.

² **Порядок заполнения:** Указывается код, состоящий из символа «#», далее без пробела 3х-значный цифровой код страны иностранного юридического лица, соответствующий Общероссийскому классификатору стран мира, пробел, символ “U” для иностранного юридического лица, пробел и код иностранного юридического лица, присвоенный Участником клиринга.

Клиент-иностранное юридическое лицо – это юридическое лицо, учрежденное в одном из государств, указанных в п.п.1,2 п.2 ст.51.1 Федерального закона от 22.04.1996 № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг», и имеющее право в соответствии с личным законом осуществлять брокерскую деятельность.

«____» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)
Контактный телефон: _____

«____» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)
Контактный телефон: _____

2.4. Заявление на изменение типа Брокерской фирмы

В НКО НКЦ (АО)

ЗАЯВЛЕНИЕ НА ИЗМЕНЕНИЕ ТИПА БРОКЕРСКОЙ ФИРМЫ

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

(наименование Доверенного владельца счетов)

Настоящим просим изменить тип Брокерской фирмы с кодом (кодами) раздела клиринговых регистров № XXYY000 на следующий тип (отметить нужное):

- Клиентская Брокерская фирмы**
- Брокерская фирма ДУ (для Участника клиринга)**
- Обособленная Брокерская фирма**

Закрепить за данной Обособленной Брокерской фирмой следующего Доверенного владельца счетов:

(наименование Доверенного владельца счетов, ИНН (или код заменяющий, ИНН))

От имени Участника клиринга:

_____/_____/_____
М.П.

«___» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)
Контактный телефон: _____

От имени Доверенного владельца счетов:

_____/_____/_____
М.П.

«___» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)
Контактный телефон: _____

2.5. Заявление на закрепление Доверенного владельца счетов

В НКО НКЦ (АО)

ЗАЯВЛЕНИЕ НА ЗАКРЕПЛЕНИЕ ДОВЕРЕННОГО ВЛАДЕЛЬЦА СЧЕТОВ

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

Настоящим просим закрепить за Обособленной Брокерской фирмой с кодом раздела клиринговых регистров № ХХУУ000 следующего Доверенного владельца счетов:

(наименование Доверенного владельца счетов, ИНН (или код, заменяющий ИНН))

От имени Участника клиринга:

_____/_____/_____
М.П.

« ____ » _____ 20 ____ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)
Контактный телефон: _____

От имени Доверенного владельца счетов¹:

_____/_____/_____
М.П.

« ____ » _____ 20 ____ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)
Контактный телефон: _____

¹ Заявление подписывается указанным в заявлении Доверенным владельцем счетов.

2.6. Запрос на возврат обеспечения в российских рублях Обособленной Брокерской фирмы

В НКО НКЦ (АО)

**ЗАПРОС НА ВОЗВРАТ ОБЕСПЕЧЕНИЯ В РОССИЙСКИХ РУБЛЯХ
ОБОСОБЛЕННОЙ БРОКЕРСКОЙ ФИРМЫ**

(наименование Участника клиринга и/или Доверенного владельца счетов)

Идентификатор Участника клиринга:

Просим вернуть свободные денежные средства Обеспечения Обособленной Брокерской фирмы с кодом раздела клиринговых регистров № ХХУУ000:

| Код раздела | Сумма ¹ , рублей |
|---------------|-----------------------------|
| ХХУУZZZ | |
| ХХУУZZZ | |
| ИТОГО: | |

по следующим реквизитам² (**отметить нужное**):

- Участника клиринга³
 Доверенного владельца счетов⁴

(наименование получателя - Участник клиринга/Доверенный владелец счетов)

ИНН/КИО _____ р/с _____

В _____
 (наименование банка)

к/с _____ БИК _____

От имени Участника клиринга:

_____/_____/_____
 М.П.

«___» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

От имени Доверенного владельца счетов:

_____/_____/_____
 М.П.

«___» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

¹ Сумма указывается слитно и без пробелов, копейки отделяются запятой или точкой.

² Реквизиты должны быть зарегистрированы в Клиринговом центре. Для этого необходимо предоставить Запрос на регистрацию реквизитов Счета для возврата обеспечения Обособленной Брокерской фирмы.

³ В случае возврата денежных средств на реквизиты Участника клиринга запрос подписывает 2 стороны: Участник клиринга и Доверенный владелец счетов.

⁴ В случае возврата денежных средств на реквизиты Доверенного владельца счетов запрос подписывает 1 сторона: Доверенный владелец счетов.

2.7. Запрос на регистрацию реквизитов Счета для возврата обеспечения Обособленной Брокерской фирме

В НКО НКЦ (АО)

**ЗАПРОС НА РЕГИСТРАЦИЮ РЕКВИЗИТОВ СЧЕТА ДЛЯ ВОЗВРАТА
ОБЕСПЕЧЕНИЯ ОБОСОБЛЕННОЙ БРОКЕРСКОЙ ФИРМЕ**

(наименование Участника клиринга и/или Доверенного владельца счетов)

Идентификатор Участника клиринга:

Прошу зарегистрировать следующие реквизиты банковского счета для возврата денежных средств Обеспечения в российских рублях Обособленной Брокерской фирме ХХУУ000:

| | |
|--------------------------------------|--|
| Наименование банка получателя | |
| Расчетный счет | |
| Корреспондентский счет | |
| БИК | |
| Наименование получателя ¹ | |
| ИНН/КИО получателя | |

Подача Запроса о возврате обеспечения Участником клиринга:

- возможна
 невозможна

От имени Участника клиринга:

_____/_____/_____
М.П.

«__» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

От имени Доверенного владельца счетов:

_____/_____/_____
М.П.

«__» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

¹ В случае если Получателем (владельцем счета) является Участник клиринга, запрос подписывают 2 стороны: Участник клиринга и Доверенный владелец счетов.

В случае если Получателем (владельцем счета) является Доверенный владелец счетов, запрос подписывает 1 сторона: Доверенный владелец счетов.

2.8. Запрос на изменение регистрации реквизитов Счета для возврата обеспечения Обособленной Брокерской фирме

В НКО НКЦ (АО)

ЗАПРОС НА ИЗМЕНЕНИЕ РЕГИСТРАЦИИ РЕКВИЗИТОВ СЧЕТА ДЛЯ ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ ОБОСОБЛЕННОЙ БРОКЕРСКОЙ ФИРМЕ

(наименование Участника клиринга и/или Доверенного владельца счетов)

Идентификатор Участника клиринга:

Прошу внести изменения в ранее зарегистрированные реквизиты банковского счета для возврата денежных средств Обеспечения в российских рублях Обособленной Брокерской фирме ХХУУ000:

| | |
|--------------------------------------|--|
| Наименование банка получателя | |
| Расчетный счет | |
| Корреспондентский счет | |
| БИК | |
| Наименование получателя ¹ | |
| ИНН/КИО получателя | |

От имени Участника клиринга:

М.П.

«__» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

От имени Доверенного владельца счетов:

М.П.

«__» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

¹ В случае если Получателем (владельцем счета) является Участник клиринга, запрос подписывают 2 стороны: Участник клиринга и Доверенный владелец счетов.

В случае если Получателем (владельцем счета) является Доверенный владелец счетов, запрос подписывает 1 сторона: Доверенный владелец счетов.

2.9. Запрос на аннулирование регистрации реквизитов Счета для возврата обеспечения Обособленной Брокерской фирме

В НКО НКЦ (АО)

ЗАПРОС НА АННУЛИРОВАНИЕ РЕГИСТРАЦИИ РЕКВИЗИТОВ СЧЕТА ДЛЯ ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ ОБОСОБЛЕННОЙ БРОКЕРСКОЙ ФИРМЕ

(наименование Участника клиринга и/или Доверенного владельца счетов)

Идентификатор Участника клиринга:

Прошу аннулировать регистрацию ранее зарегистрированных реквизитов банковского счета для возврата денежных средств Обеспечения в российских рублях Обособленной Брокерской фирме ХХУУ000:

| | |
|--------------------------------------|--|
| Наименование банка получателя | |
| Расчетный счет | |
| Корреспондентский счет | |
| БИК | |
| Наименование получателя ¹ | |
| ИНН/КИО получателя | |

От имени Участника клиринга:

_____/_____/

М.П.

«__» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

От имени Доверенного владельца счетов:

_____/_____/

М.П.

«__» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

¹ В случае если Получателем (владельцем счета) является Участник клиринга, запрос подписывают 2 стороны: Участник клиринга и Доверенный владелец счетов.

В случае если Получателем (владельцем счета) является Доверенный владелец счетов, запрос подписывает 1 сторона: Доверенный владелец счетов.

2.10. Письмо для уточнения назначения платежа

В НКО НКЦ (АО)

ПИСЬМО

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

| | |
|--|--|
| | |
|--|--|

В связи с неточным указанием назначения платежа в платежном поручении:

№ _____ от «___» _____ 20__ г.

на сумму: _____ (_____) руб. ____ коп.

наименование/ФИО Плательщика: _____

р/с Плательщика: _____

просим считать верным следующее назначение платежа:

«Перечисление Обеспечения по Договору N ДКУ/_____/__ от __.__.20__. Код раздела клирингового регистра **XXYYZZZ**. НДС не облагается»

Руководитель _____

Гл. бухгалтер _____

Дата «___» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

2.11. Запрос на регистрацию реквизитов Счета для возврата обеспечения в иностранной валюте Обособленной Брокерской фирме

В НКО НКЦ (АО)

**ЗАПРОС НА РЕГИСТРАЦИЮ РЕКВИЗИТОВ СЧЕТА ДЛЯ ВОЗВРАТА
ОБЕСПЕЧЕНИЯ В ИНОСТРАННОЙ ВАЛЮТЕ ОБОСОБЛЕННОЙ
БРОКЕРСКОЙ ФИРМЕ**

(наименование Участника клиринга и/или Доверенного владельца счетов)

Идентификатор Участника клиринга:

Прошу зарегистрировать следующие реквизиты банковского счета¹ для возврата денежных средств Обеспечения в иностранной валюте Обособленной Брокерской фирме № ХХУУ000 (отметить нужное):

- на счет Участника клиринга, раздел № ХХУУZZZ
- на счет Доверенного владельца счетов, раздел № ХХУУZZZ

| | | | | |
|--|-----------------|--------------------------|-----------|--------------------------|
| Валюта вывода (отметить нужное) | доллар США, USD | <input type="checkbox"/> | евро, EUR | <input type="checkbox"/> |
| Наименование банка-корреспондента (57D) | | | | |
| Номер счета бенефициара в банке-корреспонденте (58A)* | | | | |
| Номер счета банка-корреспондента в банке-посреднике (57A)* | | | | |
| Свифт-код банка-корреспондента (57A)* | | | | |
| Свифт-код банка-посредника (56A)* | | | | |
| Наименование бенефициара (58D) ² | | | | |
| Свифт-код бенефициара (58A) ³ | | | | |

Подача Запроса о возврате обеспечения Участником клиринга:

- возможна
- невозможна

От имени Участника клиринга:

От имени Доверенного владельца счетов:

_____/_____/_____
М.П.

_____/_____/_____
М.П.

«__» _____ 20__ г.

«__» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)
Контактный телефон: _____

Контактное лицо: _____ (ФИО)
Контактный телефон: _____

* Заполняется без пробелов

¹ Все реквизиты заполняются на английском языке

² В случае если Получателем (владельцем счета) является Участник клиринга, запрос подписывают 2 стороны: Участник клиринга и Доверенный владелец счетов.

В случае если Получателем (владельцем счета) является Доверенный владелец счетов, запрос подписывает 1 сторона: Доверенный владелец счетов.

Поле заполняется с указанием через пробел адреса местонахождения.

³ Заполняется в случае, если получатель является банком.

2.12. Запрос на возврат обеспечения в иностранной валюте Обособленной Брокерской фирме

В НКО НКЦ (АО)

**ЗАПРОС НА ВОЗВРАТ ОБЕСПЕЧЕНИЯ В ИНОСТРАННОЙ ВАЛЮТЕ
ОБОСОБЛЕННОЙ БРОКЕРСКОЙ ФИРМЕ**

(наименование Участника клиринга и/или Доверенного владельца счетов)

Идентификатор Участника клиринга:

Прошу вернуть свободные денежные средства Обеспечения в иностранной валюте Обособленной Брокерской фирме № ХХУУ000 (отметить нужное):

Доллары США Евро

| Код раздела | Сумма |
|---------------|-------|
| ХХУУZZZ | |
| ИТОГО: | |

на счет Участника клиринга
 на счет Доверенного владельца счетов

по следующим реквизитам¹:

(наименование и адрес местонахождения бенефициара на английском языке)

номер счета бенефициара _____

в _____
(наименование банка-корреспондента на английском языке)

Свифт-код банка-корреспондента _____

номер счета банка-корреспондента в банке-посреднике _____

Свифт-код банка-посредника _____

От имени Участника клиринга:

От имени Доверенного владельца счетов:

_____/_____/_____
М.П.

_____/_____/_____
М.П.

«__» _____ 20__ г.

«__» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

Контактный телефон: _____

¹ Реквизиты должны быть зарегистрированы в Клиринговом центре. Для этого необходимо по системе ЭДО направить Запрос на регистрацию реквизитов Счета для возврата обеспечения в иностранной валюте Обособленной Брокерской фирме.

В случае если Получателем (владельцем счета) является Участник клиринга, запрос подписывают 2 стороны: Участник клиринга и Доверенный владелец счетов.

В случае если Получателем (владельцем счета) является Доверенный владелец счетов, запрос подписывает 1 сторона: Доверенный владелец счетов.

2.13. Запрос на аннулирование регистрации реквизитов Счета для возврата обеспечения в иностранной валюте Обособленной Брокерской фирме

В НКО НКЦ (АО)

ЗАПРОС НА АННУЛИРОВАНИЕ РЕГИСТРАЦИИ РЕКВИЗИТОВ СЧЕТА ДЛЯ ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ В ИНОСТРАННОЙ ВАЛЮТЕ ОБОСОБЛЕННОЙ БРОКЕРСКОЙ ФИРМЕ

(наименование Участника клиринга и/или Доверенного владельца счетов)

Идентификатор Участника клиринга:

Прошу аннулировать регистрацию ранее зарегистрированных реквизитов банковского счета¹ для возврата денежных средств Обеспечения в иностранной валюте Обособленной Брокерской фирме № ХХУУ000 (отметить нужное):

- на счет Участника клиринга, раздел № ХХУУZZZ
- на счет Доверенного владельца счетов, раздел № ХХУУZZZ

| | | | | |
|--|-----------------|--------------------------|-----------|--------------------------|
| Валюта вывода (отметить нужное) | доллар США, USD | <input type="checkbox"/> | евро, EUR | <input type="checkbox"/> |
| Наименование банка-корреспондента (57D) | | | | |
| Номер счета бенефициара в банке-корреспонденте (58A)* | | | | |
| Номер счета банка-корреспондента в банке-посреднике (57A)* | | | | |
| Свифт-код банка-корреспондента (57A)* | | | | |
| Свифт-код банка-посредника (56A)* | | | | |
| Наименование бенефициара (58D) ² | | | | |
| Свифт-код бенефициара (58A) ³ | | | | |

От имени Участника клиринга:

_____/_____/_____
М.П.

«__» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

От имени Доверенного владельца счетов:

_____/_____/_____
М.П.

«__» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

* Заполняется без пробелов

¹ Все реквизиты заполняются на английском языке

² В случае если Получателем (владельцем счета) является Участник клиринга, запрос подписывают 2 стороны: Участник клиринга и Доверенный владелец счетов.

В случае если Получателем (владельцем счета) является Доверенный владелец счетов, запрос подписывает 1 сторона: Доверенный владелец счетов.

Поле заполняется с указанием через пробел адреса местонахождения.

³ Заполняется в случае, если получатель является банком

2.14. Запрос на изменение регистрации реквизитов Счета для возврата обеспечения в иностранной валюте Обособленной Брокерской фирме

В НКО НКЦ (АО)

ЗАПРОС НА ИЗМЕНЕНИЕ РЕГИСТРАЦИИ РЕКВИЗИТОВ СЧЕТА ДЛЯ ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ В ИНОСТРАННОЙ ВАЛЮТЕ ОБОСОБЛЕННОЙ БРОКЕРСКОЙ ФИРМЕ

(наименование Участника клиринга и/или Доверенного владельца счетов)

Идентификатор Участника клиринга:

Прошу внести изменения в ранее зарегистрированные реквизиты банковского счета¹ для возврата денежных средств Обеспечения в иностранной валюте Обособленной Брокерской фирме № ХХУУ000 (отметить нужное):

- на счет Участника клиринга, раздел № ХХУУZZZ
- на счет Доверенного владельца счетов, раздел № ХХУУZZZ

| | | | | |
|--|-----------------|--------------------------|-----------|--------------------------|
| Валюта вывода (отметить нужное) | доллар США, USD | <input type="checkbox"/> | евро, EUR | <input type="checkbox"/> |
| Наименование банка-корреспондента (57D) | | | | |
| Номер счета бенефициара в банке-корреспонденте (58А)* | | | | |
| Номер счета банка-корреспондента в банке-посреднике (57А)* | | | | |
| Свифт-код банка-корреспондента (57А)* | | | | |
| Свифт-код банка-посредника (56А)* | | | | |
| Наименование бенефициара (58D) ² | | | | |
| Свифт-код бенефициара ³ | | | | |

От имени Участника клиринга:
_____/_____/_____
М.П.

От имени Доверенного владельца счетов:
_____/_____/_____
М.П.

«__» _____ 20__ г.
Контактное лицо: _____ (ФИО)
Контактный телефон: _____

«__» _____ 20__ г.
Контактное лицо: _____ (ФИО)
Контактный телефон: _____

* Заполняется без пробелов

¹ Все реквизиты заполняются на английском языке

² В случае если Получателем (владельцем счета) является Участник клиринга, запрос подписывают 2 стороны: Участник клиринга и Доверенный владелец счетов.

В случае если Получателем (владельцем счета) является Доверенный владелец счетов, запрос подписывает 1 сторона: Доверенный владелец счетов.

Поле заполняется с указанием через пробел адреса местонахождения.

³ Заполняется в случае, если получатель является банком

2.15. Заявление на формирование отчетов по разделу клиринговых регистров

В НКО НКЦ (АО)

ЗАЯВЛЕНИЕ НА ФОРМИРОВАНИЕ ОТЧЕТОВ ПО РАЗДЕЛУ КЛИРИНГОВЫХ РЕГИСТРОВ

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

Прошу (отметить нужное):

- Установить** формирование отчетов по разделу клиринговых регистров:

| Код раздела | Период формирования | | Код раздела для взимания платы |
|-------------|---------------------|----------------|--------------------------------|
| | Дата начала | Дата окончания | |
| XXYYZZZ | | | XXYYZZZ |

- Пролонгировать** период формирования отчетов по разделу клиринговых регистров:

| Код раздела | Дата окончания |
|-------------|----------------|
| XXYYZZZ | |

- Приостановить** формирование отчетов по разделу клиринговых регистров:

| Код раздела | Дата приостановки |
|-------------|-------------------|
| XXYYZZZ | |

- Переадресовать** сбор за формирование отчетов по разделу клиринговых регистров:

| По разделу | На раздел |
|------------|-----------|
| XXYYZZZ | XXYYZZZ |

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

2.16. Заявление на закрытие разделов клиринговых регистров

В НКО НКЦ (АО)

ЗАЯВЛЕНИЕ НА ЗАКРЫТИЕ РАЗДЕЛОВ КЛИРИНГОВЫХ РЕГИСТРОВ

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

| | |
|--|--|
| | |
|--|--|

Прошу Вас закрыть¹ следующие разделы клиринговых регистров с «__» _____ 20__ г.:

№ XXYYZZZ

№ XXYYZZZ

№ XXYYZZZ

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

¹ Закрытие указанных разделов клиринговых регистров возможно только при отсутствии открытых позиций по Срочным сделкам и нулевым остатках денежных средств и ценных бумаг, учитываемых на данных разделах денежного регистра обеспечения и депо регистра обеспечения.

2.17. Запрос на предоставление отчетов

В НКО НКЦ (АО)

ЗАПРОС НА ПРЕДОСТАВЛЕНИЕ ОТЧЕТОВ

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

Прошу предоставить следующие клиринговые отчеты (указать наименование и тип файла¹):

1. _____
2. _____
3. _____

Отметить нужное:

- за даты в период с ДД/ММ/ГГГГ по ДД/ММ/ГГГГ
- за дату ДД/ММ/ГГГГ
- в электронном виде с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ
- на бумажном носителе за подписью и печатью

Плату за предоставление отчетов по запросу просим списать с раздела денежного регистра № ХХУУZZZ.

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

¹ Например: F14_XX00.xls или f04_XXYY.csv

2.18. Уведомление об изменении указанных сведений по разделу клиринговых регистров

В НКО НКЦ (АО)

**УВЕДОМЛЕНИЕ ОБ ИЗМЕНЕНИИ УКАЗАННЫХ СВЕДЕНИЙ ПО РАЗДЕЛУ
КЛИРИНГОВЫХ РЕГИСТРОВ**

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

В связи с изменением сведений по разделу клиринговых регистров прошу внести следующие изменения¹ по следующему разделу клиринговых регистров № XXYYZZZ:

- | | |
|----|---------------------------------|
| 1. | Наименование раздела |
| | |
| 2. | Идентификационные данные |
| | |

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

¹ Выбрать для изменения только те пункты, в которые надо внести новые сведения.

2.19. Заявление на получение статуса Доверенного владельца счетов

В НКО НКЦ (АО)

**ЗАЯВЛЕНИЕ НА ПОЛУЧЕНИЕ СТАТУСА ДОВЕРЕННОГО ВЛАДЕЛЬЦА
СЧЕТОВ**

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

Прошу Участнику клиринга _____

(наименование Участника клиринга)

присвоить статус Доверенного владельца счетов и включить в список Доверенных владельцев счетов Клирингового центра.

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

2.20. Заявление на аннулирование статуса Доверенного владельца счетов

В НКО НКЦ (АО)

**ЗАЯВЛЕНИЕ НА АННУЛИРОВАНИЕ СТАТУСА ДОВЕРЕННОГО ВЛАДЕЛЬЦА
СЧЕТОВ**

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

| | |
|--|--|
| | |
|--|--|

Прошу Участнику клиринга _____

(наименование Участника клиринга)

аннулировать статус Доверенного владельца счетов, закрепленного за Обособленной Брокерской фирмой с кодом № ХХУУ000

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

2.23. Заявление об отзыве

В НКО НКЦ (АО)

ЗАЯВЛЕНИЕ ОБ ОТЗЫВЕ

(наименование Доверенного владельца счетов)

Настоящим отзываю поданное ранее Заявление о переводе позиций и Обеспечения Обособленной Брокерской фирмы с кодом № ХХУУ000 от Участника клиринга

(наименование Базового Участника клиринга, ИНН, Идентификатор)

другому Участнику клиринга _____.
(наименование Участника клиринга – реципиента, ИНН, Идентификатор)

От имени Доверенного владельца счетов:

_____/_____
м.п.

«__» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

2.24. Согласие на прием

В НКО НКЦ (АО)

СОГЛАСИЕ НА ПРИЕМ

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

| | |
|--|--|
| | |
|--|--|

Настоящим выражаем свое согласие на прием позиций по Срочным контрактам и Обеспечения, учитываемых на разделах клиринговых регистров, имеющих код Обособленной Брокерской фирмы № ХХУУ000, за которой закреплен Доверенный владелец счетов _____.

(наименование Доверенного владельца счетов, ИНН (или код, заменяющий ИНН))

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

2.25. Заявление на регистрацию Торгово-клирингового счета для поставки (на фондовом рынке)

В НКО НКЦ (АО)

ЗАЯВЛЕНИЕ НА РЕГИСТРАЦИЮ ТОРГОВО-КЛИРИНГОВОГО СЧЕТА ДЛЯ ПОСТАВКИ (НА ФОНДОВОМ РЫНКЕ)

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор¹ Участника торгов на фондовом рынке: _____

Прошу для Участника клиринга, Идентификатор на срочном рынке
зарегистрировать Торгово-клиринговые счета² для поставки на фондовом рынке:

| | |
|--|--|
| Торгово-клиринговый счет для поставки на фондовом рынке, соответствующий собственным Расчетным кодам | |
| Торгово-клиринговый счет для поставки на фондовом рынке, соответствующий клиентским Расчетным кодам | |
| Торгово-клиринговый счет для поставки на фондовом рынке, соответствующий Расчетным кодам ДУ | |

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

¹ Идентификатор состоит из 12 знаков и содержит только латинские буквы и цифры.

² За исключением Брокерских фирм/разделов регистра учета позиций, открытых в рамках Идентификатора Участника клиринга, и связанных с Расчетным кодом Единого пула.

2.26. Заявление о соответствии Торгово-клирингового счета для поставки Брокерской фирме (на фондовом рынке)

В НКО НКЦ (АО)

**ЗАЯВЛЕНИЕ О СООТВЕТСТВИИ ТОРГОВО-КЛИРИНГОВОГО СЧЕТА ДЛЯ
ПОСТАВКИ БРОКЕРСКОЙ ФИРМЕ (НА ФОНДОВОМ РЫНКЕ)**

_____,
(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

Идентификатор¹ Участника торгов на фондовом рынке: _____

Прошу зарегистрировать соответствие Торгово-клиринговых счетов для поставки на фондовом рынке Брокерским фирмам:

| Код Брокерской фирмы ² | Тип Расчетного кода, с которым связана Брокерская фирма | Код ТКС для поставки на фондовом рынке | Тип Расчетного кода, входящего в состав ТКС для поставки на фондовом рынке |
|-----------------------------------|---|--|--|
| XXYY000 | | | |
| | | | |

и соответствие кодов Клиентов разделам регистра учета позиций³:

| Код раздела регистра учета позиций | Краткий код клиента |
|------------------------------------|---------------------|
| XXYYZZZ | |
| | |

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

¹ Идентификатор состоит из 12 знаков и содержит только латинские буквы и цифры.

² Код раздела специальной Брокерской фирмы не указывается.

³ Необязательная часть заявления.

Порядок заполнения:

Порядок заполнения поля «Тип Расчетного кода, с которым связана Брокерская фирма»:

- **Собственный** – в случае соответствия типу, указанного в поле «Тип Расчетного кода, входящего в состав ТКС для поставки на фондовом рынке» Собственному Расчетному коду, входящему в состав ТКС для поставки на фондовом рынке;
- **Клиентский** – в случае соответствия типу, указанного в поле «Тип Расчетного кода, входящего в состав ТКС для поставки на фондовом рынке» Клиентскому Расчетному коду, входящему в состав ТКС для поставки на фондовом рынке;
- **ДУ** – в случае соответствия типу, указанного в поле «Тип Расчетного кода, входящего в состав ТКС для поставки на фондовом рынке» Расчетному коду ДУ, входящему в состав ТКС для поставки на фондовом рынке.

Порядок заполнения поля «Тип Расчетного кода, входящего в состав ТКС для поставки на фондовом рынке»:

- **Собственный** – в случае указания в поле «Код ТКС для поставки на фондовом рынке» Торгово-клирингового счета, в состав которого входит Расчетный код, используемый для учета денежных средств Участника клиринга и обязательств Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет Участника клиринга;
- **Клиентский** – в случае указания в поле «Код ТКС для поставки на фондовом рынке» Торгово-клирингового счета, в состав которого входит Расчетный код, используемый для учета денежных средств клиентов Участника клиринга и обязательств Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет клиентов Участника клиринга;
- **ДУ** – в случае указания в поле «Код ТКС для поставки на фондовом рынке» Торгово-клирингового счета, в состав которого входит Расчетный код, используемый для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении этого Участника клиринга и обязательств Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет денежных средств, находящихся в доверительном управлении этого Участника клиринга.

Порядок заполнения поля «Краткий код клиента» (необязательное заполнение):

- В поле «**Краткий код клиента**» указывается краткий код клиента Участника торгов, зарегистрированного в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

2.27. Заявление о соответствии Торгово-клирингового счета для поставки разделу регистра учета позиций (на фондовом рынке)

В НКО НКЦ (АО)

**ЗАЯВЛЕНИЕ О СООТВЕТСТВИИ ТОРГОВО-КЛИРИНГОВОГО СЧЕТА ДЛЯ
ПОСТАВКИ РАЗДЕЛУ РЕГИСТРА УЧЕТА ПОЗИЦИЙ (НА ФОНДОВОМ
РЫНКЕ)**

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

| | |
|--|--|
| | |
|--|--|

Идентификатор¹ Участника торгов на фондовом рынке: _____

Прошу зарегистрировать соответствие Торгово-клиринговых счетов для поставки на фондовом рынке разделам регистра учета позиций:

| Код раздела регистра учета позиций | Тип Расчетного кода, с которым связана Брокерская фирма, в рамках которой открыт раздел регистра учета позиций | Код ТКС для поставки на фондовом рынке | Тип Расчетного кода, входящего в состав ТКС для поставки на фондовом рынке | Краткий код клиента | Примечание к сделке поставки ² |
|------------------------------------|--|--|--|---------------------|---|
| XXYYZZZ | | | | | |
| | | | | | |

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

¹ Идентификатор состоит из 12 знаков и содержит только латинские буквы и цифры.

² Указывается дополнительная информация. Поле содержит 20 знаков и необязательно для заполнения.

Порядок заполнения:

Порядок заполнения поля «**Тип Расчетного кода, с которым связана Брокерская фирма, в рамках которой открыт раздел регистра учета позиций**»:

- **Собственный** - в случае соответствия типу, указанного в поле «Тип Расчетного кода, входящего в состав ТКС для поставки на фондовом рынке» Собственному Расчетному коду, входящему в состав ТКС для поставки на фондовом рынке;
- **Клиентский** - в случае соответствия типу, указанного в поле «Тип Расчетного кода, входящего в состав ТКС для поставки на фондовом рынке» Клиентскому Расчетному коду, входящему в состав ТКС для поставки на фондовом рынке;
- **ДУ** - в случае соответствия типу, указанного в поле «Тип Расчетного кода, входящего в состав ТКС для поставки на фондовом рынке» Расчетному коду ДУ, входящему в состав ТКС для поставки на фондовом рынке.

Порядок заполнения поля «**Тип Расчетного кода, входящего в состав ТКС для поставки на фондовом рынке**»:

- **Собственный** – в случае указания в поле «Код ТКС для поставки на фондовом рынке» Торгово-клирингового счета, в состав которого входит Расчетный код, используемый для учета денежных средств Участника клиринга и обязательств Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет Участника клиринга;
- **Клиентский** - в случае указания в поле «Код ТКС для поставки на фондовом рынке» Торгово-клирингового счета, в состав которого входит Расчетный код, используемый для учета денежных средств клиентов Участника клиринга и обязательств Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет клиентов Участника клиринга;
- **ДУ** - в случае указания в поле «Код ТКС для поставки на фондовом рынке» Торгово-клирингового счета, в состав которого входит Расчетный код, используемый для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении этого Участника клиринга обязательств Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет денежных средств, находящихся в доверительном управлении этого Участника клиринга.

Порядок заполнения поля «**Краткий код клиента**» (необязательное заполнение):

- В поле «**Краткий код клиента**» указывается краткий код клиента Участника торгов, зарегистрированного в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

2.28. Уведомление продавца о намерении поставки (на спот-рынке АО НТБ)

В НКО НКЦ (АО)

**УВЕДОМЛЕНИЕ ПРОДАВЦА О НАМЕРЕНИИ ПОСТАВКИ
(НА СПОТ- РЫНКЕ АО НТБ)**

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

Уведомляем о намерении поставки товара, в отношении которого планируем исполнить Обязательства по поставке по поставочным фьючерсным контрактам на пшеницу:

| Код раздела регистра учета позиций | Качество товара ¹ | Количество товара ² | Код Базиса ³ |
|------------------------------------|------------------------------|--------------------------------|-------------------------|
| XXYYZZZ | | | |

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

¹ Необходимо указать массовую долю белка в пересчете на сухое вещество, указанную в приложении к Списку параметров поставочных фьючерсных контрактов на пшеницу «Размер скидок/надбавок к расчетной цене контракта за качество базисного актива на 1 тонну».

² Указанное количество должно быть больше либо равно минимальной поставочной партии, размер которой установлен Спецификацией поставочного фьючерсного контракта на пшеницу.

³ См. код Базиса в Перечне Базисов АО НТБ и в Списке параметров поставочных фьючерсных контрактов на пшеницу к Спецификации.

2.29. Заявление на регистрацию Торгово-клирингового счета для поставки (на валютном рынке и рынке драгоценных металлов)

В НКО НКЦ (АО)

**ЗАЯВЛЕНИЕ НА РЕГИСТРАЦИЮ ТОРГОВО-КЛИРИНГОВОГО СЧЕТА ДЛЯ
ПОСТАВКИ (НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ И РЫНКЕ ДРАГОЦЕННЫХ
МЕТАЛЛОВ)**

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор¹ Участника торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов:

Прошу для Участника клиринга, Идентификатор на срочном рынке

зарегистрировать Торгово-клиринговые счета² для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов:

| | |
|---|--|
| Торгово-клиринговый счет для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, соответствующий собственным Расчетным кодам | |
| Торгово-клиринговый счет для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, соответствующий клиентским Расчетным кодам | |
| Торгово-клиринговый счет для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, соответствующий Расчетным кодам ДУ | |

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

¹ Идентификатор состоит из 12 знаков и содержит только латинские буквы и цифры.

² За исключением Брокерских фирм/разделов регистра учета позиций, открытых в рамках Идентификатора Участника клиринга, и связанных с Расчетным кодом Единого пула.

2.30. Заявление о соответствии Торгово-клирингового счета для поставки Брокерской фирме (на валютном рынке и рынке драгоценных металлов)

В НКО НКЦ (АО)

ЗАЯВЛЕНИЕ О СООТВЕТСТВИИ ТОРГОВО-КЛИРИНГОВОГО СЧЕТА ДЛЯ ПОСТАВКИ БРОКЕРСКОЙ ФИРМЕ (НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ И РЫНКЕ ДРАГОЦЕННЫХ МЕТАЛЛОВ)

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

Идентификатор¹ Участника торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов:

Прошу зарегистрировать соответствие Торгово-клиринговых счетов для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов Брокерским фирмам:

| Код Брокерской фирмы ² | Тип Расчетного кода, с которым связана Брокерская фирма | Код ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов | Тип Расчетного кода, входящего в состав ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов |
|-----------------------------------|---|---|---|
| XXYY000 | | | |
| | | | |

и соответствие кодов Клиентов разделам регистра учета позиций³:

| Код раздела регистра учета позиций | Краткий код клиента |
|------------------------------------|---------------------|
| XXYYZZZ | |
| | |

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

¹ Идентификатор состоит из 12 знаков и содержит только латинские буквы и цифры.

² Код раздела специальной Брокерской фирмы не указывается.

³ Необязательная часть заявления.

Порядок заполнения:

Порядок заполнения поля «**Тип Расчетного кода, с которым связана Брокерская фирма**»:

- **Собственный** – в случае соответствия типу, указанного в поле «Тип Расчетного кода, входящего в состав ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов» Собственному Расчетному коду, входящему в состав ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- **Клиентский** – в случае соответствия типу, указанного в поле «Тип Расчетного кода, входящего в состав ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов» Клиентскому Расчетному коду, входящему в состав ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- **ДУ** – в случае соответствия типу, указанного в поле «Тип Расчетного кода, входящего в состав ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов» Расчетному коду ДУ, входящему в состав ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

Порядок заполнения поля «**Тип Расчетного кода, входящего в состав ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов**»:

- **Собственный** – в случае указания в поле «Код ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов» Торгово-клирингового счета, в состав которого входит Расчетный код, используемый для учета денежных средств Участника клиринга и обязательств Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет Участника клиринга;
- **Клиентский** – в случае указания в поле «Код ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов» Торгово-клирингового счета, в состав которого входит Расчетный код, используемый для учета денежных средств клиентов Участника клиринга и обязательств Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет клиентов Участника клиринга;
- **ДУ** – в случае указания в поле «Код ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов» Торгово-клирингового счета, в состав которого входит Расчетный код, используемый для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении этого Участника клиринга и обязательств Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет денежных средств, находящихся в доверительном управлении этого Участника клиринга.

Порядок заполнения поля «**Краткий код клиента**» (необязательное заполнение):

- В поле «**Краткий код клиента**» указывается краткий код клиента Участника торгов, зарегистрированного в соответствии с Правилами торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

2.31. Заявление о соответствии Торгово-клирингового счета для поставки разделу регистра учета позиций (на валютном рынке и рынке драгоценных металлов)

В НКО НКЦ (АО)

**ЗАЯВЛЕНИЕ О СООТВЕТСТВИИ ТОРГОВО-КЛИРИНГОВОГО СЧЕТА ДЛЯ
ПОСТАВКИ РАЗДЕЛУ РЕГИСТРА УЧЕТА ПОЗИЦИЙ (НА ВАЛЮТНОМ
РЫНКЕ И РЫНКЕ ДРАГОЦЕННЫХ МЕТАЛЛОВ)**

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

| | |
|--|--|
| | |
|--|--|

Идентификатор¹ Участника торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов:

Прошу зарегистрировать соответствие Торгово-клиринговых счетов для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов разделам регистра учета позиций:

| Код раздела регистра учета позиций | Тип Расчетного кода, с которым связана Брокерская фирма, в рамках которой открыт раздел регистра учета позиций | Код ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов | Тип Расчетного кода, входящего в состав ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов | Краткий код клиента | Примечание к сделке поставки ² |
|------------------------------------|--|---|---|---------------------|---|
| XXYYZZZ | | | | | |
| | | | | | |

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

¹ Идентификатор состоит из 12 знаков и содержит только латинские буквы и цифры.

² Указывается дополнительная информация. Поле содержит 20 знаков и необязательно для заполнения.

Порядок заполнения:

Порядок заполнения поля «**Тип Расчетного кода, с которым связана Брокерская фирма, в рамках которой открыт раздел регистра учета позиций**»:

- **Собственный** - в случае соответствия типу, указанного в поле «Тип Расчетного кода, входящего в состав ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов» Собственному Расчетному коду, входящему в состав ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- **Клиентский** - в случае соответствия типу, указанного в поле «Тип Расчетного кода, входящего в состав ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов» Клиентскому Расчетному коду, входящему в состав ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- **ДУ** - в случае соответствия типу, указанного в поле «Тип Расчетного кода, входящего в состав ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов» Расчетному коду ДУ, входящему в состав ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

Порядок заполнения поля «**Тип Расчетного кода, входящего в состав ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов**»:

- **Собственный** – в случае указания в поле «Код ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов» Торгово-клирингового счета, в состав которого входит Расчетный код, используемый для учета денежных средств Участника клиринга и обязательств Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет Участника клиринга;
- **Клиентский** - в случае указания в поле «Код ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов» Торгово-клирингового счета, в состав которого входит Расчетный код, используемый для учета денежных средств клиентов Участника клиринга и обязательств Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет клиентов Участника клиринга;
- **ДУ** - в случае указания в поле «Код ТКС для поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов» Торгово-клирингового счета, в состав которого входит Расчетный код, используемый для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении этого Участника клиринга обязательств Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет денежных средств, находящихся в доверительном управлении этого Участника клиринга.

Порядок заполнения поля «**Краткий код клиента**» (необязательное заполнение):

- В поле «**Краткий код клиента**» указывается краткий код клиента Участника торгов, зарегистрированного в соответствии с Правилами торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов. Поле не заполняется для собственных разделов регистра учета позиций.

2.32. Заявление об открытии Расчетного кода для Брокерской фирмы

В НКО НКЦ (АО)

**ЗАЯВЛЕНИЕ ОБ ОТКРЫТИИ РАСЧЕТНОГО КОДА ДЛЯ БРОКЕРСКОЙ
ФИРМЫ**

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

| | |
|--|--|
| | |
|--|--|

Прошу открыть Расчетный код с типом (отметить нужное):

- Собственный**
- Клиентский**
- ДУ**

и связать с ним Брокерскую фирму с кодом:

ХХУУ000

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

2.33. Заявление о соответствии Брокерской фирмы Расчетному коду

В НКО НКЦ (АО)

**ЗАЯВЛЕНИЕ О СООТВЕТСТВИИ БРОКЕРСКОЙ ФИРМЫ РАСЧЕТНОМУ
КОДУ**

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

Прошу связать Брокерскую фирму с кодом:

XXYY000

с Расчетным кодом _____.

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

2.34. Заявление на установление параметров учета рисков исполнения опционных контрактов

В НКО НКЦ (АО)

**ЗАЯВЛЕНИЕ НА УСТАНОВЛЕНИЕ ПАРАМЕТРОВ УЧЕТА РИСКОВ
ИСПОЛНЕНИЯ ОПЦИОННЫХ КОНТРАКТОВ**

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

| | |
|--|--|
| | |
|--|--|

Прошу установить следующие значения параметров учета рисков исполнения опционных контрактов, учитываемых на разделах регистров учета позиций в рамках Брокерской фирмы с кодом ХХУУ000:

| Параметр ¹ | Значение параметра ² |
|-----------------------|---------------------------------|
| D | |
| W | |

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

¹ Расшифровка поля «Параметр»:

D - количество клиринговых сессий, за которое применится значение W.

W - вес учета рисков с учетом сценариев исполнения опционных контрактов.

² Порядок заполнения поля «Значения параметра»:

По D может устанавливаться значение от 0 до 999, указывается целое число. По умолчанию стоит значение «0».

По W может устанавливаться значение от 0 до 1, указывается дробное число с двумя знаками после запятой. По умолчанию стоит значение «0».

2.35. Заявление о выборе параметров Брокерской фирмы

В НКО НКЦ (АО)

**ЗАЯВЛЕНИЕ О ВЫБОРЕ
ПАРАМЕТРОВ БРОКЕРСКОЙ ФИРМЫ**

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

| | |
|--|--|
| | |
|--|--|

Прошу установить следующие параметры Брокерских фирм:

| Код Брокерской фирмы | Тип правила агрегирования счетов при расчете Гарантийного обеспечения ¹ | Тип правила учета календарных спредов при расчете Гарантийного обеспечения ² | Тип правила учета межконтрактных спредов ³ | Проверка достаточности и свободного Обеспечения при возврате средств Обеспечения ⁴ | Установить Лимит по Брокерской фирме ⁵ | Проверка на достаточность свободного Обеспечения при объявлении заявок ⁶ |
|----------------------|--|---|---|---|---|---|
| XXYY000 | | | | | | |
| | | | | | | |

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

¹ Устанавливается правило: 3 - Полунеттинг, 4 - Неттинг.

² Устанавливается правило в случае установления по БФ правила агрегирования счетов с типом «4 - Неттинг»: 3 - Полунеттинг, 4 - Неттинг.

³ Устанавливается правило: 3 - Полунеттинг, 4 - Неттинг

⁴ Указывается: да/нет

⁵ Указывается: да/нет

⁶ Указывается: да/нет

2.36. Поручение на установление ограничения на открытие позиций / ограничения на объявление заявок

В НКО НКЦ (АО)

ПОРУЧЕНИЕ НА УСТАНОВЛЕНИЕ / СНЯТИЕ ОГРАНИЧЕНИЯ НА ОТКРЫТИЕ ПОЗИЦИЙ / ОГРАНИЧЕНИЯ НА ОБЪЯВЛЕНИЕ ЗАЯВОК

(наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга:

В соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) просим установить / снять следующие ограничения в рамках Брокерских фирм:

| Код Брокерской фирмы | Уровень ограничений ¹ | Установить/снять ограничения ² | Значение коэффициента ³ Pr_coeff _B / Pr_coeff _R | Тип ограничения ⁴ | Необходимость удаления Активных заявок ⁵ |
|----------------------|----------------------------------|---|---|------------------------------|---|
| XXYY000 | | | | | |
| XXYY000 | | | | | |
| XXYY000 | | | | | |

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

¹ ограничения устанавливаются: 1 – на Брокерскую фирму, 0 – на разделы регистра учета позиций

² 1 – установить ограничение, 0 – снять ограничение.

³ Значение коэффициента определяет во сколько раз отрицательное значение величины SZ_B / SZ_R по модулю должно быть больше Торгового лимита для установления ограничения. Может устанавливаться положительное число с точностью 2 знака после запятой.

⁴ определяет, какой тип ограничения используется: 1 – установить ограничения на объявление заявок, 0 – установить ограничения на открытие позиций.

⁵ определяет, необходимо ли удалять Активные заявки при установке ограничения: 1 – удалять, 0 – не удалять.

3. Форматы отчетов в форме электронных документов, предоставляемые Участникам клиринга, Участникам торгов, Доверенным владельцам счетов, Клиентам Участников клиринга

Перечень отчетов, направляемых по итогам клиринга, установлен в соответствии с Правилами клиринга.

Термины, используемые в Перечне отчетов, используются в значениях, определенных Правилами клиринга.

В имени файлов XX означает Идентификатор Участника клиринга, ХХУУ – код Брокерской фирмы, ХХУУZZZ – код раздела клиринговых регистров.

Типы полей

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

В целях настоящего документа:

Инструментом именуется предмет и условия сделок, определяемые кодом инструмента.

Сделкой именуется Срочный контракт.

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

Для Связок с количеством Сделок равным двум под **ценой Связки** понимается процентная ставка, под ценой Связки в пунктах или рублях понимается своп-цена - разница между ценой первой Сделки в Связке и ценой второй Сделки в Связке (возможно отрицательная).

Под **биржевым сбором** понимается сбор ПАО Московская Биржа (далее – Биржа), взимаемый за заключение Срочных контрактов.

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

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

Отчетный день – это Торговый день в соответствии с Правилами организованных торгов на Срочном рынке Биржи, регулирующими порядок проведения организованных торгов на Срочном рынке Биржи.

3.1. Отчет о заключенных Сделках

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Брокерской фирме, имя файла – **f04_XXYY.csv**.

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

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|--|
| id_deal | numeric(19) | Идентификационный номер Сделки |
| Isin | char(25) | Код (обозначение) Инструмента |
| Price | numeric(16,5) | Цена заключения Сделки (в пунктах) |
| Vol | numeric(10) | Количество Инструментов в Сделке (в штуках) |
| kod_sell | char(7) | Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке, поданной Продавцом, на основании которой заключена Сделка |
| kod_buy | char(7) | Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке, поданной Покупателем, на основании которой заключена Сделка |
| Date | char(10) | Дата регистрации Сделки |
| Time | char(8) | Время регистрации Сделки |
| profit_usd | numeric(20,4) | Не используется |
| Type | numeric(2) | Признак: 0 – для Сделок, заключенных на основании безадресной Заявки, 1 – для обязательств по фьючерсным контрактам, которым возникли в результате исполнения Опционов, 2 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки, или для Поручений на перевод позиций при условии наличия в шлюзе битовой маски 0x8 в поле signs, 3 – для Сделок закрывающих и балансирующих сделок, 11 – не является сделкой. Данные отображают информацию о прекращении обязательств в указанном объеме, 14 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 15 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 17 – не является сделкой, операция по изменению позиции по фьючерсному |

| | | |
|------------|---------------|--|
| | | <p>контракту с текущей датой исполнения, базовым активом которого является данная иностранная валюта / ценная бумага / драгоценный металл, в количестве и по направлению, соответствующему переданному / полученному Профилю актива по иностранной валюте / ценной бумаге / драгоценному металлу,</p> <p>18 – для Сделок, заключенных на основании Индикативных заявок,</p> <p>19 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, заключенных на основании Индикативных заявок,</p> <p>20 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, заключенных на основании Индикативных заявок.</p> <p>21 – для Сделок, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга при проведении процедуры кросс-дефолта,</p> <p>22 – для Сделок, заключенных при закрытии позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование,</p> <p>23 – для Сделок, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга, не исполнившего Обязательства по поставке по поставочным Срочным контрактам на драгоценные металлы</p> |
| var_marg_b | numeric(16,2) | Обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи по фьючерсным контрактам (в рублях РФ) |
| var_marg_s | numeric(16,2) | Обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи по фьючерсным контрактам (в рублях РФ) |
| user_sell | char(20) | Наименование логина (идентификатора) Продавца |
| user_buy | char(20) | Наименование логина (идентификатора) Покупателя |
| no_buy | numeric(19) | Идентификационный номер Заявки, поданной Покупателем, на основании которой заключена Сделка |
| no_sell | numeric(19) | Идентификационный номер Заявки, поданной Продавцом, на основании которой заключена Сделка |
| fee_buy | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| fee_sell | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| date2 | date | Дата регистрации Сделки |
| comm_buy | char(20) | Комментарий в Заявке, поданной Покупателем |

| | | |
|--------------|---------------|--|
| comm_sell | char(20) | Комментарий в Заявке, поданной Продавцом |
| fee_ns_b | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделку, заключенную на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| fee_ns_s | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделку, заключенную на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| price_rur | numeric(16,5) | Цена заключения Сделки (в рублях РФ) |
| ext_id_b | numeric(11) | Дополнительный идентификационный номер, указанный в заявке, поданной Покупателем |
| ext_id_s | numeric(11) | Дополнительный идентификационный номер, указанный в заявке, поданной Продавцом |
| date_clr | date | Дата проведения клиринга |
| repo_id | numeric(11) | Не используется |
| fee_ex_b | numeric(16,2) | Биржевой сбор, подлежащий уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| vat_ex_b | numeric(16,2) | Не используется |
| fee_cc_b | numeric(16,2) | Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| vat_cc_b | numeric(16,2) | Не используется |
| fee_ex_s | numeric(16,2) | Биржевой сбор, подлежащий уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| vat_ex_s | numeric(16,2) | Не используется |
| fee_cc_s | numeric(16,2) | Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| vat_cc_s | numeric(16,2) | Не используется |
| id_mult | numeric(19) | Для Сделки из Связки – идентификационный номер Связки, в которую входит Сделка Для Сделки, не входящей в Связку, всегда пустое |
| signs | numeric(11) | Битовая маска признаков Сделки |
| counterparty | char(7) | Код контрагента по Сделке (Идентификатор Участника клиринга или код Брокерской фирмы, открытой в рамках Идентификатора Участника клиринга), заключенной на основании адресной Заявки |

| | | |
|------------------|------------|--|
| ncc_request_buy | numeric(1) | Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Покупатель): 0 – отсутствует, 1 – присутствует |
| ncc_request_sell | numeric(1) | Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Продавец): 0 – отсутствует, 1 – присутствует |

Примечание:

Для Сделок, входящих в Связку, поля fee_buy, fee_sell, fee_ex_b, fee_cc_b, fee_ex_s, fee_cc_s заполняются таким образом, что сумма каждого из указанных полей по каждой сделке, входящих в Связку, равна значению соответствующего поля для Связки в отчете multilegf04_XXYY.csv.

3.2. Отчет о заключенных опционных контрактах

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Брокерской фирме, имя файла – **o04_XXYY.csv**.

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

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|---|
| id_deal | numeric(19) | Идентификационный номер сделки |
| isin | char(25) | Код (обозначение) опционных контрактов |
| price | numeric(16,5) | Цена заключения опционных контрактов – Премия (в пунктах) |
| vol | numeric(10) | Количество заключенных опционных контрактов (в штуках) |
| kod_sell | char(7) | Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке, поданной Продавцом, на основании которой заключены опционные контракты |
| kod_buy | char(7) | Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке, поданной Покупателем, на основании которой заключены опционные контракты |
| date | char(10) | Дата регистрации опционных контрактов |
| time | char(8) | Время регистрации опционных контрактов |
| profit_usd | numeric(20,4) | Не используется |
| type | numeric(1) | Признак: 0 – для опционных контрактов, заключенных на основании безадресной Заявки, 1 – исполнение опционных контрактов, 2 – для опционных контрактов, заключенных на основании адресной Заявки, или для Поручений на перевод позиций при условии наличия в шлюзе битовой маски 0x8 в поле signs, 3 – для опционных контрактов, заключенных по закрывающим и балансирующим сделкам с Добросовестным участником клиринга 4 – для опционных контрактов, снятых с учета с раздела регистра учета позиций, вследствие того, что права по ним не востребованы Держателем, 5 – для опционных контрактов, заключенных на основании Индикативных заявок, 6 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга при проведении процедуры кросс-дефолта, |

| | | |
|------------|---------------|--|
| | | 7 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование |
| user_sell | char(20) | Наименование логина (идентификатора) Продавца |
| user_buy | char(20) | Наименование логина (идентификатора) Покупателя |
| no_buy | numeric(19) | Идентификационный номер Заявки, поданной Покупателем, на основании которой заключены опционные контракты |
| no_sell | numeric(19) | Идентификационный номер Заявки, поданной Продавцом, на основании которой заключены опционные контракты |
| fee_buy | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| fee_sell | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| date2 | date | Дата регистрации опционных контрактов |
| comm_buy | char(20) | Комментарий в Заявке, поданной Покупателем |
| comm_sell | char(20) | Комментарий в Заявке, поданной Продавцом |
| fee_ns_b | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за опционные контракты, заключенные на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| fee_ns_s | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за опционные контракты, заключенные на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| prem_buy | numeric(16,2) | Обязательства Покупателя по уплате Премий по опционным контрактам (в рублях РФ) |
| prem_sell | numeric(16,2) | Требования Продавца по уплате Премий по опционным контрактам (в рублях РФ) |
| price_rur | numeric(16,5) | Цена заключения опционных контрактов - Премия (в рублях РФ) |
| ext_id_b | numeric(11) | Дополнительный идентификационный номер, указанный в заявке, поданной Покупателем |
| ext_id_s | numeric(11) | Дополнительный идентификационный номер, указанный в заявке, поданной Продавцом |
| date_clr | date | Дата проведения клиринга |
| var_marg_b | numeric(16,5) | Обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи по опционным контрактам (в рублях РФ) |
| var_marg_s | numeric(16,5) | Обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи по опционным контрактам (в рублях РФ) |
| fee_ex_b | numeric(16,2) | Биржевой сбор, подлежащий уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| vat_ex_b | numeric(16,2) | Не используется |
| fee_cc_b | numeric(16,2) | Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Покупателем (в рублях РФ) |

| | | |
|------------------|---------------|--|
| vat_cc_b | numeric(16,2) | Не используется |
| fee_ex_s | numeric(16,2) | Биржевой сбор, подлежащий уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| vat_ex_s | numeric(16,2) | Не используется |
| fee_cc_s | numeric(16,2) | Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| vat_cc_s | numeric(16,2) | Не используется |
| signs | numeric(11) | Битовая маска признаков сделки |
| counterparty | char(7) | Код контрагента по Сделке (Идентификатор Участника клиринга или код Брокерской фирмы, открытой в рамках Идентификатора Участника клиринга), заключенной на основании адресной Заявки |
| ncc_request_buy | numeric(1) | Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Покупатель): 0 – отсутствует, 1 – присутствует |
| ncc_request_sell | numeric(1) | Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Продавец): 0 – отсутствует, 1 – присутствует |

Примечание:

1. Для маржируемых опционов в полях «prem_buy» и «prem_sell» всегда указывается ноль.
2. Для немаржируемых опционов в полях «var_marg_b» и «var_marg_s» всегда указывается ноль.

3.3. Отчет об итогах Торгов Инструментами и Связками

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

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

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

Структура CSV-файлов:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|---|
| date | char(10) | Дата проведения Торгов |
| contract | char(25) | Код (обозначение) Инструмента / Связки |
| execution | char(10) | Дата исполнения Сделок / Связок |
| volume | numeric(10) | Количество Инструментов в заключенных Сделках (в штуках) |
| vol_rubl | numeric(17,2) | Объем обязательств по заключенным Сделкам (в рублях РФ) |
| low | numeric(16,5) | Минимальная цена Инструмента / Связки (в пунктах) |
| high | numeric(16,5) | Максимальная цена Инструмента / Связки (в пунктах) |
| open | numeric(16,5) | Цена открытия (в пунктах) |
| close | numeric(16,5) | Цена закрытия (в пунктах) |
| settl | numeric(16,5) | Расчетная цена Инструмента / Связки, определенная в ходе текущей клиринговой сессии (в пунктах) |
| trades | numeric(10) | Количество записей, внесенных в Реестр сделок при регистрации заключенных Сделок/ Связок |
| interest | numeric(10) | Количество Инструментов в заключенных Сделках, обязательства по которым не прекращены, учитываемых на разделах регистра учета позиций (в штуках) |
| fee | numeric(16,5) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за один фьючерсный контракт (в рублях РФ) / тариф биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделки /Связки (в процентах от суммы сделки) |
| tick_price | numeric(16,5) | Стоимость минимального шага цены Инструмента/Связки, установленная в Торговой системе (в рублях РФ) |
| tick | numeric(16,5) | Минимальный шаг цены Инструмента / Связки, установленный в Торговой системе (в пунктах) |
| avrg | numeric(16,5) | Средневзвешенная цена Инструмента / Связки (в пунктах) |
| poses_rubl | numeric(17,2) | Объем не прекращенных обязательств по Сделкам, учитываемых на разделах регистра учета позиций (в рублях РФ) |
| limit | numeric(16,5) | Верхняя / нижняя граница ценового коридора, установленная по Основному Инструменту (в пунктах) |

| | | |
|------------|---------------|--|
| risk_wr | numeric(16,5) | Величина, характеризующая дополнительный риск по опционным контрактам на продажу, базовым активом которых являются фьючерсные контракты с Кодом (обозначением), указанным в поле «contract» (в рублях РФ) |
| coffout | numeric(7,5) | Краевой коэффициент, установленный для опционных контрактов, базовым активом которых являются фьючерсные контракты с Кодом (обозначением), указанным в поле «contract» |
| base_fut | char(25) | Код базового актива фьючерсного контракта, являющегося базовым активом опционного контракта / код ценной бумаги |
| is_spread | numeric(1) | Признак вхождения Инструмента в группу Инструментов, определенную Методикой определения риск-параметров срочного рынка: 1 – фьючерсный контракт входит в группу, 0 – фьючерсный контракт не входит в группу. |
| name | char(25) | Краткий код (обозначение) Инструмента / Связки |
| date2 | date | Дата проведения Торгов |
| execution2 | date | Дата исполнения Сделок/Связок |
| deposit | numeric(16,5) | Ставка обеспечения по Инструменту (в рублях РФ) |
| is_percent | numeric(1) | Признак фьючерсного контракта: 0 – указывается не в процентах, 1 – указывается в процентах, 2 – признак контракта на электроэнергию, 3 – признак контракта на еврооблигации, 4 – признак контракта на ставку RUONIA |
| settl_rur | numeric(16,5) | Расчетная цена Инструмента/Связки, определенная в ходе текущей клиринговой сессии (в рублях РФ) |
| lot_volume | numeric(10) | Лот |
| tick_pr_go | numeric(16,5) | Стоимость шага цены Инструмента/Связки, установленная в Торговой системе используемая для расчета Гарантийного обеспечения (в рублях РФ) |
| limit_l1 | numeric(16,5) | Не используется |
| pr_settl | numeric(16,5) | Расчетная цена Инструмента/Связки, определенная в ходе дневной клиринговой сессии (в пунктах) |
| pr_settl_r | numeric(16,5) | Расчетная цена Инструмента/Связки, определенная в ходе дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) |
| type_exec | numeric(1) | Тип Сделки: Пусто – для Связки, 0 – для расчетного фьючерсного контракта, |

| | | |
|--------------|---------------|--|
| | | 1 – для поставочного фьючерсного контракта |
| section | char(50) | Наименование Секции срочного рынка |
| spot | char(50) | Не используется |
| base | char(50) | Не используется |
| type_sbor | char(50) | Способ расчета биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, указанных в полях «fee» и «ns_fee»: “RUR” – в рублях РФ за один фьючерсный контракт; “PERCENT” – в процентах от суммы Сделки |
| ns_volume | numeric(10) | Количество Инструментов в Сделках / Связок, заключенных на основании адресных Заявок (в штуках) |
| ns_trades | numeric(10) | Количество записей, внесенных в Реестр сделок при регистрации Сделок / Связок, заключенных на основании адресных Заявок |
| ns_fee | numeric(16,5) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за один фьючерсный контракт, заключенный на основании адресной Заявки (в рублях РФ) / тариф биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделки/Связки, заключенные на основании адресной Заявки (в процентах от суммы сделки) |
| ns_volrubl | numeric(16,5) | Объем обязательств по Сделкам / Связкам, заключенным на основании адресных Заявок (в рублях РФ) |
| l_tradeday | date | Дата последнего Торгового дня, в ходе которого может быть заключена Сделка / Связка с Кодом (обозначением), указанным в поле «contract» |
| multileg | numeric(1) | Признак: 0 – для Инструментов 1 – для Связок |
| deposit_buy | numeric(16,5) | Ставка обеспечения по Инструменту, рассчитанная с учетом направления позиции в покупку (в рублях РФ) |
| deposit_sell | numeric(16,5) | Ставка обеспечения по Инструменту, рассчитанная с учетом направления позиции в продажу (в рублях РФ) |

Примечание:

1. В полях interest, poses_rubl, limit, risk_wr, coffout, is_spread, is_percent, settl_rur, pr_settl_r для Связок всегда – 0.
2. Поля base_fut, type_exec для Связок всегда пустые.
3. Значения, рассчитанные в полях low, high, open, close, avg, не учитывают цены сделок с календарными спредами и сделок, заключенных на основании индикативных заявок.

4. В полях volume, vol_rubl не учитывается оборот по сделкам с календарными спредами и сделками, заключенных на основании индикативных заявок.

3.4. Отчет об итогах Торгов опционными контрактами

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

При предоставлении отчета по итогам дневной клиринговой сессии имя файла – **dayo07.csv**.

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

Структура CSV-файлов:

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

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

3.5. Отчет об обязательствах по Сделкам

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

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

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

Структура CSV-файлов:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|---|
| date | date | Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии) |
| kod | char(7) | Код Брокерской фирмы / код раздела регистра учета позиций / Расчетный код |
| account | char(2) | Признак обязательств: 'BF' – суммарные обязательства, учитываемые на разделах регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы, указанный в поле «kod», 'CL' – обязательства, учитываемые на разделе регистра учета позиций, имеющем код, указанный в поле «kod», 'RK' – суммарные обязательства, учитываемые на Расчетном коде, указанный в поле «kod». |
| isin | char(25) | Код (обозначение) Инструмента |
| pos_beg | numeric(11) | Количество Инструментов в заключенных Сделках, обязательства по которым не прекращены, учитываемых на разделах регистра учета позиций на начало отчетного дня (в штуках) |
| pos_end | numeric(11) | Количество Инструментов в заключенных Сделках, обязательства по которым не прекращены, учитываемых на разделах регистра учета позиций на конец отчетного дня (в штуках) |
| var_marg_p | numeric(16,2) | Вариационная маржа по Сделкам, обязательства по которым не прекращены на начало отчетного дня (в рублях РФ) |
| var_marg_d | numeric(16,2) | Вариационная маржа по Сделкам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ) |
| sbor | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра по Сделкам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ) |
| go_netto | numeric(16,2) | Не используется |
| go_brutto | numeric(16,2) | Гарантийное обеспечение, рассчитанное по брутто-принципу (в рублях РФ) |
| pos_exec | numeric(11) | Количество исполненных Инструментов (больше нуля – исполняется продажа; меньше нуля - покупка) |
| du | numeric(1) | Признак того, что раздел денежного регистра, код которого совпадает кодом раздела регистра учета позиций, предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: |

| | | |
|---------------|---------------|---|
| | | 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении |
| sbor_exec | numeric(16,2) | Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за исполнение фьючерсных контрактов (в рублях РФ) |
| sbor_nosys | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделки, заключенные в течение отчетного дня на основании адресных Заявок (в рублях РФ) |
| fee_exec | numeric(16,2) | Пени за просрочку исполнения фьючерсных контрактов (в рублях РФ) |
| fine_exec | numeric(16,2) | Штраф за неисполнение фьючерсных контрактов (в рублях РФ) |
| accum_go | numeric(16,2) | Не используется |
| fee_trans | numeric(16,2) | Не используется |
| sbor_ex | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора по Сделкам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ) |
| vat_ex | numeric(16,2) | Не используется |
| sbor_cc | numeric(16,2) | Сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра по Сделкам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ) |
| vat_cc | numeric(16,2) | Не используется |
| pos_failed | numeric(11) | Количество позиций, по которым не исполнено обязательство в день исполнения |
| var_marg_prom | numeric(16,2) | Вариационная маржа по Сделкам по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ). Для Инструментов с базовым активом на курсы иностранных валют значение является справочным. |

Примечание:

В поле isin заполняются коды (обозначения) Инструментов:

- фьючерсный контракт,
- инструмент по изменению позиции по фьючерсному контракту с текущей датой исполнения, базовым активом которого является данная иностранная валюта / ценная бумага / драгоценный металл, в количестве и по направлению, соответствующему переданному / полученному Профилю актива по иностранной валюте / ценной бумаге / драгоценному металлу (не является Срочным контрактом).

3.6. Отчет об обязательствах по опционным контрактам

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

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

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

Структура CSV-файлов:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|---|
| date | date | Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии) |
| kod | char(7) | Код Брокерской фирмы / код раздела регистра учета позиций / Расчетный код |
| account | char(2) | Признак обязательств: 'BF' – суммарные обязательства, учитываемые на разделах регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы, указанный в поле «kod», 'CL' – обязательства, учитываемые на разделе регистра учета позиций, имеющем код, указанный в поле «kod», 'RK' – суммарные обязательства, учитываемые на Расчетном коде, указанный в поле «kod». |
| isin | char(25) | Код (обозначение) опционного контракта |
| pos_beg | numeric(11) | Количество опционных контрактов, обязательства по которым не прекращены, учитываемых на разделах регистра учета позиций на начало отчетного дня (в штуках) |
| pos_end | numeric(11) | Количество опционных контрактов, обязательства по которым не прекращены, учитываемых на разделах регистра учета позиций на конец отчетного дня (в штуках) |
| prem | numeric(16,2) | Сумма Премий по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ) |
| sbor | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ) |
| go | numeric(16,2) | Гарантийное обеспечение, рассчитанное по брутто-принципу (в рублях РФ) |
| pos_exec | numeric(11) | Количество исполненных опционных контрактов (больше нуля – опционных контрактов на продажу; меньше нуля – опционных контрактов на покупку) |
| pos_endcir | numeric(11) | Количество опционных контрактов, снятых с учета с раздела регистра учета позиций в следствие истечения Срока действия опционных контрактов, права по которым не востребованы Держателями (больше нуля – опционных контрактов на продажу; меньше нуля – опционных контрактов на покупку) |
| du | numeric(1) | Признак того, что раздел денежного регистра предназначен для учета средств, находящихся в |

| | | |
|---------------|---------------|---|
| | | <p>доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении</p> |
| sbor_exec | numeric(16,2) | Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за исполнение опционных контрактов (в рублях РФ) |
| sbor_nosys | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за опционные контракты, заключенные в течение отчетного дня на основании адресных Заявок (в рублях РФ) |
| var_marg_p | numeric(16,2) | Вариационная маржа по опционным контрактам, обязательства по которым не прекращены на начало отчетного дня (в рублях РФ) |
| var_marg_d | numeric(16,2) | Вариационная маржа по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ) |
| sbor_ex | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ) |
| vat_ex | numeric(16,2) | Не используется |
| sbor_cc | numeric(16,2) | Сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ) |
| vat_cc | numeric(16,2) | Не используется |
| var_marg_prom | numeric(16,2) | Вариационная маржа по опционным контрактам по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ). Для опционных контрактов на Инструменты с базовым активом на курсы иностранных валют значение является справочным. |

3.7. Отчет о денежных средствах в рублях и иностранной валюте, являющихся Обеспечением

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Идентификатору Участника клиринга, имя файла – **monXX00.csv**.

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

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

Структура CSV-файлов:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|--|
| date | date | Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии) |
| kod | char(12) | Код Брокерской фирмы / раздела денежного регистра / Расчетный код |
| account | char(2) | Признак Обеспечения: 'BF' – суммарные средства, учитываемые на Брокерской фирме, 'CL' – средства, учитываемые на разделе денежного регистра, 'RK' – суммарные средства, учитываемые на Расчетном коде. |
| type | char(2) | Тип Обеспечения: 'MN' – денежные средства в рублях РФ и/или иностранной валюте, 'PL' – Не используется |
| amount_beg | numeric(16,2) | Сумма денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на начало отчетного дня (в рублях РФ) |
| var_marg | numeric(16,2) | Сумма обязательств по перечислению Вариационной маржи (в рублях РФ) |
| prem | numeric(16,2) | Сумма обязательств по перечислению Премий по опционным контрактам (в рублях РФ) |
| pay | numeric(16,2) | Изменение суммы денежных средств в рублях РФ и/ или оценочной стоимости иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу в течение дня (в рублях РФ) (рассчитывается как «amount_end» - «amount_beg») |
| fut_sbor | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделки (в рублях РФ) |
| opt_sbor | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за опционные контракты (в рублях РФ) |
| go | numeric(16,2) | Сумма гарантийного обеспечения (в рублях РФ) |
| amount_end | numeric(16,2) | Сумма денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты на конец |

| | | |
|------------|---------------|--|
| | | отчетного дня (в рублях РФ) |
| free | numeric(16,2) | Сумма свободных денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты / Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу (в рублях РФ) (рассчитывается как «amount_end» – «go») |
| du | numeric(1) | Признак того, что раздел денежного регистра предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении |
| gowide | numeric(16,2) | Не используется |
| freewide | numeric(16,2) | Не используется |
| margincall | char(1) | Не используется |
| sbor_ex | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора (в рублях РФ) |
| vat_ex | numeric(16,2) | Не используется |
| sbor_cc | numeric(16,2) | Сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра (в рублях РФ) |
| vat_cc | numeric(16,2) | Не используется |
| rub_beg | numeric(16,2) | Сумма денежных средств в рублях РФ на начало отчетного дня |
| rub_pay | numeric(16,2) | Изменение суммы денежных средств в рублях РФ в течение дня |
| rub_end | numeric(16,2) | Сумма денежных средств в рублях РФ на конец отчетного дня |
| com_pl_beg | numeric(16,2) | Оценочная стоимость иностранной валюты и/или Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на начало отчетного дня (в рублях РФ) |
| com_pl_pay | numeric(16,2) | Изменение оценочной стоимости иностранной валюты и/или Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу в течение дня (в рублях РФ) |
| com_pl_end | numeric(16,2) | Оценочная стоимость иностранной валюты и/или Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на конец отчетного дня (в рублях РФ) |
| ext_rez | numeric(20,2) | Сумма, блокируемая в вечерний клиринг у участников, имеющих позиции по контрактам на RUONIA (в рублях РФ). Резервируется под изменения ставки RUONIA (используется при расчете вариационной маржи по позициям), публикуемой Банком России |

Примечание:

1. Оценочная стоимость иностранной валюты, указываемая в полях «amount_beg» и «amount_end», определяется в соответствии с Методикой выбора и оценки иностранных валют, принимаемых в качестве Обеспечения, утверждаемой Клиринговым центром.
2. В файле **monXX00.csv** отображаются:

- общая сумма соответствующего актива Обеспечения (определяется по полю «type») по Расчетному коду - в поле «amount_end» в записи, в поле «account» которой указан признак 'RK';
 - суммы соответствующего актива Обеспечения (определяется по полю «type») по каждой Брокерской фирме - в поле «amount_end» в записях, в поля «account» которых указан признак 'BF'.
3. В файле monXX00.csv, формируемого для Участника клиринга, в случае если клиринговые услуги по ведению клиринговых регистров Клиринговый центр оказывает Участнику торгов, не совпадающего в одном лице с Участником клиринга, в поле account по признаку 'CL' не предоставляется информация по коду раздела денежного регистра, открытого в рамках Брокерской фирмы для Участника торгов.
 4. В файле monXX00.csv в поле go по признаку 'RK' блокируется сумма налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации по Сделкам, являющимся производными финансовыми инструментами, подлежащую удержанию с Участника клиринга – Нерезидента в соответствии с законодательством РФ.

3.8. Предварительный отчет о денежных средствах в рублях РФ и иностранной валюте, являющихся Обеспечением

Отчет предоставляется по итогам дневной клиринговой сессии.

При формировании отчета по Идентификатору Участника клиринга, имя файла – **daymonXX00.csv**.

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

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|---|
| date | Date | Дата проведения клиринга |
| kod | char(12) | Код Брокерской фирмы / раздела денежного регистра / Расчетный код |
| account | char(2) | Признак Обеспечения: 'BF' – суммарные средства, учитываемые на Брокерской фирме, 'CL' – средства, учитываемые на разделе денежного регистра, 'RK' – суммарные средства, учитываемые на Расчетном коде. |
| type | char(2) | Тип Обеспечения: 'MN' – денежные средства в рублях РФ и/или иностранной валюте, 'PL' – Не используется |
| amount_beg | numeric(16,2) | Сумма денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на начало отчетного дня (в рублях РФ) |
| var_marg | numeric(16,2) | Сумма обязательств по перечислению Вариационной маржи по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) |
| prem | numeric(16,2) | Сумма обязательств по перечислению Премий по опционным контрактам по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) |
| pay | numeric(16,2) | Изменение суммы денежных средств в рублях РФ и/или оценочной стоимости иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) |
| fut_sbor | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделки по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) |
| opt_sbor | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за опционные контракты по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) |
| res_vm | numeric(16,2) | Значение отрицательной вариационной маржи по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) |

| | | |
|------------|---------------|--|
| exp_vm | numeric(16,2) | Не используется |
| gol2 | numeric(16,2) | Сумма гарантийного обеспечения по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) |
| gowide | numeric(16,2) | Не используется |
| amountl2 | numeric(16,2) | Сумма денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ). Рассчитывается как amount_beg + var_marg + prem + pay - fut_sbor - opt_sbor |
| amountwide | numeric(16,2) | Не используется |
| freel2 | numeric(16,2) | Сумма свободных денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) (amountl2 - gol2) |
| freewide | numeric(16,2) | Не используется |
| margincall | char(1) | Не используется |
| du | numeric(1) | Признак того, что раздел денежного регистра предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении |
| rub_beg | numeric(16,2) | Сумма денежных средств в рублях РФ на начало отчетного дня |
| rub_pay | numeric(16,2) | Изменение суммы денежных средств в рублях РФ по итогам дневной клиринговой сессии |
| rubl2 | numeric(16,2) | Сумма денежных средств в рублях РФ по итогам дневной клиринговой сессии |
| com_pl_beg | numeric(16,2) | Оценочная стоимость иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на начало отчетного дня (в рублях РФ) |
| com_pl_pay | numeric(16,2) | Изменение оценочной стоимости иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) |
| com_pll2 | numeric(16,2) | Оценочная стоимость иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) |
| ext_rez | numeric(20,2) | Сумма, блокируемая в вечерний клиринг у участников, имеющих позиции по контрактам на RUONIA (в рублях РФ). Резервируется под изменения ставки RUONIA (используется при расчете вариационной маржи по позициям), публикуемой Банком России |

Примечание:

1. В файле daymonXX00.csv, формируемого для Участника клиринга, в случае если клиринговые услуги по ведению клиринговых

регистров Клиринговый центр оказывает Участнику торгов, не совпадающему в одном лице с Участником клиринга, в поле account по признаку 'CL' не предоставляется информация по коду раздела денежного регистра, открытого в рамках Брокерской фирмы для Участника торгов.

2. В файле daymonXX00.csv в поле gol2 по признаку 'RK' блокируется сумма налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации по Сделкам, являющимся производными финансовыми инструментами, подлежащую удержанию с Участника клиринга – Нерезидента в соответствии с законодательством РФ.

3.9. Отчет об операциях по разделам денежного регистра обеспечения

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Идентификатору Участника клиринга, имя файла – **payXX00.csv**.

При формировании отчетов по Брокерской фирме, имя файла – **payXXYY.csv**.

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

Структура CSV файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|--|
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| kod | char(7) | Код раздела денежного регистра |
| account | char(2) | Признак раздела: Всегда 'CL' |
| type | char(2) | Тип средств: 'MN' – денежные средства в рублях РФ и/или в иностранной валюте/ в Профиле актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу , 'PL' – Не используется |
| id_pay | numeric(10) | Идентификатор операции |
| type_pay | numeric(10) | Тип операции |
| pay | numeric(16,2) | Сумма операции (в рублях РФ) с учетом знаком: <0 – уменьшение значение раздела клирингового регистра, >0 – увеличение значения раздела клирингового регистра |
| name | char(255) | Наименование операции |
| comment | char(50) | Примечание |
| du | numeric(1) | Признак того, что раздел денежного регистра предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении |
| payer | char(200) | Не используется |
| inn | char(12) | Не используется |
| bik | char(9) | Не используется |
| purpose | char(255) | Назначение платежа |

Примечание:

В файле рауХХ00.csv, формируемого для Участника клиринга, в случае если клиринговые услуги по ведению клиринговых регистров Клиринговый центр оказывает Участнику торгов, не совпадающего в одном лице с Участником клиринга, в поле account по признаку 'CL' не предоставляется информация по коду раздела денежного регистра, открытого в рамках Брокерской фирмы для Участника торгов.

3.10. Отчет об операциях с иностранной валютой, учитываемой в качестве Обеспечения

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Идентификатору Участника клиринга, имя файла – **paycbXX00.csv**.

При формировании отчета по Брокерской фирме для Участника торгов, имя файла – **paycbXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|--|
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| kod | char(7) | Код раздела денежного регистра |
| account | char(2) | Признак раздела: Всегда 'CL'. |
| type | char(2) | Тип Обеспечения, выраженные в рублях РФ: 'MN' – денежные средства в иностранной валюте и / или в Профиле актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу; 'PL' – Не используется |
| id_pay | numeric(10) | Идентификатор операции |
| type_pay | numeric(10) | Тип операции |
| asset | char(60) | Код иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу |
| pay | numeric(16,5) | Количество внесенного/ выведенного обеспечения в иностранной валюте/ Профилях актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу |
| rub_equ | numeric(16,2) | Оценочная стоимость единицы иностранной валюты/ единицы Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу (в рублях РФ) |
| purpose | char(255) | Назначение платежа |

Примечание:

1. В случае внесения Обеспечения поле «pay» принимает положительное значение, в случае вывода Обеспечения – отрицательное.
2. Поле «purpose» заполняется в случае внесения Обеспечения в иностранной валюте, а также Профиля актива по иностранной валюте / ценной бумаге / драгоценному металлу.
3. В файле paycbXX00.csv, формируемого для Участника клиринга, в случае если клиринговые услуги по ведению клиринговых регистров Клиринговый центр оказывает Участнику торгов, не совпадающего в одном лице с Участником клиринга, в поле account по признаку 'CL' не

предоставляется информация по коду раздела денежного регистра, открытого в рамках Брокерской фирмы для Участника торгов.

3.11. Отчет о разделах клиринговых регистров

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Идентификатору Участника клиринга, имя файла – **clientsXX00.csv**.

При формировании отчета по Брокерской фирме для Участника торгов, имя файла – **clientsXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

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

| | | |
|-----------------|------------|---|
| | | «L» – Клиентский «D» – ДУ |
| cross_trade | numeric(1) | Признак возможности заключения кросс-сделок: 1 – кросс-сделки разрешены |
| account_forts | char(30) | Не используется |
| margin_type_rk | numeric(1) | Информация о действующих правилах расчета Гарантийного обеспечения по каждому Расчетному коду: 4 – Неттинг |
| sb | numeric(1) | Признак специальной Брокерской фирмы: 1 – является Брокерская фирма специальной, 0 – не является Брокерская фирма специальной |
| rk_uf | numeric(1) | Признак Расчетного кода «Единый пул»: 1 – Расчетный код является Расчетным кодом Единого пула, 0 – Расчетный код не является Расчетным кодом Единого пула |
| margin_type_bf | numeric(1) | Информация о действующих правилах агрегирования счетов по Брокерской фирме: 3 – Полунеттинг 4 – Неттинг |
| cal_spread_type | numeric(1) | Правило учета календарных спредов для Брокерской фирмы: 3 – Полунеттинг 4 – Неттинг |
| clients_owner | numeric(1) | Признак Брокерской фирмы, открытой Клиринговому брокеру: 1 – Клиринговый центр оказывает клиринговые услуги по открытию и ведению клиринговых регистров, открытых в рамках данной Брокерской фирмы, Участнику клиринга, 2 – Клиринговый центр оказывает клиринговые услуги по открытию и ведению клиринговых регистров, открытых в рамках данной Брокерской фирмы, Участнику торгов |
| lp_code | char(20) | Код провайдера ликвидности платформы Request for stream (RFS) |
| ics_margin_type | numeric(1) | Правило учета межконтрактных спредов для Брокерской фирмы: 3 – Полунеттинг 4 – Неттинг |

Примечание:

В файле clientsXX00.csv, формируемого для Участника клиринга, в случае если клиринговые услуги по ведению клиринговых регистров

Клиринговый центр оказывает Участнику торгов, не совпадающего в одном лице с Участником клиринга, не предоставляется информация по коду раздела регистра учета позиций, открытого в рамках Брокерской фирмы для Участника торгов, за исключением полей date, kod, cross_trade.

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

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Идентификатору Участника клиринга, имя файла – **persinvestXX00.csv**.

При формировании отчета по Брокерской фирме для Участника торгов, имя файла – **persinvestXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

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

Примечание:

В файле persinvestXX00.csv, формируемого для Участника клиринга, в случае если клиринговые услуги по ведению клиринговых регистров Клиринговый центр оказывает Участнику торгов, не совпадающего в одном лице с Участником клиринга, в поле account по признаку 'CL' не предоставляется информация по коду раздела регистра учета позиций, открытого в рамках Брокерской фирмы для Участника торгов.

3.13. Отчет о сборах за транзакции

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **tranfeeXXYY.csv**.

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|---|
| date | date | Дата проведения клиринга |
| kod | char(7) | Код раздела клиринговых регистров по Идентификатору Участника клиринга / Брокерской фирмы / клиента |
| account | char(2) | Признак обязательств: 'RF' – суммарные обязательства по Идентификатору Участника клиринга; 'BF' – суммарные обязательства по Брокерской фирме; 'CL' – обязательства, учитываемые на разделе регистра учета позиций клиента |
| futopt | numeric(1) | Значение «0», поле не используется |
| mm | numeric(1) | Значение «0», поле не используется |
| addtr | numeric(10) | Значение «0», поле не используется |
| fee | numeric(16,2) | Значение «0», поле не используется |
| sbortr | numeric(16,2) | Сумма сбора Технического центра за транзакции типа trantype, которая будет списана в следующий Расчетный день с раздела клиринговых регистров с признаком 'CL' (руб.) |
| vat_sbortr | numeric(16,2) | Не используется |
| trantype | Numeric(1) | Тип транзакции («0» - сбор за неэффективные транзакции, «1» - сбор за ошибочные транзакции, отличные от ошибок Flood Control, «2» - сбор за ошибочные транзакции Flood Control) |

Примечание:

1. Ключевые поля: «date», «kod», «account», «sbortr», «trantype».
2. За ошибочные транзакции сбор менее 1000 рублей не принимается, поле «sbortr» не заполняется.

3.14. Отчет о сборах за неэффективные транзакции

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **tranfeupdXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

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

Примечание:

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

3.15. Отчет детализированный о сборах за неэффективные транзакции

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **tranfeeupddetailsXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|---|
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| inn | char(50) | ИНН или код, его заменяющий |
| kod | char(7) | Код раздела клиринговых регистров |
| mm | numeric(1) | Признак действия: 1 – совершено с раздела маркет-мейкера, 0 – иначе |
| futoptspot | numeric(1) | Признак действия: 0 – с фьючерсом 1 – с опционом |
| lowliquid | numeric(1) | Признак действия: 1 – с низколиквидным инструментом 0 – иначе |
| tran_count | numeric(1) | Количество транзакций с тремя признаками (mm, futoptspot, lowliquid) |
| fee_sum | numeric(16,2) | Биржевой сбор по сделкам с тремя признаками (mm, futoptspot, lowliquid) |

Примечание:

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

3.16. Отчет о сборах за неэффективные транзакции, подлежащих списанию

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **tranfeeshareXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

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

3.17. Отчет о сборах за ошибочные транзакции, отличных от ошибок Flood Control, по каждому клиентскому логину (идентификатору), подлежащих списанию

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

Имя файла – **usersXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|--|
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| kod | char(7) | Код раздела клиринговых регистров по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента |
| account | char(2) | Признак по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента ('RF' – Идентификатор Участника клиринга; 'BF' – Брокерская фирма; 'CL' - клиент) |
| login | char(50) | Наименование логина (идентификатора) |
| maxmsg | numeric(10) | Пропускная способность логина на конец торговой сессии |
| sbor_err | numeric(16,2) | Сбор за ошибочные транзакции, отличные от ошибок Flood Control (руб.) |

3.18. Отчет о количестве ошибочных транзакций, отличных от ошибок Flood Control, по каждому клиентскому логину (идентификатору)

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **tranerrXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|-------------|--|
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| moment | datetime | Время совершения ошибочной транзакции, отличной от ошибок Flood Control (гггг-мм-дд чч:мм:сс) |
| kod | char(7) | Код раздела клиринговых регистров по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента |
| account | char(2) | Признак по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента ('RF' – Идентификатор Участника клиринга; 'BF' – Брокерская фирма; 'CL' - клиент) |
| login | char(50) | Наименование логина (идентификатора) |
| tran_type | char(20) | Тип транзакции |
| err_code | numeric(10) | Код ошибки |
| err_cnt | numeric(10) | Количество транзакций данного типа с данной ошибкой |

Примечание:

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

3.19. Отчет о сборах за ошибочные транзакции, отличных от ошибок Flood Control, по каждому клиентскому логину (идентификатору)

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **tranerrfeeXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|--|
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| moment | datetime | Время совершения ошибочной транзакции, отличной от ошибок Flood Control (гггг-мм-дд чч:мм:сс) |
| kod | char(7) | Код раздела клиринговых регистров по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента |
| account | char(2) | Признак по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента ('RF' – Идентификатор Участника клиринга; 'BF' – Брокерская фирма; 'CL' - клиент) |
| login | char(50) | Наименование логина (идентификатора) |
| err_count | numeric(10) | Количество ошибочных транзакций, отличных от ошибок Flood Control |
| points | numeric(10) | Сумма баллов по ошибочным транзакциям, отличных от ошибок Flood Control |
| sbor_err | numeric(16,2) | Сбор за количество ошибочных транзакций, отличных от ошибок Flood Control, совершенное на момент времени «moment» |

Примечание:

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

3.20. Отчет о сборах за ошибочные транзакции Flood Control, по каждому клиентскому логину (идентификатору), подлежащих списанию

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

Имя файла – **usersfcXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|--|
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| kod | char(7) | Код раздела клиринговых регистров по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента |
| account | char(2) | Признак по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента ('RF' – Идентификатор Участника клиринга; 'BF' – Брокерская фирма; 'CL' - клиент) |
| login | char(50) | Наименование логина (идентификатора) |
| maxmsg | numeric(10) | Пропускная способность логина (идентификатора) на конец торговой сессии |
| sbor_err | numeric(16,2) | Сбор за ошибочные транзакции Flood Control (руб.) |

3.21. Отчет о сборах за ошибочные транзакции Flood Control, по каждому клиентскому логину (идентификатору)

Отчет предоставляется по итогам предыдущей вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **tranfcfeeXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|--|
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| moment | datetime | Время совершения ошибочной транзакции Flood Control (гггг-мм-дд чч:мм:сс) |
| kod | char(7) | Код раздела клиринговых регистров по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента |
| account | char(2) | Признак по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента ('RF' – Идентификатор Участника клиринга; 'BF' – Брокерская фирма; 'CL' - клиент) |
| login | char(50) | Наименование логина (идентификатора) |
| fc_count | numeric(10) | Количество ошибочных транзакций Flood Control |
| sbor_fc | numeric(16,2) | Сбор за количество ошибочных транзакций Flood Control, совершенное на момент времени «moment» |

3.22. Отчет о заключенных Связках

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Брокерской фирме, имя файла – **multilegf04_XXYY.csv**.

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

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|---|
| id_deal | numeric(19) | Идентификационный номер Связки |
| isin | char(25) | Код (обозначение) Связки |
| price1 | numeric(16,5) | Цена заключения первой Сделки в Связке (в пунктах) |
| price | numeric(16,5) | Цена заключения Связки (в пунктах). |
| vol | numeric(10) | Количество заключенных Связок (в штуках) |
| rate | numeric(16,2) | Для Связок с количеством Сделок равным 2 – ставка Связки (в процентах годовых) |
| days | numeric(4) | Для Связок с количеством Сделок равным 2 – срок Связки (в календарных днях) |
| kod_sell | char(7) | Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке по Связке, поданной Продавцом, на основании которой заключена Связка |
| kod_rts_sell | char(7) | Код участника торгов Продавца |
| kod_buy | char(7) | Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке по Связке, поданной Покупателем, на основании которой заключена Связка |
| kod_rts_buy | char(7) | Код участника торгов Покупателя |
| date | char(10) | Дата регистрации Связки |
| time | char(8) | Время регистрации Связки |
| type | numeric(1) | Признак: 2 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки 3 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании безадресной Заявки |
| signs | numeric(11) | Битовая маска признаков сделки |
| var_marg_b | numeric(16,2) | Вариационная маржа Покупателя по Связке (в рублях РФ) |
| var_marg_s | numeric(16,2) | Вариационная маржа Продавца по Связке (в рублях РФ) |
| user_sell | char(20) | Наименование логина (идентификатора) Продавца по Связке |

| | | |
|------------|---------------|---|
| user_buy | char(20) | Наименование логина (идентификатора) Покупателя по Связке |
| no_buy | numeric(19) | Идентификационный номер Заявки по Связке, поданной Покупателем, на основании которой заключена Связка |
| no_sell | numeric(19) | Идентификационный номер Заявки по Связке, поданной Продавцом, на основании которой заключена Связка |
| fee_buy | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| fee_sell | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| date2 | Date | Дата регистрации Связки |
| comm_buy | char(20) | Комментарий в Заявке по связке, поданной Покупателем |
| comm_sell | char(20) | Комментарий в Заявке по связке, поданной Продавцом |
| fee_ns_b | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Связку, заключенную на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| fee_ns_s | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Связку, заключенную на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| price_rur1 | numeric(16,5) | Цена заключения первой Сделки в Связке (в рублях РФ) |
| price_rur | numeric(16,5) | Цена заключения Связки (в рублях РФ). Для Связок с количеством Сделок равным 2 – своп-цена |
| ext_id_b | numeric(11) | Дополнительный идентификационный номер, указанный в Заявке, поданной Покупателем |
| ext_id_s | numeric(11) | Дополнительный идентификационный номер, указанный в Заявке, поданной Продавцом |
| date_clr | Date | Дата проведения клиринга |
| fee_ex_b | numeric(16,2) | Биржевой сбор, подлежащий уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| vat_ex_b | numeric(16,2) | Не используется |
| fee_cc_b | numeric(16,2) | Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| vat_cc_b | numeric(16,2) | Не используется |
| fee_ex_s | numeric(16,2) | Биржевой сбор, подлежащий уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| vat_ex_s | numeric(16,2) | Не используется |
| fee_cc_s | numeric(16,2) | Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| vat_cc_s | numeric(16,2) | Не используется |
| id_trade | numeric(19) | Идентификационный номер первой Сделки в Связке |

| | | |
|------------------|---------------|--|
| price_rur2 | numeric(16,5) | Не используется |
| ncc_request_buy | numeric(1) | Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Покупатель): 0 – отсутствует, 1 – присутствует |
| ncc_request_sell | numeric(1) | Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Продавец): 0 – отсутствует, 1 – присутствует |

Примечание:

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

3.23. Информация о Сделках, составляющих Связку

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **multileg_dict.csv**.

Структура CSV-файлов:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|-------------|---|
| date | date | Дата Торгового дня, в ходе которого возможно заключение сделок с данной Связкой |
| isin | char(25) | Код (обозначение) Связки |
| num_legs | numeric(10) | Количество Сделок в Связке |
| isin_leg | char(25) | Код (обозначение) Инструмента, входящего в Связку |
| vol | numeric(10) | Количество Инструментов, входящих в Связку (в штуках) |

Примечание:

1. Отчет раскрывает информацию о Сделках, составляющих данную Связку.
2. Количество полей «isin_leg» и «Vol» соответствует количеству сделок в Связке.
3. Поле «Vol» может принимать как положительное значение (в случае покупки), так и отрицательное (в случае продажи).

3.24. Отчет об иностранной валюте, предоставленных в качестве Обеспечения

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Идентификатору Участника клиринга, имя файла – **moncbXX00.csv**.

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

Структура CSV-файлов:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|--|
| date | date | Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии) |
| kod | char(7) | Код Брокерской фирмы / Код раздела денежного регистра / Расчетный код |
| account | char(2) | Признак учета иностранной валюты / ценных бумаг: 'BF' – иностранная валюта / Профиль актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу, учитываемые на всех разделах денежного регистра Брокерской фирмы, 'CL' – иностранная валюта / Профиль актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу, учитываемые на разделе денежного регистра, 'RK' – иностранная валюта / Профиль актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу, учитываемые на всех разделах денежного регистра по Расчетному коду |
| type | char(60) | Код иностранной валюты / Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу |
| amount_beg | numeric(10) | Количество иностранной валюты / Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на начало отчетного дня |
| amt_beg_cb | numeric(16,2) | Стоимость иностранной валюты / Профиля актива по иностранной валюте на начало отчетного дня (в рублях РФ) по курсу ЦБ РФ на предыдущий отчетный день. Для Профиля актива по ценной бумаге, драгоценному металлу равно 0. |
| pay | numeric(16,2) | Изменение суммы иностранной валюты / Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу в течение дня (рассчитывается как «amount_end» - «amount_beg») |
| pay_rub | numeric(16,2) | Изменение стоимости иностранной валюты / Профиля актива по иностранной валюте в течение дня (в рублях РФ) (рассчитывается как «amount_end_rub» - «amount_beg_rub»). Для Профиля актива по ценной бумаге, драгоценному металлу равно 0 |
| amount_end | numeric(10) | Количество иностранной валюты / Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на конец отчетного дня |
| amt_end_cb | numeric(16,2) | Стоимость иностранной валюты / Профиля актива по иностранной валюте на конец отчетного дня (в |

| | | |
|------------|---------------|--|
| | | рублях РФ) по курсу ЦБ РФ на отчетный день. Для Профиля актива по ценной бумаге, драгоценному металлу равно 0 |
| rate_cb | numeric(16,5) | Курс ЦБ РФ иностранной валюты / Профиля актива по иностранной валюте на отчетный день. Для Профиля актива по ценной бумаге, драгоценному металлу равно 0 |
| rate | numeric(16,5) | Оценочная стоимость единицы иностранной валюты / единицы Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу (в рублях РФ) |
| go | numeric(16,2) | Оценочная стоимость иностранной валюты / Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу (в рублях РФ) |
| com_ensure | numeric(1) | Тип Обеспечения: 1 – денежные средства в иностранной валюте / Профиле актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу; 0 – не используется |

Примечание:

1. Оценочная стоимость иностранной валюты, указываемая в полях «rate» и «go», определяется в соответствии с Методикой выбора и оценки иностранных валют, принимаемых в качестве Обеспечения, утверждаемой Клиринговым центром.
2. Значение в поле «go» носит информационный характер, не равно значению в поле «com_pl_end» в Отчете о денежных средствах в рублях, иностранной валюте, являющихся Обеспечением.
3. В файле топсбХХУУ.csv уровня Брокерской фирмы в случае, если Участник клиринга или Участник торгов не имеет права управлять клиентами в рамках данной Брокерской фирмы, в поле account по признаку 'CL' не предоставляется информация по кодам разделов денежных регистров таких клиентов.

3.25. Отчет о позициях по инструментам

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **riskposXXYY.csv**.

Структура CSV-файлов:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|---|
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| kod | char(7) | Код Брокерской фирмы / код раздела регистра учета позиций / Расчетный код |
| account | char(2) | Признак обязательств: 'BF' – суммарные обязательства, учитываемые на разделах регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы, указанный в поле «kod», 'CL' – обязательства, учитываемые на разделе регистра учета позиций, имеющем код, указанный в поле «kod», 'RK' – суммарные обязательства, учитываемые на Расчетном коде, указанный в поле «kod». |
| isin | char(25) | Уникальный код инструмента |
| type | char(1) | Тип инструмента 'F' – фьючерсный контракт, 'O' – опционный контракт, 'K' – позиция по фьючерсному контракту с текущей датой исполнения, базовым активом которого является данная иностранная валюта / ценная бумага / драгоценный металл, в количестве и по направлению, соответствующему переданному / полученному Профилю актива по иностранной валюте / ценной бумаге / драгоценному металлу |
| pos_beg | numeric(11) | Количество инструмента на начало дня |
| pos_end | numeric(11) | Количество инструмента на конец дня |
| go_brutto | numeric(16,2) | Гарантийное обеспечение, рассчитанное по брутто-принципу (в рублях РФ) |
| fee_risk | numeric(16,2) | Не используется |
| sbor | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, за исключением позиций по фьючерсному контракту с текущей датой исполнения, базовым активом которого является данная иностранная валюта / ценная бумага / драгоценный металл, в количестве и по направлению, соответствующему переданному / полученному Профилю актива по иностранной валюте / ценной бумаге / драгоценному металлу (в рублях РФ) |

Примечание:

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

3.26. Отчет о соответствии Торгово-клирингового счета Участнику клиринга/ Брокерской фирме/ разделу регистра учета позиций

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **toeqXXYY.csv**.

Структура CSV-файлов:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|-------------------|----------|--|
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| kod | char(7) | Код раздела клиринговых регистров по Идентификатору Участника клиринга / код Брокерской фирмы / код раздела регистра учета позиций |
| account | char(2) | Признак: 'RF' – Участник клиринга, 'BF' – Брокерская фирма, 'CL' – клиент. |
| kod_tks_fr | char(12) | Код Торгово-клирингового счета на фондовом рынке |
| kod_client_fr | char(12) | Краткий код клиента на фондовом рынке |
| fav_tks_own_fr | char(12) | Торгово-клиринговый счет, соответствующий Собственным Брокерским фирмам, на фондовом рынке |
| fav_tks_client_fr | char(12) | Торгово-клиринговый счет, соответствующий Клиентским Брокерским фирмам, на фондовом рынке |
| fav_tks_du_fr | char(12) | Торгово-клиринговый счет, соответствующий Брокерским фирмам ДУ, на фондовом рынке |
| broker_ref_fr | char(20) | Примечание к сделке поставки на фондовом рынке |
| kod_tks_vr | char(12) | Код Торгово-клирингового счета на валютном рынке и рынке драгоценных металлов |
| kod_client_vr | char(12) | Краткий код клиента участника торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов |
| fav_tks_own_vr | char(12) | Торгово-клиринговый счет, соответствующий Собственным Брокерским фирмам, на валютном рынке и рынке драгоценных металлов |
| fav_tks_client_vr | char(12) | Торгово-клиринговый счет, соответствующий Клиентским Брокерским фирмам, на валютном рынке и рынке драгоценных металлов |
| fav_tks_du_vr | char(12) | Торгово-клиринговый счет, соответствующий Брокерским фирмам ДУ, на валютном рынке и рынке драгоценных металлов |
| broker_ref_vr | char(20) | Примечание к сделке поставки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов |

Примечание:

Поля fav_tks_own_fr, fav_tks_client_fr, fav_tks_du_fr, fav_tks_own_vr, fav_tks_client_vr, fav_tks_du_vr заполняются только для account = 'RF'.

3.27. Отчет об установлении параметров ограничения на открытие позиций/ограничения на объявления заявок

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

При формировании отчета по итогам дневной клиринговой сессии, имя файла – **dayriskparamsXXYY.csv**.

При формировании отчета по итогам вечерней клиринговой сессии, имя файла – **riskparamsXXYY.csv**.

Структура CSV-файлов:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|-------------------|---------------|--|
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| kod | char(7) | Код Брокерской фирмы |
| prohibit_coeff | numeric(16,2) | Коэффициент, установленный Клиринговым центром на основании Поручения на установление ограничения на открытие позиций / ограничения на объявление заявок, полученного от Участника клиринга, для раздела регистра учета позиций, открытого в рамках Брокерской фирмы |
| state | int | Статус ограничения на открытие позиций в отношении каждого раздела регистра учета позиций или ограничение на объявление заявок в отношении каждого раздела регистра учета позиций: 0 – выключен, 1 – включен |
| type | int | Тип ограничений на открытие позиций в отношении каждого раздела регистра учета позиций или ограничение на объявление заявок в отношении каждого раздела регистра учета позиций: 0 – на открытие позиций, 1 – на объявление заявок |
| del_ord | int | Статус удаления Активных заявок в отношении каждого раздела регистра учета позиций: 0 – не удалять, 1 – удалять |
| prohibit_coeff_bf | numeric(16,2) | Коэффициент, установленный Клиринговым центром на основании Поручения на установление ограничения на открытие позиций / ограничения на объявление заявок, полученного от Участника клиринга, для |

| | | |
|------------|-----|--|
| | | Брокерской фирмы. |
| state_bf | int | Статус ограничения на открытие позиций в отношении всех разделов регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы, или ограничение на объявление заявок в отношении всех разделов регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы: 0 – выключен, 1 – включен |
| type_bf | int | Тип ограничений на открытие позиций в отношении всех разделов регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы, или ограничение на объявление заявок в отношении всех разделов регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы: 0 – на открытие позиций, 1 – на объявление заявок |
| del_ord_bf | int | Статус удаления Активных заявок в отношении всех разделов регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы: 0 – не удалять, 1 – удалять |

3.28. Сводная финансовая ведомость

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – F14_XX00.xls.

Структура XLS файла:

НКО НКЦ (АО)

Сводная финансовая ведомость за

Идентификатор N _____

(наименование Участника клиринга)

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

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

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

Аналитика "Движение по счету"

| Код раздела | Дебет | Кредит | Основание | Примечание |
|----------------|-------|--------|-----------|------------|
| | | | | |
| | | | | |

Примечание:

* – В отчете информация о сумме НДС является справочной.

** – В блоке «ДЕПО РЕГИСТР ОБЕСПЕЧЕНИЯ» информация не отражается.

Средства Обеспечения, учитываемые на Расчетном коде с признаком «Единый пул», не отражаются по денежному регистру обеспечения.

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

3.29. Отчет об обязательствах по поставочным фьючерсным контрактам на облигации

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **DELINFO_OFZ_XX00.xls**.

Структура XLS файла:

Идентификатор _____
Код

(Наименование Участника клиринга)

Уведомление о приближении срока исполнения поставочных фьючерсных контрактов на облигации в Режиме торгов «Режим основных торгов Т+» в Секции фондового рынка ПАО Московская Биржа

дата

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

Всего прошито, пронумеровано
и скреплено печатью
103 (сто три) лист 4