

Приложение 2

УТВЕРЖДЕНЫ

приказом НКО НКЦ (АО)

от «21» ИЮНЯ 2024 года

№ НКЦ-П-2024-119

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

**г. Москва
2024 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).....	8
2.3. Заявление на открытие Обособленной Брокерской фирмы.....	9
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 Сделках, принятых в клиринг	48
3.2. Отчет о заключенных опционных контрактах	54
3.3. Сводный отчет о принятых в клиринг Сделках (Инструментах и Связках) .	58
3.4. Отчет об итогах Торгов опционными контрактами	62
3.5. Отчет об обязательствах по Сделкам	64
3.6. Отчет об обязательствах по опционным контрактам	67
3.7. Отчет о денежных средствах в рублях и иностранной валюте, являющихся Обеспечением.....	69
3.8. Предварительный отчет о денежных средствах в рублях РФ и иностранной валюте, являющихся Обеспечением	72
3.9. Отчет об операциях по разделам денежного регистра обеспечения.....	75
3.10. Отчет об операциях с иностранной валютой, учитываемой в качестве Обеспечения	77
3.11. Отчет о разделах клиринговых регистров	78
3.12. Отчет о разделах клиринговых регистров, имеющих признак «Индивидуальный Инвестиционный Счет».....	81
3.13. Отчет о сборах за транзакции	82
3.14. Отчет о сборах за ошибочные транзакции, отличных от ошибок Flood Control, по каждому клиентскому логину (идентификатору), подлежащих списанию.....	83
3.15. Отчет о количестве ошибочных транзакций, отличных от ошибок Flood Control, по каждому клиентскому логину (идентификатору)	84
3.16. Отчет о сборах за ошибочные транзакции, отличных от ошибок Flood Control, по каждому клиентскому логину (идентификатору)	85
3.17. Отчет о сборах за ошибочные транзакции Flood Control, по каждому клиентскому логину (идентификатору), подлежащих списанию.....	86
3.18. Отчет о сборах за ошибочные транзакции Flood Control, по каждому клиентскому логину (идентификатору)	87
3.19. Отчет о заключенных Связках	88
3.20. Информация о Сделках, составляющих Связку	91
3.21. Отчет об иностранной валюте, предоставленных в качестве Обеспечения	92
3.22. Отчет о позициях по инструментам	94

3.23. Отчет о соответствии Торгово-клирингового счета Участнику клиринга/ Брокерской фирме/ разделу регистра учета позиций.....	96
3.24. Информация о расчёте кривой волатильности по Сделкам, заключенным опционными контрактами	98
3.25. Отчет об установлении параметров ограничения на открытие позиций/ограничения на объявления заявок	99
3.26. Сводная финансовая ведомость	101

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 (Универсальный Файловый шлюз/Личный кабинет Участника) осуществляется в формате электронного документа Microsoft Word, подписанного электронно-цифровой подписью отправителя, если иное явно не установлено Формами и форматами документов и отчетов на срочном рынке.

Предоставление отчетов Клиринговым центром в соответствии с Формами и форматами документов и отчетов на срочном рынке по умолчанию осуществляется посредством Подсистемы ЭДО НКЦ (Личный кабинет Участника), подписанного электронно-цифровой подписью, 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**
 Участник клиринга обладает правом использовать в собственных интересах переданные ему клиентом, действующим в качестве доверительного управляющего, денежные средства учредителя (учредителей) доверительного управления и (или) использовать указанные денежные средства для обеспечения исполнения собственных обязательств или обязательств третьих лиц.³
- Брокерская фирма ДУ (для Участника клиринга)**
 Участник клиринга обладает правом использовать в собственных интересах переданные ему денежные средства учредителя (учредителей) доверительного управления и (или) использовать указанные денежные средства для обеспечения исполнения собственных обязательств или обязательств третьих лиц.³

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 _____

¹ **Порядок заполнения:** Указывается код, состоящий из символа «#», без пробела далее 3-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.

³ Информация используется при обработке Клиринговым центром Запроса на изменение области действия Расчетного кода Единого пула.

с новым Расчетным кодом (открыть новый Расчетный код)

Контактное лицо: _____ (ФИО)

Контактный телефон: _____

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 прошу 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 прошу 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.

«___» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)
Контактный телефон: _____

От имени Доверенного владельца счетов:

_____/_____/_____

М.П.

«___» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)
Контактный телефон: _____

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.

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 № ХХУУ000 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

	Доллар США, USD <input type="checkbox"/>	Евро, EUR <input type="checkbox"/>
Валюта вывода (отметить нужное)	Китайский юань, CNY <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:
 _____/
 М.П.

От имени Доверенного владельца счетов:
 _____/
 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):

Доллар США Евро Китайский юань

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:

/_____/_____
М.П.

«___» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)
Контактный телефон: _____

От имени Доверенного владельца счетов:

/_____/_____
М.П.

«___» _____ 20__ г.

Контактное лицо: _____ (ФИО)
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"/>
	Китайский юань, CNY <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.

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

2.14. 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

	Доллар США, USD <input type="checkbox"/>	Евро, EUR <input type="checkbox"/>
Валюта вывода (отметить нужное)	Китайский юань, CNY <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 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

2.15. 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: _____

2.22. Заявление на перевод позиций и Обеспечения

В НКО НКЦ (АО)

ЗАЯВЛЕНИЕ НА ПЕРЕВОД ПОЗИЦИЙ И ОБЕСПЕЧЕНИЯ

(наименование Доверенного владельца счетов)

Просим осуществить перевод 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)

Основания для перевода позиций и Обеспечения:

(указать не менее одного основания в отношении Базового Участника клиринга в соответствии с
Правилами клиринга Клирингового центра)

От имени Доверенного владельца счетов:

_____/_____
М.П.

«__» _____ 20__ г.

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 позиций:

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.

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»:

- 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**»:

- 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 сельскохозяйственную продукцию:

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 сельскохозяйственную продукцию «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 сельскохозяйственную продукцию.

³ См. код Базиса в Перечне Базисов АО НТБ и в Списке параметров поставочных фьючерсных контрактов на сельскохозяйственную продукцию 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

Отчетные документы формируются в Клиринговой системе в соответствии с Правилами клиринга и направляются Участникам клиринга, Участникам торгов, Доверенным владельцам счетов, Клиентам Участников клиринга в форме электронных документов категории «В».

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), varchar(n)	Строковое значение, включая буквы латиницы и цифры, 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 Сделках, принятых в клиринг

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-файлов:

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_buy	numeric(2)	Тип сделок Покупателя: 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_buy, 3 – для Сделок, заключенных по закрывающим и балансирующим сделкам с Добросовестным участником клиринга, 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,

		<p>17 – не является сделкой, операция по изменению позиции по фьючерсному контракту с текущей датой исполнения, базисным 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> <p>24 – для Сделок, заключенных путем подачи поручения об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией,</p> <p>25 – для Сделок, заключенных вследствие подачи Участником клиринга – Продавцом поручения об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией,</p> <p>26 – для исполнения однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией посредством заключения квартального фьючерсного контракта,</p> <p>27 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие,</p> <p>28 – для Сделок, заключенных на основании Заявки с указанием спреда «TAS» (опция Trade at Settlement).</p>
type_sell	numeric(2)	<p>Тип сделок Продавца:</p> <p>0 – для Сделок, заключенных на основании безадресной Заявки,</p> <p>1 – для обязательств по фьючерсным контрактам, которым возникли в результате исполнения Опционов,</p>

		<p>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_sell,</p> <p>3 – для Сделок, заключенных по закрывающим и балансирующим сделкам с Добросовестным участником клиринга,</p> <p>11 – не является сделкой. Данные отображают информацию о прекращении обязательств в указанном объеме,</p> <p>14 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде,</p> <p>15 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде,</p> <p>17 – не является сделкой, операция по изменению позиции по фьючерсному контракту с текущей датой исполнения, базисным 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> <p>24 – для Сделок, заключенных путем подачи поручения об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией,</p> <p>25 – для Сделок, заключенных вследствие подачи Участником клиринга – Покупателем поручения об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией,</p> <p>26 – для исполнения однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией посредством заключения квартального фьючерсного контракта,</p>
--	--	--

		27 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие, 28 – для Сделок, заключенных на основании Заявки с указанием спреда «TAS» (опция Trade at Settlement).
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(19)	Поле содержит id_deal другой части Сделки для фьючерсных контрактов в календарном спреде. В иных случаях – значение '0'
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_buy	numeric(20)	Битовая маска признаков Сделки Покупателя
signs_sell	numeric(20)	Битовая маска признаков Сделки Продавца
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 Для Сделок со значением '27' в полях type_buy/ type_sell указывается код 'CCNC' центрального контрагента (Клиринговый центр)
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
var_marg_b_settl_price	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи, связанная с изменением Расчетной цены по фьючерсному контракту (в рублях РФ)
var_marg_b_swap_rate	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи, определяемая согласно спецификации и связанная со ставкой обеспечения при отклонении цены по однодневному фьючерсному контракту с автопродлонгацией от цены базового актива больше заданного на уровне однодневного фьючерсного контракта с автопродлонгацией (в рублях РФ)
var_marg_s_settl_price	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи, связанная с изменением Расчетной цены по фьючерсному контракту (в рублях РФ)
var_marg_s_swap_rate	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи, определяемая согласно спецификации и связанная со ставкой обеспечения при отклонении цены по однодневному фьючерсному контракту с автопродлонгацией от цены базового актива больше заданного на уровне однодневного фьючерсного контракта с автопродлонгацией (в рублях РФ)
var_marg_b_index_div	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи с учетом дивидендных выплат по ценным бумагам, входящих в базу расчетов Индексов Московской Биржи, для однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией на Индексы Московской Биржи (в рублях РФ)
var_marg_s_index_div	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи с учетом дивидендных выплат по ценным бумагам, входящих в базу расчетов Индексов Московской Биржи, для однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией на Индексы Московской Биржи (в рублях РФ)

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-файлов:

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_buy	numeric(2)	Тип сделок Покупателя: 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_buy, 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,

		<p>7 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование</p> <p>8 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие</p>
type_sell	numeric(2)	<p>Тип сделок Продавца:</p> <p>0 – для опционных контрактов, заключенных на основании безадресной Заявки,</p> <p>1 – исполнение опционных контрактов,</p> <p>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_sell,</p> <p>3 – для опционных контрактов, заключенных по закрывающим и балансирующим сделкам с Добросовестным участником клиринга</p> <p>4 – для опционных контрактов, снятых с учета с раздела регистра учета позиций, вследствие того, что права по ним не востребованы Держателем,</p> <p>5 – для опционных контрактов, заключенных на основании Индикативных заявок,</p> <p>6 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга при проведении процедуры кросс-дефолта,</p> <p>7 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование</p> <p>8 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие</p>
user_buy	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Покупателя
user_sell	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Продавца
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_buy	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Покупателя
signs_sell	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Продавца
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 Для Сделок со значением '8' в полях type_buy/ type_sell указывается код 'CCNC' центрального

		контрагента (Клиринговый центр)
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
prem_buy_currency	numeric(16,2)	Обязательства Покупателя по уплате Премий по опционным контрактам (в иностранной валюте, в которой ведутся торги базисным активом)
prem_sell_currency	numeric(16,2)	Требования Продавца по уплате Премий по опционным контрактам (в иностранной валюте, в которой ведутся торги базисным активом)

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. Сводный отчет о принятых в клиринг Сделках (Инструментах и Связках)

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)	Не используется, всегда значение «0»

risk_wr	numeric(16,5)	Величина, характеризующая дополнительный риск по опционным контрактам на продажу, базисным 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, базисным активом которых являются фьючерсные контракты с Кодом (обозначением), указанным в поле «contract»
base_fut	char(25)	Код базисного актива фьючерсного контракта, являющегося базисным 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_11	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(24,2)	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)
swap_rate	numeric(16,5)	Ставка обеспечения при отклонении цены фьючерсного контракта от цены базового актива больше заданного на уровне фьючерсного контракта (в рублях РФ). Определяется в соответствии со спецификацией контракта (поле в отчете f07.csv)
index_div	numeric(18,4)	Значение с учетом дивидендных выплат по ценным бумагам, входящих в базу расчетов Индексов Московской Биржи, для однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией на Индексы Московской Биржи (в пунктах). Поле в отчете f07.csv

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_exes для Связок всегда пустые.
3. Значения, рассчитанные в полях low, high, open, close, не учитывают цены сделок с календарными спредами и сделок, заключенных на основании индикативных заявок.
4. Значение, рассчитанное в поле avrg, не учитывает цены сделок, заключенных на основании индикативных заявок.
5. В полях volume, vol_rubl не учитывается оборот по сделкам, заключенным 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 базисным активом опционного контракта (по синтетической позиции) (в рублях РФ)

fut_contr	char(25)	Код (обозначение) базисного актива 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_theopr	numeric(16,5)	Теоретическая цена опционного контракта, определенная на момент начала дневной клиринговой сессии (в пунктах)
fut_type	char(1)	Признак маржируемости опционного контракта: 0 – немаржируемый опционный контракт; 1 – маржируемый опционный контракт
basegobuy	numeric(16,2)	Базовый размер гарантийного обеспечения под покупку маржируемых опционных контрактов
settlement_currency	char(3)	Код валюты, в которой осуществляются денежные расчеты
tick_price_currency	numeric(16,5)	Стоимость шага цены опционного контракта, установленная в Торговой системе (в валюте, в которой осуществляются денежные расчеты)

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 – выполняется 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 базисным активом на курсы иностранных валют значение является справочным.
var_marg_p_settl_price	numeric(16,2)	Составляющая часть, связанная с изменением Расчетной цены по фьючерсному контракту, Вариационной маржи по Сделкам, обязательства по которым не прекращены на начало отчетного дня (в рублях РФ)
var_marg_p_swap_rate	numeric(16,2)	Составляющая часть, определяемая согласно спецификации связанная со ставкой обеспечения при отклонении цены по однодневному фьючерсному контракту с автопролонгацией от цены базового актива больше заданного на уровне однодневного фьючерсного контракта с автопролонгацией, Вариационной маржи по Сделкам, обязательства по которым не прекращены на начало отчетного дня (в рублях РФ)
var_marg_d_settl_price	numeric(16,2)	Составляющая часть, связанная с изменением Расчетной цены по фьючерсному контракту, Вариационной маржи по Сделкам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)
var_marg_d_swap_rate	numeric(16,2)	Составляющая часть, определяемая согласно спецификации и связанная со ставкой обеспечения при отклонении цены по однодневному фьючерсному контракту с автопролонгацией от цены базового

		актива больше заданного на уровне однодневного фьючерсного контракта с автопролонгацией, Вариационной маржи по Сделкам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)
var_marg_p_index_div	numeric(16,2)	Составляющая часть Вариационной маржи с учетом дивидендных выплат по ценным бумагам, входящих в базу расчетов Индексов Московской Биржи, по Сделкам однодневными фьючерсными контрактами с автопролонгацией на Индексы Московской Биржи, обязательства по которым не прекращены на начало отчетного дня (в рублях РФ)
var_marg_d_index_div	numeric(16,2)	Составляющая часть Вариационной маржи с учетом дивидендных выплат по ценным бумагам, входящих в базу расчетов Индексов Московской Биржи, по Сделкам однодневными фьючерсными контрактами с автопролонгацией на Индексы Московской Биржи, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)

Примечание:

В поле isin заполняются коды (обозначения) Инструментов:

- фьючерсный контракт,
- инструмент по изменению позиции по фьючерсному контракту с текущей датой исполнения, базисным 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 базисным активом на курсы иностранных валют значение является справочным.
prem_currency	numeric(16,2)	Сумма Премий по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в валюте, в которой осуществляются денежные расчеты)
prem_prom	numeric(16,2)	Сумма Премий по опционным контрактам по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ)
prem_prom_currency	numeric(16,2)	Сумма Премий по опционным контрактам по итогам дневной клиринговой сессии (в валюте, в которой осуществляются денежные расчеты)
nov	numeric(16,2)	Оценочная стоимость объема позиций опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги (в рублях РФ)

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 (в рублях РФ): 'MN' – денежные средства в рублях РФ и/или в иностранной валюте/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу, '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)
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)
nov	numeric(16,2)	Оценочная стоимость объема позиций опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги, на конец отчетного дня (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/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу 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)
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_prem	numeric(16,2)	Изменение оценочной стоимости объема позиций опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги, 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-файлов:

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
nov	numeric(16,2)	Оценочная стоимость объёма позиций опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги, по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ)
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_pl_prem	numeric(16,2)	Изменение оценочной стоимости объёма позиций опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги, 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 daemonXX00.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 daemonXX00.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 файлов:

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 payXX00.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-файлов:

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: '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 иностранной валюты/ 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-файлов:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения клиринга
kod	char(7)	Код раздела клиринговых регистров
account	char(2)	Признак раздела: Всегда 'CL'
name	char(200)	Наименование раздела клиринговых регистров
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 в случае предоставления Заявления на формирование отчетов по разделу клиринговых регистров, за исключением основного раздела Брокерской фирмы с кодом вида ХХYY000
date_end	date	Дата окончания формирования отчетов по разделу в случае предоставления Заявления на формирование отчетов по разделу клиринговых регистров, за исключением основного раздела Брокерской фирмы с кодом вида ХХYY000
send_kod	char(7)	Код раздела денежного регистра обеспечения для учитывания комиссионного вознаграждения за формирование отчетов по итогам клиринга в случае переадресации на другой раздел денежного регистра обеспечения
code_adr	char(7)	Код для заключения адресных сделок
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
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	varchar(1)	Признак возможности: «Y» – кросс-сделки разрешены, предусмотрено снятие только активных кросс-заявок, «N» – кросс-сделки запрещены, предусмотрено снятие только активных кросс-заявок, «P» – кросс-сделки запрещены, предусмотрено снятие пассивных кросс-заявок, «X» – кросс-сделки разрешены, предусмотрено снятие пассивных кросс-заявок.
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
n_level	char(4000)	Сведения по ИНН (код, заменяющий ИНН) с разделителем '/' для отображения всех уровней зарегистрированных лиц, позволяющие их идентифицировать
category	varchar(20)	Значение, включающее 20 символов, не обязательное для заполнения при регистрации в ЛКУ «Единая регистрация клиентов»
clients_type	varchar(2)	Тип зарегистрированного в ЛКУ «Единая регистрация клиентов»

Примечание:

1. 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.
2. Поле n_level отражает сведения из ЛКУ «Единая регистрация клиентов».

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-файлов:

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 («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 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.)

3.15. 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.

3.16. 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.

3.17. 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.)

3.18. 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»

3.19. 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-файлов:

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_buy	numeric(2)	Тип связки Покупателя: 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 4 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие
type_sell	numeric(2)	Тип связки Продавца: 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

		4 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие
signs_buy	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Покупателя
signs_sell	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Продавца
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).

3.20. Информация о Сделках, составляющих Связку

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **multileg_dict.csv**.

Структура CSV-файла:

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).

3.21. 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: '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
pay_rub	numeric(16,2)	Изменение стоимости иностранной валюты / Профиля актива по иностранной валюте в течение дня (в рублях РФ). Для Профиля актива по ценной бумаге, драгоценному металлу равно 0
prem	numeric(16,2)	Изменение стоимости иностранной валюты, в которой осуществляются денежные расчеты Премий по опционным контрактам, заключенным в течение дня (в рублях РФ)
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.

3.22. Отчет о позициях по инструментам

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **riskposXXYY.csv**.

Структура CSV-файла:

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, базисным 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, базисным 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».

3.23. 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-файла:

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'.

3.24. Информация о расчёте кривой волатильности по Сделкам, заключенным опционными контрактами

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **volat.csv**.

Структура CSV-файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения клиринга
contract	char(25)	Код базового актива одной опционной серии
execution	char(10)	Дата окончания обращения одной опционной серии (дата исполнения)
A	numeric(19,14)	Коэффициенты подстройки кривой волатильности для одной опционной серии
B	numeric(19,14)	
C	numeric(19,14)	
D	numeric(19,14)	
E	numeric(19,14)	
S	numeric(19,14)	
fut_type	int	Признак: 1 – одна опционная серия

3.25. 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 – **dayriskparamsXX00.csv**.

При формировании отчета по итогам вечерней клиринговой сессии, имя файла – **riskparamsXX00.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

3.26. 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						

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.

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.

Прошито, пронумеровано и скреплено печатью
103 (с/шт 104) лист