

УТВЕРЖДЕНЫ

Правлением
Банка «Национальный Клиринговый Центр»
(Акционерное общество)

Протокол № 23 от 22 июня 2016 года

И.о. Председателя Правления
Банка «Национальный Клиринговый Центр»
(Акционерное общество)



Е.С. Демущкина

М.П.

ФОРМАТЫ ОТЧЕТОВ, ПРЕДОСТАВЛЯЕМЫХ УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА НА СРОЧНОМ РЫНКЕ

г. Москва,
2016 г.

СОДЕРЖАНИЕ

| | | |
|-----|--|----|
| 1. | Общие положения | 3 |
| 2. | Отчет о заключенных Сделках..... | 5 |
| 3. | Отчет о заключенных опционных контрактах..... | 7 |
| 4. | Отчет об итогах Торгов Инструментами и Связками | 9 |
| 5. | Отчет об итогах Торгов опционными контрактами | 12 |
| 6. | Отчет об обязательствах по Сделкам | 13 |
| 7. | Отчет об обязательствах по опционным контрактам..... | 15 |
| 8. | Отчет о денежных средствах в рублях, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Средствами гарантийного обеспечения | 16 |
| 9. | Предварительный отчет о денежных средствах в рублях РФ, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Средствами гарантийного обеспечения..... | 19 |
| 10. | Отчет об операциях по разделам денежного регистра и депо регистра обеспечения ... | 20 |
| 11. | Отчет об операциях с иностранной валютой и ценными бумагами, учитываемыми в качестве Средств гарантийного обеспечения | 21 |
| 12. | Отчет о разделах клиринговых регистров..... | 22 |
| 13. | Отчет о разделах клиринговых регистров, имеющих признак «Индивидуальный Инвестиционный Счет» | 23 |
| 14. | Отчет о сборах за транзакции..... | 23 |
| 15. | Отчет о сборах за неэффективные транзакции..... | 24 |
| 16. | Отчет детализированный о сборах за неэффективные транзакции | 24 |
| 17. | Отчет о сборах за неэффективные транзакции, подлежащих списанию | 25 |
| 18. | Отчет о сборах за ошибочные транзакции по каждому клиентскому логину, подлежащих списанию..... | 25 |
| 19. | Отчет о количестве ошибочных транзакций по каждому клиентскому логину..... | 25 |
| 20. | Отчет о сборах за ошибочные транзакции по каждому клиентскому логину | 26 |
| 21. | Отчет о заключенных Связках | 26 |
| 22. | Информация о Сделках, составляющих Связку | 28 |
| 23. | Отчет об иностранной валюте и ценных бумагах, предоставленных в качестве Средств гарантийного обеспечения..... | 29 |
| 24. | Отчет о позициях по инструментам..... | 30 |
| 25. | Отчет о соответствии Брокерской фирмы Расчетному коду валютного рынка | 30 |
| 26. | Отчет о соответствии Торгово-клирингового счета Брокерской фирме/ разделу регистра учета позиций..... | 31 |
| 27. | Сводная финансовая ведомость | 32 |
| 28. | Отчет об обязательствах по поставочным фьючерсным контрактам на облигации | 34 |

1. Общие положения

- 1.1. Настоящий документ «Форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга на срочном рынке» (далее – Форматы отчетов) разработан в соответствии с Правилами клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество), утвержденными уполномоченным органом Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) (далее – Клиринговый центр) и зарегистрированными Банком России (далее – Правила клиринга), с учетом требований законодательства Российской Федерации о клиринговой деятельности и иных нормативных правовых актов Российской Федерации.
- 1.2. Форматы отчетов устанавливают форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга в соответствии с Правилами клиринга.
- 1.3. Термины, используемые в Форматах отчетов, используются в значениях, определенных Правилами клиринга.
- 1.4. Клиринговый центр извещает Участников клиринга о дате вступления в силу Форматов отчетов, а также изменений и дополнений к ним путем раскрытия соответствующей информации на Сайте Клирингового центра (www.nksbank.ru), включая размещение текста Форматов отчетов, не менее чем за 5 (пять) дней до даты вступления их в силу, если иной срок и порядок извещения не установлен решением Клирингового центра.
- 1.5. Отчеты 2–26 предоставляются в виде файлов формата CSV.
- 1.6. В имени файлов XX означает код Расчетной фирмы, ХХУУ – код Брокерской фирмы, ХХУУZZZ – код раздела клиринговых регистров.

Типы полей

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

- 1.7. 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 Организатора торговли, 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 ПАО Московская Биржа (далее – Биржа), регулирующими порядок проведения организованных торгов на Срочном рынке Биржи.

2. Отчет о заключенных Сделках

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

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

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

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|---|
| id_deal | numeric(10) | Идентификационный номер Сделки |
| isin | char(25) | Код (обозначение) Инструмента |
| price | numeric(16,5) | Цена заключения Сделки (в пунктах) |
| vol | numeric(10) | Количество Инструментов в Сделке (в штуках) |
| kod_sell | char(7) | Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке, поданной Продавцом, на основании которой заключена Сделка |
| kod_buy | char(7) | Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке, поданной Покупателем, на основании которой заключена Сделка |
| date | char(10) | Дата регистрации Сделки |
| time | char(8) | Время регистрации Сделки |
| profit_usd | numeric(20,4) | Не используется |
| type | numeric(2) | Признак: 0 – для Сделок, заключенных на основании безадресной Заявки, 1 – для обязательств по фьючерсным контрактам, которым возникли в результате исполнения Опционов, 2 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки, или для Поручений на перевод позиций при условии наличия в шлюзе битовой маски 0x8 в поле signs, 3 – для фьючерсных контрактов, обязательства по которым возникли в ходе проведения процедуры принудительного закрытия позиций, 11 – не является сделкой. Данные отображают информацию о прекращении обязательств в указанном объеме, 14 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 15 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 16 – для Поручений на управление риском |
| var_marg_b | numeric(16,2) | Обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи по фьючерсным контрактам (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) | Имя (наименование) Продавца |
| user_buy | char(20) | Имя (наименование) Покупателя |
| no_buy | numeric(15) | Идентификационный номер Заявки, поданной Покупателем, на основании которой заключена |

| | | Сделка |
|-----------|---------------|--|
| no_sell | numeric(15) | Идентификационный номер Заявки, поданной Продавцом, на основании которой заключена Сделка |
| fee_buy | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| fee_sell | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| date2 | date | Дата регистрации Сделки |
| comm_buy | char(20) | Комментарий в Заявке, поданной Покупателем |
| comm_sell | char(20) | Комментарий в Заявке, поданной Продавцом |
| du_buy | numeric(1) | Признак того, что Сделка заключена Покупателем за счет средств, находящихся в доверительном управлении: 1 – за счет средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – не за счет средств, находящихся в доверительном управлении) |
| du_sell | numeric(1) | Признак того, что Сделка заключена Продавцом за счет средств, находящихся в доверительном управлении: 1 – за счет средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – не за счет средств, находящихся в доверительном управлении |
| fee_ns_b | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделку, заключенную на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| fee_ns_s | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделку, заключенную на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| price_rur | numeric(16,5) | Цена заключения Сделки (в рублях РФ) |
| ext_id_b | numeric(11) | Дополнительный идентификационный номер, указанный в заявке, поданной Покупателем |
| ext_id_s | numeric(11) | Дополнительный идентификационный номер, указанный в заявке, поданной Продавцом |
| date_clr | date | Дата проведения клиринга |
| repo_id | numeric(11) | Не используется |
| fee_ex_b | numeric(16,2) | Биржевой сбор, подлежащий уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| vat_ex_b | numeric(16,2) | Не используется |
| fee_cc_b | numeric(16,2) | Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| vat_cc_b | numeric(16,2) | Не используется |
| fee_ex_s | numeric(16,2) | Биржевой сбор, подлежащий уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| vat_ex_s | numeric(16,2) | Не используется |
| fee_cc_s | numeric(16,2) | Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, |

| | | |
|--------------|---------------|---|
| | | подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| vat_cc_s | numeric(16,2) | Не используется |
| id_mult | numeric(10) | Для Сделки из Связки – идентификационный номер Связки, в которую входит Сделка Для Сделки, не входящей в Связку, всегда пустое |
| signs | numeric(11) | Битовая маска признаков Сделки |
| counterparty | char(7) | Код контрагента по Сделке (код Расчетной фирмы или код Брокерской фирмы), заключенной на основании адресной Заявки |

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.

3. Отчет о заключенных опционных контрактах

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

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

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

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|---|
| id_deal | numeric(10) | Идентификационный номер сделки |
| isin | char(25) | Код (обозначение) опционных контрактов |
| price | numeric(16,5) | Цена заключения опционных контрактов – Премия (в пунктах) |
| vol | numeric(10) | Количество заключенных опционных контрактов (в штуках) |
| kod_sell | char(7) | Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке, поданной Продавцом, на основании которой заключены опционные контракты |
| kod_buy | char(7) | Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке, поданной Покупателем, на основании которой заключены опционные контракты |
| date | char(10) | Дата регистрации опционных контрактов |
| time | char(8) | Время регистрации опционных контрактов |
| profit_usd | numeric(20,4) | Не используется |
| type | numeric(1) | Признак: 0 – для опционных контрактов, заключенных на основании безадресной Заявки, 2 – для опционных контрактов, заключенных на основании адресной Заявки, или для Поручений на перевод позиций при условии наличия в шлюзе битовой маски 0x8 в поле signs, 3 – для опционных контрактов, обязательства по которым возникли в ходе проведения процедуры принудительного закрытия позиций. 4 – для опционных контрактов, снятых с учета с раздела регистра учета позиций, вследствие того, что права по ним не востребованы Держателем. |

| | | |
|-----------|---------------|--|
| user_buy | char(20) | Имя (наименование) Продавца |
| user_sell | char(20) | Имя (наименование) Покупателя |
| no_buy | numeric(15) | Идентификационный номер Заявки, поданной Покупателем, на основании которой заключены опционные контракты |
| no_sell | numeric(15) | Идентификационный номер Заявки, поданной Продавцом, на основании которой заключены опционные контракты |
| fee_buy | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| fee_sell | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| date2 | date | Дата регистрации опционных контрактов |
| comm_buy | char(20) | Комментарий в Заявке, поданной Покупателем |
| comm_sell | char(20) | Комментарий в Заявке, поданной Продавцом |
| du_buy | numeric(1) | Признак того, что опционные контракты заключены Покупателем за счет средств, находящихся в доверительном управлении: 1 – за счет средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – не за счет средств, находящихся в доверительном управлении |
| du_sell | numeric(1) | Признак того, что опционные контракты заключены Продавцом за счет средств, находящихся в доверительном управлении: 1 – за счет средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – не за счет средств, находящихся в доверительном управлении |
| fee_ns_b | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за опционные контракты, заключенные на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| fee_ns_s | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за опционные контракты, заключенные на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| prem_buy | numeric(16,2) | Обязательства Покупателя по уплате Премий по опционным контрактам (в рублях РФ) |
| prem_sell | numeric(16,2) | Требования Продавца по уплате Премий по опционным контрактам (в рублях РФ) |
| price_rur | numeric(16,5) | Цена заключения опционных контрактов - Премия (в рублях РФ) |
| ext_id_b | numeric(11) | Дополнительный идентификационный номер, указанный в заявке, поданной Покупателем |
| ext_id_s | numeric(11) | Дополнительный идентификационный номер, указанный в заявке, поданной Продавцом |
| date_clr | date | Дата проведения клиринга |

| | | |
|--------------|---------------|--|
| var_marg_b | numeric(16,5) | Обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи по опционным контрактам (в рублях РФ) |
| var_marg_s | numeric(16,5) | Обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи по опционным контрактам (в рублях РФ) |
| fee_ex_b | numeric(16,2) | Биржевой сбор, подлежащий уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| vat_ex_b | numeric(16,2) | Не используется |
| fee_cc_b | numeric(16,2) | Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| vat_cc_b | numeric(16,2) | Не используется |
| fee_ex_s | numeric(16,2) | Биржевой сбор, подлежащий уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| vat_ex_s | numeric(16,2) | Не используется |
| fee_cc_s | numeric(16,2) | Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| vat_cc_s | numeric(16,2) | Не используется |
| signs | numeric(11) | Битовая маска признаков сделки |
| counterparty | char(7) | Код контрагента по Сделке (код Расчетной фирмы или код Брокерской фирмы), заключенной на основании адресной Заявки |

Для маржируемых опционов в полях «prem_buy» и «prem_sell» всегда указывается ноль.

Для немаржируемых опционов в полях «var_marg_b» и «var_marg_s» всегда указывается ноль.

4. Отчет об итогах Торгов Инструментами и Связками

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

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

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

Структура CSV-файлов:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|--|
| date | char(10) | Дата проведения Торгов |
| contract | char(25) | Код (обозначение) Инструмента / Связки |
| execution | char(10) | Дата исполнения Сделок / Связок |
| volume | numeric(10) | Количество Инструментов в заключенных Сделках / Количество заключенных Связок (в штуках) |
| vol_rubl | numeric(17,2) | Объем обязательств по заключенным Сделкам / Связкам (в рублях РФ) |
| low | numeric(16,5) | Минимальная цена Инструмента / Связки (в пунктах) |
| high | numeric(16,5) | Максимальная цена Инструмента / Связки (в пунктах) |
| open | numeric(16,5) | Цена открытия (в пунктах) |
| close | numeric(16,5) | Цена закрытия (в пунктах) |
| settl | numeric(16,5) | Расчетная цена Инструмента / Связки, определенная в ходе вечерней клиринговой сессии (в пунктах) |
| trades | numeric(10) | Количество записей, внесенных в Реестр сделок при |

| | | |
|------------|---------------|--|
| | | регистрации заключенных Сделок/ Связок |
| interest | numeric(10) | Количество Инструментов в заключенных Сделках, обязательства по которым не прекращены, учитываемых на разделах регистра учета позиций (в штуках) |
| fee | numeric(16,5) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за один фьючерсный контракт (в рублях РФ) / тариф биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделки /Связки (в процентах от суммы сделки) |
| tick_price | numeric(16,5) | Стоимость минимального шага цены Инструмента/Связки, установленная в Торговой системе (в рублях РФ) |
| tick | numeric(16,5) | Минимальный шаг цены Инструмента/Связки, установленный в Торговой системе (в пунктах) |
| avrg | numeric(16,5) | Средневзвешенная цена Инструмента/Связки (в пунктах) |
| poses_rubl | numeric(17,2) | Объем непрекращенных обязательств по Сделкам , учитываемых на разделах регистра учета позиций (в рублях РФ) |
| limit | numeric(16,5) | Лимит колебаний цен сделок, установленный по Основному Инструменту (в пунктах) |
| kof | numeric(10,6) | Коэффициент, используемый для определения Базового размера гарантийного обеспечения по Инструменту в зависимости от Базового размера гарантийного обеспечения, установленного по Основному Инструменту |
| risk_wr | numeric(16,5) | Величина, характеризующая дополнительный риск по опционным контрактам на продажу, базовым активом которых являются фьючерсные контракты с Кодом (обозначением), указанным в поле «contract» (в рублях РФ) |
| coffout | numeric(7,5) | Краевой коэффициент, установленный для опционных контрактов, базовым активом которых являются фьючерсные контракты с Кодом (обозначением), указанным в поле «contract» |
| base_fut | char(25) | Код базового актива фьючерсного контракта, являющегося базовым активом опционного контракта / код ценной бумаги |
| is_spread | numeric(1) | Признак вхождения Инструмента в группу (определенную Методикой установления и изменения лимитов колебаний цен сделок, являющейся Приложением №5 к Правилам клиринга): 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) | Базовый размер гарантийного обеспечения по Инструменту (в рублях РФ) |

| | | |
|------------|---------------|--|
| is_percent | numeric(1) | Признак того, что цена фьючерсного контракта указывается в процентах 0 – указывается не в процентах, 1 – указывается в процентах |
| perc_rate | numeric(7,2) | Процентная ставка для расчета Вариационной маржи по фьючерсным контрактам, цена которых указывается в процентах. |
| settl_rur | numeric(16,5) | Расчетная цена Инструмента/Связки, определенная в ходе вечерней клиринговой сессии (в рублях РФ) |
| lot_volume | numeric(10) | Лот |
| tick_pr_go | numeric(16,5) | Стоимость шага цены Инструмента/Связки, установленная в Торговой системе используемая для расчета Гарантийного обеспечения (в рублях РФ) |
| limit_l1 | numeric(16,5) | Не используется |
| pr_settl | numeric(16,5) | Расчетная цена Инструмента/Связки, определенная в ходе дневной клиринговой сессии (в пунктах) |
| pr_settl_r | numeric(16,5) | Расчетная цена Инструмента/Связки, определенная в ходе дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) |
| type_exec | numeric(1) | Тип Сделки: Пусто – для Связки, 0 – для расчетного фьючерсного контракта, 2 – для поставочного фьючерсного контракта |
| section | char(50) | Наименование Секции срочного рынка |
| spot | char(50) | Не используется |
| base | char(50) | Не используется |
| type_sbor | char(50) | Способ расчета биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, указанных в полях «fee» и «ns_fee»: “RUR” – в рублях РФ за один фьючерсный контракт; “PERCENT” – в процентах от суммы Сделки |
| ns_volume | numeric(10) | Количество Инструментов в Сделках / Связок, заключенных на основании адресных Заявок (в штуках) |
| ns_trades | numeric(10) | Количество записей, внесенных в Реестр сделок при регистрации Сделок / Связок, заключенных на основании адресных Заявок |
| ns_fee | numeric(16,5) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за один фьючерсный контракт, заключенный на основании адресной Заявки (в рублях РФ) / тариф биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделки/Связки, заключенные на основании адресной Заявки (в процентах от суммы сделки) |
| ns_volrubl | numeric(16,5) | Объем обязательств по Сделкам / Связкам, заключенным на основании адресных Заявок (в рублях РФ) |
| l_tradeday | date | Дата последнего Торгового дня, в ходе которого может быть заключена Сделка / Связка с Кодом (обозначением), указанным в поле «contract» |
| multileg | numeric(1) | Признак: |

| | | |
|--|--|--|
| | | 0 – для Инструментов 1 – для Связок |
|--|--|--|

В полях interest, poses_rubl, limit, kof, risk_wr, coffout, is_spread, is_percent, perc_rate, lot_volume, limit_11, deposit для Связок всегда – 0.

Поля base_fut, type_exec, для Связок всегда пусты.

5. 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 – **day07.csv**.

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

Структура CSV-файлов:

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

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

6. Отчет об обязательствах по Сделкам

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

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

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

Структура CSV-файлов:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|----------|--|
| date | date | Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии) |
| kod | char(7) | Код Расчетной фирмы / Брокерской фирмы / раздела |

| | | |
|------------|---------------|---|
| | | регистра учета позиций |
| account | char(2) | Признак обязательств: 'RF' – суммарные обязательства, учитываемые на разделах регистра учета позиций, имеющих код Расчетной фирмы, указанный в поле «kod»; 'BF' – суммарные обязательства, учитываемые на разделах регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы, указанный в поле «kod»; 'CL' – обязательства, учитываемые на разделе регистра учета позиций, имеющем код, указанный в поле «kod». |
| isin | char(25) | Код (обозначение) Инструмента |
| pos_beg | numeric(11) | Количество Инструментов в заключенных Сделках, обязательства по которым не прекращены, учитываемых на разделах регистра учета позиций на начало отчетного дня (в штуках) |
| pos_end | numeric(11) | Количество Инструментов в заключенных Сделках, обязательства по которым не прекращены, учитываемых на разделах регистра учета позиций на конец отчетного дня (в штуках) |
| var_marg_p | numeric(16,2) | Вариационная маржа по Сделкам, обязательства по которым не прекращены на начало отчетного дня (в рублях РФ) |
| var_marg_d | numeric(16,2) | Вариационная маржа по Сделкам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ) |
| sbor | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра по Сделкам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ) |
| go_netto | numeric(16,2) | Не используется |
| go_brutto | numeric(16,2) | Гарантийное обеспечение, рассчитанное по брутто-принципу (в рублях РФ) |
| pos_exec | numeric(11) | Количество исполненных Инструментов (больше нуля – исполняется продажа; меньше нуля - покупка) |
| du | numeric(1) | Признак того, что раздел денежного регистра, код которого совпадает кодом раздела регистра учета позиций, предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении |
| sbor_exec | numeric(16,2) | Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за исполнение фьючерсных контрактов (в рублях РФ) |
| sbor_nosys | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделки, заключенные в течение отчетного дня на основании адресных Заявок (в рублях РФ) |
| fee_exec | numeric(16,2) | Пени за просрочку исполнения фьючерсных контрактов (в рублях РФ) |
| fine_exec | numeric(16,2) | Штраф за неисполнение фьючерсных контрактов (в рублях РФ) |

| | | |
|------------|---------------|--|
| accum_go | numeric(16,2) | Не используется |
| fee_trans | numeric(16,2) | Не используется |
| sbor_ex | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора по Сделкам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ) |
| vat_ex | numeric(16,2) | Не используется |
| sbor_cc | numeric(16,2) | Сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра по Сделкам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ) |
| vat_cc | numeric(16,2) | Не используется |
| pos_failed | numeric(11) | Количество позиций, по которым не исполнено обязательство в день исполнения |

7. Отчет об обязательствах по опционным контрактам

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

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

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

Структура CSV-файлов:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|---|
| date | date | Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии) |
| kod | char(7) | Код Расчетной фирмы / Брокерской фирмы / раздела регистра учета позиций |
| account | char(2) | Признак обязательств: 'RF' – суммарные обязательства, учитываемые на разделах регистра учета позиций, имеющих код Расчетной фирмы, указанный в поле «kod»; 'BF' – суммарные обязательства, учитываемые на разделах регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы, указанный в поле «kod»; 'CL' – обязательства, учитываемые на разделе регистра учета позиций, имеющем код, указанный в поле «kod». |
| isin | char(25) | Код (обозначение) опционного контракта |
| pos_beg | numeric(11) | Количество опционных контрактов, обязательства по которым не прекращены, учитываемых на разделах регистра учета позиций на начало отчетного дня (в штуках) |
| pos_end | numeric(11) | Количество опционных контрактов, обязательства по которым не прекращены, учитываемых на разделах регистра учета позиций на конец отчетного дня (в штуках) |
| prem | numeric(16,2) | Сумма Премий по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ) |
| sbor | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ) |
| go | numeric(16,2) | Гарантийное обеспечение, рассчитанное по брутто- |

| | | |
|------------|---------------|--|
| | | принципу (в рублях РФ) |
| pos_exec | numeric(11) | Количество исполненных опционных контрактов (больше нуля – опционных контрактов на продажу; меньше нуля – опционных контрактов на покупку) |
| pos_endcir | numeric(11) | Количество опционных контрактов, снятых с учета с раздела регистра учета позиций в следствие истечения Срока действия опционных контрактов, права по которым не востребованы Держателями (больше нуля – опционных контрактов на продажу; меньше нуля – опционных контрактов на покупку) |
| du | numeric(1) | Признак того, что раздел денежного регистра предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении |
| sbor_exec | numeric(16,2) | Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за исполнение опционных контрактов (в рублях РФ) |
| sbor_nosys | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за опционные контракты, заключенные в течение отчетного дня на основании адресных Заявок (в рублях РФ) |
| var_marg_p | numeric(16,2) | Вариационная маржа по опционным контрактам, обязательства по которым не прекращены на начало отчетного дня (в рублях РФ) |
| var_marg_d | numeric(16,2) | Вариационная маржа по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ) |
| sbor_ex | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ) |
| vat_ex | numeric(16,2) | 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 |

8. Отчет о денежных средствах в рублях, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Средствами гарантийного обеспечения

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Расчетной фирме, имя файла – **monXX00.csv**.

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

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

Структура CSV-файлов:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|----------|---|
| date | date | Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии) |
| kod | char(12) | Код Расчетной фирмы / Брокерской фирмы / раздела денежного регистра (депо регистра обеспечения) / |

| | | Расчетный код |
|------------|---------------|--|
| account | char(2) | Признак Средств гарантийного обеспечения: 'RF' – суммарные средства Расчетной фирмы; 'BF' – суммарные средства Брокерской фирмы; 'CL' – средства, учитываемые на разделе денежного регистра (депо регистра обеспечения); 'RK' – средства, учитываемые на Расчетном коде |
| type | char(2) | Тип Средств гарантийного обеспечения: 'MN' – денежные средства в рублях РФ и/или иностранной валюте; 'PL' – ценные бумаги |
| amount_beg | numeric(16,2) | Сумма денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты/оценочная стоимость ценных бумаг 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/оценочной стоимости ценных бумаг в течение дня (в рублях РФ) (рассчитывается как «amount_end» - «amount_beg») |
| fut_sbor | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделки (в рублях РФ) |
| opt_sbor | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за опционные контракты (в рублях РФ) |
| go | numeric(16,2) | Сумма гарантийного обеспечения (в рублях РФ) |
| amount_end | numeric(16,2) | Сумма денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты/оценочная стоимость ценных бумаг на конец отчетного дня (в рублях РФ) |
| free | numeric(16,2) | Сумма свободных денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты /оценочная стоимость свободных ценных бумаг (в рублях РФ) (рассчитывается как «amount_end» – «go») |
| du | numeric(1) | Признак того, что раздел денежного регистра (депо регистра обеспечения) предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении |
| gowide | numeric(16,2) | Не используется |
| freewide | numeric(16,2) | Не используется |
| margincall | char(1) | Не используется |
| sbor_ex | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора (в рублях РФ) |

| | | |
|------------|---------------|---|
| vat_ex | numeric(16,2) | 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 на начало отчетного дня (в рублях РФ) |
| com_pl_pay | numeric(16,2) | Изменение оценочной стоимости иностранной валюты в течение дня (в рублях РФ) |
| com_pl_end | numeric(16,2) | Оценочная стоимость иностранной валюты на конец отчетного дня (в рублях РФ) |
| ext_rez | numeric(20,2) | Сумма, блокируемая в вечерний клиринг у участников, имеющих позиции по контрактам на RUONIA (в рублях РФ). Резервируется под изменения ставки RUONIA (используется при расчете вариационной маржи по позициям), публикуемой Банком России |

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

В файле **monXX00.csv** отображаются:

- общая сумма соответствующего актива Средств гарантийного обеспечения (определяется по полю «type») по Расчетной фирме - в поле «amount_end» в записи, в поле «account» которой указан признак 'RF';
- суммы соответствующего актива Средств гарантийного обеспечения (определяется по полю «type») по каждой Брокерской фирме - в поле «amount_end» в записях, в поля «account» которых указан признак 'BF'.

Сумма денежных средств в рублях Российской Федерации, подлежащих возврату Доверенному владельцу счетов Обособленной Брокерской фирмы отражается в поле «amount_end» записи, у которой в поле «kod» указан код основного раздела данной Обособленной Брокерской фирмы, в поле «account» указан признак 'BF', в поле «type» указан тип 'MN'.

Сумма денежных средств в рублях Российской Федерации, подлежащих возврату Участнику клиринга, которому присвоен код данной Расчетной фирмы, рассчитывается как общая сумма денежных средств в рублях Российской Федерации по Расчетной фирме за минусом сумм денежных средств в рублях Российской Федерации, подлежащих возврату Доверенным владельцам счетов Обособленных Брокерских фирм, зарегистрированных в рамках данной Расчетной фирмы.

9. Предварительный отчет о денежных средствах в рублях РФ, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Средствами гарантийного обеспечения

Отчет предоставляется по итогам дневной клиринговой сессии.

При формировании отчета по Расчетной фирме, имя файла – **daymonXX00.csv**.

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

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|---|
| date | date | Дата проведения клиринга |
| kod | char(12) | Код Расчетной фирмы / Брокерской фирмы / раздела денежного регистра (депо регистра обеспечения) / Расчетный код |
| account | char(2) | Признак Средств гарантийного обеспечения: 'RF' – суммарные средства Расчетной фирмы; 'BF' – суммарные средства Брокерской фирмы; 'CL' – средства, учитываемые на разделе денежного регистра (депо регистра обеспечения); 'RK' – средства, учитываемые на Расчетном коде |
| type | char(2) | Тип Средств гарантийного обеспечения: 'MN' –денежные средства в рублях РФ и/или иностранной валюте; 'PL' –ценные бумаги |
| amount_beg | numeric(16,2) | Сумма денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты/ оценочная стоимость ценных бумаг 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/ оценочной стоимости ценных бумаг по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) |
| fut_sbor | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Сделки по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) |
| opt_sbor | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за опционные контракты по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) |
| res_vm | numeric(16,2) | Значение отрицательной вариационной маржи по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) |
| exp_vm | numeric(16,2) | Не используется |
| gol2 | numeric(16,2) | Сумма гарантийного обеспечения по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) |
| gowide | numeric(16,2) | Не используется |
| amountl2 | numeric(16,2) | Сумма денежных средств в рублях РФ и/или |

| | | |
|------------|---------------|--|
| | | оценочная стоимость иностранной валюты/ оценочная стоимость ценных бумаг 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/ оценочная стоимость свободных ценных бумаг по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) (amountl2 - gol2) |
| freewide | numeric(16,2) | Не используется |
| margincall | char(1) | Не используется |
| du | numeric(1) | Признак того, что раздел денежного регистра (депо регистра обеспечения) предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении |
| rub_beg | numeric(16,2) | Сумма денежных средств в рублях РФ на начало отчетного дня |
| rub_pay | numeric(16,2) | Изменение суммы денежных средств в рублях РФ по итогам дневной клиринговой сессии |
| rubl2 | numeric(16,2) | Сумма денежных средств в рублях РФ по итогам дневной клиринговой сессии |
| com_pl_beg | numeric(16,2) | Оценочная стоимость иностранной валюты на начало отчетного дня (в рублях РФ) |
| com_pl_pay | numeric(16,2) | Изменение оценочной стоимости иностранной валюты по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ) |
| com_pll2 | numeric(16,2) | Оценочная стоимость иностранной валюты 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 |

10. Отчет об операциях по разделам денежного регистра и депо регистра обеспечения

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Брокерской фирме, имя файла – **payXX00.csv**.

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

Структура CSV файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|----------|---------------|
|---------------|----------|---------------|

| | | |
|----------|---------------|--|
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| kod | char(7) | Код раздела денежного регистра (депо регистра обеспечения) |
| account | char(2) | Признак раздела: Всегда 'CL' |
| type | char(2) | Тип средств: 'MN' – денежные средства; 'PL' – ценные бумаги |
| id_pay | numeric(10) | Идентификатор операции |
| type_pay | numeric(10) | Тип операции |
| pay | numeric(16,2) | Сумма операции (в рублях РФ) с учетом знаком: <0 – уменьшение значение раздела клирингового регистра, >0 – увеличение значения раздела клирингового регистра |
| name | char(75) | Наименование операции |
| comment | char(50) | Примечание |
| du | numeric(1) | Признак того, что раздел денежного регистра (депо регистра обеспечения) предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении |
| payer | char(200) | Наименование плательщика |
| inn | char(12) | ИНН плательщика |
| bik | char(9) | БИК банка плательщика |
| purpose | char(255) | Назначение платежа |

Поля «payer», «inn», «bik», «purpose» заполняется только в случае увеличения значения, учитываемого на разделе денежного регистра, произведенного за счет зачисления денежных средств на счет Клирингового центра в НКО ЗАО НРД.

11. Отчет об операциях с иностранной валютой и ценными бумагами, учитываемыми в качестве Средств гарантийного обеспечения

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **paycbXX00.csv**.

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|-------------|--|
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| kod | char(7) | Код раздела денежного регистра (депо регистра обеспечения) |
| account | char(2) | Признак раздела: Всегда 'CL'. |
| type | char(2) | Тип средств, являющихся Средствами гарантийного обеспечения, выраженные в рублях РФ: 'MN' – денежные средства в иностранной валюте; 'PL' – ценные бумаги |
| id_pay | numeric(10) | Идентификатор операции |

| | | |
|----------|---------------|--|
| type_pay | numeric(10) | Тип операции |
| asset | char(60) | Код иностранной валюты / ценной бумаги |
| pay | numeric(16,5) | Количество внесенного/ выведенного обеспечения в иностранной валюте/ ценных бумагах |
| rub_equ | numeric(16,2) | Оценочная стоимость единицы иностранной валюты или одной ценной бумаги (в рублях РФ) |
| purpose | char(255) | Назначение платежа |

Примечание:

В случае внесения обеспечение поле «pay» принимает положительное значение, в случае вывода обеспечения – отрицательное.

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

12. Отчет о разделах клиринговых регистров

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **clientsXX00.csv**.

Структура CSV-файла:

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

| | | |
|---------------|------------|--|
| | | «S» – Собственный «L» – Клиентский «D» – ДУ |
| cross_trade | numeric(1) | Признак возможности заключения кросс-сделок: 1 – кросс-сделки разрешены |
| account_forts | char(30) | Номер Счета FORTS (торговый раздел типа «Блокировано для клиринга FORTS») |
| margin_type | numeric(1) | Информация о действующих правилах расчета Гарантийного обеспечения по каждому Расчетному коду: 2 – Полунеттинг БФ 3 – Полунеттинг РК |

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

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.
Имя файла – **persinvestXX00.csv**.

Структура CSV-файла:

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

14. Отчет о сборах за транзакции

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.
Имя файла – **tranfeeXXYY.csv**.

Структура CSV-файла:

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

| | | |
|----------|------------|---|
| trantype | Numeric(1) | Тип транзакции («0» - сбор за неэффективные транзакции, «1» - сбор за ошибочные транзакции) |
|----------|------------|---|

Ключевые поля: «date», «kod», «account», «sbortr», «trantype».

За ошибочные транзакции сбор менее 1000 рублей не взимается, поле «sbortr» не заполняется.

15. Отчет о сборах за неэффективные транзакции

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **tranfeupdXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

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

Примечание:

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

16. Отчет детализированный о сборах за неэффективные транзакции

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **tranfeupddetailsXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

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

| | | |
|---------|---------------|---|
| | | признаками (mm, futoptspot, lowliquid) |
| fee_sum | numeric(16,2) | Биржевой сбор по сделкам с тремя признаками (mm, futoptspot, lowliquid) |

Примечание:

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

17. Отчет о сборах за неэффективные транзакции, подлежащих списанию

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **tranfeeshareXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

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

18. Отчет о сборах за ошибочные транзакции по каждому клиентскому логину, подлежащих списанию

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

Имя файла – **usersXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|---|
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| kod | char(7) | Код раздела клиринговых регистров РФ/БФ/клиента |
| account | char(2) | Признак РФ/БФ/клиента ('RF' - РФ; 'BF' - БФ; 'CL' - клиент) |
| login | char(50) | Наименование логина |
| maxmsg | numeric(10) | Пропускная способность логина на конец торговой сессии |
| sbor_err | numeric(16,2) | Сбор за ошибочные транзакции (руб.) |

19. Отчет о количестве ошибочных транзакций по каждому клиентскому логину

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **tranerrXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|-------------|---|
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| moment | datetime | Время совершения ошибочной транзакции (гггг-мм-дд чч:мм:сс) |
| kod | char(7) | Код раздела клиринговых регистров РФ/БФ/клиента |
| account | char(2) | Признак РФ/БФ/клиента ('RF' - РФ; 'BF' - БФ; 'CL' - клиент) |
| login | char(50) | Наименование логина |
| tran_type | char(20) | Тип транзакции |
| err_code | numeric(10) | Код ошибки |
| 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.

20. Отчет о сборах за ошибочные транзакции по каждому клиентскому логину

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **tranerrfeeXXYY.csv**

Структура CSV-файла:

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

Примечание:

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

21. Отчет о заключенных Связках

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

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

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

Структура CSV-файла:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|---|
| Id_deal | numeric(10) | Идентификационный номер Связки |
| isin | char(25) | Код (обозначение) Связки |
| Price1 | numeric(16,5) | Цена заключения первой Сделки в Связке (в пунктах) |
| Price | numeric(16,5) | Цена заключения Связки (в пунктах). |
| vol | numeric(10) | Количество заключенных Связок (в штуках) |
| rate | numeric(16,2) | Для Связок с количеством Сделок равным 2 – ставка Связки (в процентах годовых) |
| days | numeric(4) | Для Связок с количеством Сделок равным 2 – срок Связки (в календарных днях) |
| kod_sell | char(7) | Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке по Связке, поданной Продавцом, на основании которой заключена Связка |
| kod_rts_sell | char(7) | Код участника торгов Продавца |
| kod_buy | char(7) | Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке по Связке, поданной Покупателем, на основании которой заключена Связка |
| kod_rts_buy | char(7) | Код участника торгов Покупателя |
| date | char(10) | Дата регистрации Связки |
| time | char(8) | Время регистрации Связки |
| type | numeric(1) | Признак: 2 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки 3 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании безадресной Заявки |
| signs | numeric(11) | Битовая маска признаков сделки |
| var_marg_b | numeric(16,2) | Не используется |
| var_marg_s | numeric(16,2) | Не используется |
| user_sell | char(20) | Имя (наименование) Продавца по Связке |
| user_buy | char(20) | Имя (наименование) Покупателя по Связке |
| no_buy | numeric(15) | Идентификационный номер Заявки по Связке, поданной Покупателем, на основании которой заключена Связка |
| no_sell | numeric(15) | Идентификационный номер Заявки по Связке, поданной Продавцом, на основании которой заключена Связка |
| fee_buy | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| fee_sell | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| date2 | Date | Дата регистрации Связки |
| comm_buy | char(20) | Комментарий в Заявке по связке, поданной Покупателем |
| comm_sell | char(20) | Комментарий в Заявке по связке, поданной Продавцом |
| du_buy | numeric(1) | Признак того, что Связка заключена Покупателем за счет средств, находящихся в доверительном управлении: |

| | | |
|------------|---------------|---|
| | | 1 – за счет средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – не за счет средств, находящихся в доверительном управлении |
| du_sell | numeric(1) | Признак того, Связка заключена Продавцом за счет средств, находящихся в доверительном управлении: 1 – за счет средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – не за счет средств, находящихся в доверительном управлении |
| fee_ns_b | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Связку, заключенную на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| fee_ns_s | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Связку, заключенную на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ) |
| price_rur1 | numeric(16,5) | Цена заключения первой Сделки в Связке (в рублях РФ) |
| price_rur | numeric(16,5) | Цена заключения Связки (в рублях РФ). Для Связок с количеством Сделок равным 2 – своп-цена |
| ext_id_b | numeric(11) | Дополнительный идентификационный номер, указанный в Заявке, поданной Покупателем |
| ext_id_s | numeric(11) | Дополнительный идентификационный номер, указанный в Заявке, поданной Продавцом |
| date_clr | Date | Дата проведения клиринга |
| fee_ex_b | numeric(16,2) | Биржевой сбор, подлежащий уплате Покупателем (в рублях РФ) |
| vat_ex_b | numeric(16,2) | 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(10) | Идентификационный номер первой Сделки в Связке |
| price_rur2 | numeric(16,5) | Не используется |

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

22. Информация о Сделках, составляющих Связку

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.
Имя файла – **multileg_dict.csv**.

Структура CSV-файлов:

| Название | Тип поля | Описание поля |
|----------|----------|---------------|
|----------|----------|---------------|

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

Отчет раскрывает информацию о Сделках, составляющих данную Связку.

Количество полей «isin_leg» и «Vol» соответствует количеству сделок в Связке.

Поле «Vol» может принимать как положительное значение (в случае покупки), так и отрицательное (в случае продажи).

23. Отчет об иностранной валюте и ценных бумагах, предоставленных в качестве Средств гарантийного обеспечения

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **moncbXXYY.csv**.

Структура CSV-файлов:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|---|
| date | date | Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии) |
| kod | char(7) | Код раздела денежного регистра (депо регистра обеспечения) |
| account | char(2) | Признак учета иностранной валюты / ценных бумаг: 'RF' – иностранная валюта / ценные бумаги, учитываемые на всех разделах денежного регистра / депо регистра обеспечения Расчетной фирмы; 'BF' – иностранная валюта / ценные бумаги, учитываемые на всех разделах денежного регистра / депо регистра обеспечения Брокерской фирмы; 'CL' – иностранная валюта / ценные бумаги, учитываемое на разделе денежного регистра / депо регистра обеспечения |
| type | char(60) | Код иностранной валюты / ценной бумаги |
| amount_beg | numeric(10) | Количество ценных бумаг / иностранной валюты на начало отчетного дня |
| amt_beg_cb | numeric(16,2) | Стоимость иностранной валюты на начало отчетного дня (в рублях РФ) по курсу ЦБ РФ на предыдущий отчетный день. Для ценных бумаг равно 0. |
| pay | numeric(16,2) | Изменение количества ценных бумаг или суммы иностранной валюты в течение дня (рассчитывается как «amount_end» - «amount_beg») |
| pay_rub | numeric(16,2) | Изменение стоимости иностранной валюты в течение дня (в рублях РФ) (рассчитывается как «amount_end_rub» - «amount_beg_rub»). Для ценных бумаг равно 0 |
| amount_end | numeric(10) | Количество ценных бумаг / иностранной валюты на конец отчетного дня |
| amt_end_cb | numeric(16,2) | Стоимость иностранной валюты на конец отчетного дня (в рублях РФ) по курсу ЦБ РФ на отчетный день. Для |

| | | |
|------------|---------------|--|
| | | ценных бумаг равно 0 |
| rate_cb | numeric(16,5) | Курс ЦБ РФ иностранной валюты на отчетный день. Для ценных бумаг равно 0 |
| rate | numeric(16,2) | Оценочная стоимость единицы иностранной валюты или одной ценной бумаги (в рублях РФ) |
| go | numeric(16,2) | Оценочная стоимость иностранной валюты и ценных бумаг в рублях РФ (рассчитывается как «amount_end» * «rate») |
| com_ensure | numeric(1) | Тип Средств обеспечения: 1 – денежные средства в иностранной валюте; 0 – ценные бумаги |

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

24. Отчет о позициях по инструментам

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.
Имя файла – **riskposXXYY.csv**.

Структура CSV-файлов:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|---------------|--|
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| kod | char(7) | Код раздела клиринговых регистров РФ/БФ/клиента |
| account | char(2) | Признак РФ/БФ/клиента ('RF' - РФ; 'BF' - БФ; 'CL' - клиент) |
| isin | char(25) | Уникальный код инструмента |
| type | char(1) | Тип инструмента ('R' – Поручение на управление риском, 'F' – фьючерсный контракт, 'O' – опционный контракт) |
| pos_beg | numeric(11) | Количество инструмента на начало дня |
| pos_end | numeric(11) | Количество инструмента на конец дня |
| go_brutto | numeric(16,2) | Гарантийное обеспечение, рассчитанное по брутто-принципу (в рублях РФ) |
| fee_risk | numeric(16,2) | Сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра по Поручениям на управление риском (в рублях РФ) |
| sbor | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за исключением Поручений на управление риском (в рублях РФ) |

Примечание:

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

25. Отчет о соответствии Брокерской фирмы Расчетному коду валютного рынка

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.
Имя файла – **tofxXXYY.csv**.

Структура CSV-файлов:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|---------------|----------|-------------------------------|
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| kod_bf | char(7) | Код Брокерской фирмы |
| kod_tks | char(12) | Расчетный код валютного рынка |

26. Отчет о соответствии Торгово-клирингового счета Брокерской фирме/ разделу регистра учета позиций

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **toeqXXYY.csv**.

Структура CSV-файлов:

| Название поля | Тип поля | Описание поля |
|----------------|----------|---|
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| kod | char(7) | Код Брокерской фирмы/ раздела регистра учета позиций |
| account | char(2) | Тип Брокерской фирмы/ раздела регистра учета позиций |
| kod_tks | char(12) | Код Торгово-клирингового счета |
| kod_client | char(12) | Краткий код клиента на фондовом рынке |
| fav_tks_own | char(12) | Торгово-клиринговый счет, соответствующий Собственным Брокерским фирмам |
| fav_tks_client | char(12) | Торгово-клиринговый счет, соответствующий Клиентским Брокерским фирмам |
| fav_tks_du | char(12) | Торгово-клиринговый счет, соответствующий Брокерским фирмам ДУ |
| broker_ref | char(20) | Примечание к сделке поставки |

27. Сводная финансовая ведомость

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – F14_XX00.xls.

Структура XLS файла:

Банк НКЦ (АО)
Сводная финансовая ведомость за

по Расчетной фирме N__

(наименование Расчетной фирмы)

| Наименование регистра | Баланс на начало дня | | Оборот за день | | Баланс на конец дня | |
|--|----------------------|--------|----------------|--------|---------------------|--------|
| | Дебет | Кредит | Дебет | Кредит | Дебет | Кредит |
| ДЕНЕЖНЫЙ РЕГИСТР ОБЕСПЕЧЕНИЯ в российских рублях и в иностранной валюте | | | | | | |
| Собственные разделы | | | | | | |
| Движение по разделам в российских рублях | | | | | | |
| Движение по разделам в иностранной валюте | | | | | | |
| Вариационная маржа | | | | | | |
| 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 | | | | | | |
| ИТОГО по ДЕНЕЖНОМУ РЕГИСТРУ ОБЕСПЕЧЕНИЯ в российских рублях и в иностранной валюте | | | | | | |
| ДЕПО РЕГИСТР ОБЕСПЕЧЕНИЯ | | | | | | |
| Собственные разделы | | | | | | |
| Движение по разделам | | | | | | |
| ИТОГО по собств. разделам | | | | | | |
| Суммарно клиентские разделы | | | | | | |
| Движение по разделам | | | | | | |
| ИТОГО по суммарным клиентским регистрам | | | | | | |
| Суммарно разделы ДУ | | | | | | |
| Движение по разделам | | | | | | |
| ИТОГО по разделам ДУ | | | | | | |
| ИТОГО по ДЕПО РЕГИСТРУ ОБЕСПЕЧЕНИЯ | | | | | | |

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

Итого по денежному регистру обеспечения

Итого по депо регистру обеспечения:

в российских рублях и в иностранной валюте:
 на конец дня: в российских рублях
 в иностранной валюте
 Гарантийное обеспечение в российских рублях
 и в иностранной валюте
 сумма свободных средств в российских рублях
 и в иностранной валюте

на конец дня
 Гарантийное обеспечение
 сумма свободных средств

Аналитика "Движение по счету"

| Код разде ла | Дебет | Кредит | Основание | Примечание | | |
|--------------------|-------|--------|-----------|------------|--|--|
| | | | | | | |
| | | | | | | |
| | | | | | | |

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

28. Отчет об обязательствах по поставочным фьючерсным контрактам на облигации

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.
 Имя файла – **DELINFO_OFZ_XX00.xls**.

Структура XLS файла:

В Расчетную фирму _____
Код РФ

Наименование РФ

Уведомление о приближении срока исполнения поставочных фьючерсных контрактов на ценные бумаги с поставкой через ММВБ

Расчетная фирма: *Участник*

дата

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

* – В отчетах информация о сумме НДС является справочной

Всего прошито, пронумеровано и скреплено
печатью 35 (тридцать пять) лист 05

И. о. Председателя Правления Банка
«Национальный Клиринговый Центр»
(Акционерное общество)


Демушкина Е.С.
(подпись)

