

Приложение Ф4  
 к Правилам осуществления клиринговой деятельности  
 ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»  
 на срочном и фондовом рынках

## Спецификация форматов отчетов Клирингового центра, предоставляемых Расчетным фирмам

I.	Отчет о заключенных Сделках .....	225
II.	Отчет о заключенных опционных контрактах .....	227
III.	Отчет об итогах Торгов Инструментами и Связками .....	230
IV.	Отчет об итогах Торгов опционными контрактами .....	232
V.	Отчет об обязательствах по Сделкам.....	234
VI.	Отчет об обязательствах по опционным контрактам.....	236
VII.	Отчет о денежных средствах в рублях, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Средствами обеспечения.....	237
VIII.	Предварительный отчет о денежных средствах в рублях, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Средствами гарантийного обеспечения .....	239
IX.	Отчет об операциях по разделам денежного регистра и депо регистра обеспечения .....	240
X.	Отчет о торговых счетах, закрепленных за разделом регистра учета позиций .....	241
XI.	Отчет о разделах регистра учета позиций .....	242
XII.	Отчет об исполнении Сделок .....	243
XIII.	Отчет о биржевом сборе за Транзакции .....	244
XIV.	Отчет о количестве Транзакций в отношении Сделок и Связок.....	244
XV.	Отчет о заключенных Связках .....	245
XVI.	Информация о Сделках составляющих Связку. ....	247
XVII.	Отчет об иностранной валюте и ценных бумагах, предоставленных в качестве Средств гарантийного обеспечения. ....	248
XVIII.	Сводная финансовая ведомость .....	250
XIX.	Отчёт об обязательствах по Сделкам T+N в разрезе торговых счетов ...	253
XX.	Отчет об обязательствах по поставочным фьючерсным контрактам на облигации федерального займа .....	254

Отчеты I – XVI предоставляются в виде файлов формата FoxPro 2.x.

В имени файлов XX означает код Расчетной фирмы, XXYY – код Брокерской фирмы, XXYYZZZ – код раздела клиринговых регистров.

### Типы полей

Тип	б) 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

В целях настоящего Приложения:

Инструментом именуется предмет и условия сделок, определяемые кодом инструмента :

Сделками в отношении Инструмента именуются сделки, заключенные в отношении предмета сделки и на условиях, определяемых кодом инструмента, а именно:

- Срочный контракт с определенным кодом;
- Сделка T+N с определенной ценной бумагой с определенным сроком исполнения обязательств.

Под торгами Инструментом понимаются заключение соответствующих сделок в Торговой системе.

Сделками купли-продажи именуются сделки купли-продажи ценных бумаг, являющиеся Сделками T+N (Сделки купли-продажи T+N);

Сделками репо T+N именуются сделки репо, являющиеся Сделками T+N;

Сделки репо, заключенные при наличии Необеспеченной позиции Участника клиринга или Клирингового центра по Сделкам T+N, и Сделки репо T+N вместе именуются Сделки репо.

Сделкой именуется:

- Срочный контракт;
- Сделка купли-продажи.
- Сделки купли-продажи ценных бумаг, заключенные при наличии Необеспеченной позиции Участника клиринга или Клирингового центра по Сделкам T+N;
- часть Сделки репо.

Связкой именуется несколько Срочных контрактов и/или Сделок купли-продажи, заключенных на основании одной заявки, или Сделка репо.

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, Сделок купли-продажи и Сделок репо.

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 совершения срочных сделок на Срочном рынке FORTSOAO Московская Биржа.

## I. Отчет о заключенных Сделках

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Брокерской фирме, имя файла - **f04\_XXYY.dbf**.

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

Структура DBF-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, 3 – для фьючерсных контрактов или Сделки купли-продажи T+N, обязательства по которым возникли в ходе проведения процедуры принудительного закрытия позиций 4 – для первой части сделки репо, заключенной при наличии Необеспеченной позиции Участника клиринга, или Клирингового центра по Сделкам T+N, 5 – для второй части сделки репо, заключенной при наличии Необеспеченной позиции Участника клиринга или Клирингового центра по Сделкам T+N, 7 – для сделки купли-продажи, заключенной в соответствии с Правилами клиринга при наличии Необеспеченной позиции Участника клиринга или Клирингового центра по Сделкам T+N, 8 – для сделки исполнения поставочного фьючерсного контракта (Сделка T+N), 9 – для первой части Сделки репо T+N, 10 – для второй части Сделки репо T+N, 11 – не является сделкой. Данные отображают информацию о прекращении обязательств в

		указанном объеме,
var_marg_b	numeric(16,2)	Обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи по фьючерсным контрактам / Гарантийного перевода по Сделке (в рублях РФ)
var_marg_s	numeric(16,2)	Обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи по фьючерсным контрактам / Гарантийного перевода по Сделке (в рублях РФ)
user_sell	char(20)	Имя (наименование) Продавца
user_buy	char(20)	Имя (наименование) Покупателя
no_buy	numeric(10)	Идентификационный номер Заявки, поданной Покупателем, на основании которой заключена Сделка
no_sell	numeric(10)	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)	Идентификационный номер второй части Сделки репо для первой части Сделки репо или номер первой части Сделки репо для второй части Сделки репо
fee_ex_b	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Покупателем (в рублях РФ)
vat_ex_b	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе биржевого сбора, подлежащего уплате Покупателем (в рублях РФ)*
fee_cc_b	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Покупателем (в рублях РФ)
vat_cc_b	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащего уплате Покупателем (в рублях РФ)*
fee_ex_s	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Продавцом (в рублях РФ)
vat_ex_s	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе биржевого сбора, подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ)*
fee_cc_s	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ)
vat_cc_s	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ)*
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(10)	Не используется

Для Сделок, входящих в Связку, поля fee\_buy, fee\_sell, fee\_ex\_b, vat\_ex\_b, fee\_cc\_b, vat\_cc\_b, fee\_ex\_s, vat\_ex\_s, fee\_cc\_s, vat\_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.

## II. Отчет о заключенных опционных контрактах

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Брокерской фирме, имя файла - **o04\_XXYY.dbf**.

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

Структура DBF-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, 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, в следствии 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(10)	Идентификационный номер Заявки, поданной Покупателем, на основании которой заключены опционные контракты
no_sell	numeric(10)	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)	Сумма НДС в составе биржевого сбора, подлежащего уплате Покупателем (в рублях РФ)*
fee_cc_b	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Покупателем (в рублях РФ)
vat_cc_b	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащего уплате Покупателем (в рублях РФ)*
fee_ex_s	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Продавцом (в рублях РФ)
vat_ex_s	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе биржевого сбора, подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ)*
fee_cc_s	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ)
vat_cc_s	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ)*
signs	numeric(10)	Не используется

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.

### III. 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.dbf**.

При предоставлении отчета по итогам вечерней клиринговой сессии имя файла - **f07.dbf**.

Структура DBF-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 в Положении о порядке установления и изменения лимитов колебаний цен сделок и принудительного закрытия Позций, являющемся Приложением Ф5 к Правилам клиринга): 1 – фьючерсный контракт / ценная бумага входит в группу, 0 – фьючерсный контракт / ценная бумага 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 фьючерсконо контракта,

		2 – для поставочного фьючерсного контракта и Сделки T+N
section	char(50)	Наименование Секции срочного рынка
spot	char(50)	“SPOT” – для ценных бумаг, в иных случаях – пустое поле.
base	char(50)	Код ценной бумаги для итогов Торгов ценными бумагами, в иных случаях – пустое поле
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

Код ценной бумаги, указываемый в поле «contract», включает в себя дату исполнения Сделки T+N, заключенной с указанием данного кода ценной бумаги.

Код ценной бумаги, указываемый в полях «base\_fut», «base», соответствует коду ценной бумаги присвоенному Организатором торговли.

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, spot, base для Связок всегда пусты.

#### IV. 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.dbf**.

При предоставлении отчета по итогам вечерней клиринговой сессии имя файла - **o07.dbf**.

Структура DBF-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;

		‘А’ – 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 в ходе 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 в ходе 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

## V. Отчет об обязательствах по Сделкам

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Брокерской фирме, имя файла - **fposXXYY.dbf**.

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

Структура DBF-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 , или Гарантийный перевод по Сделкам, обязательства по которым не прекращены на начало отчетного дня (в рублях РФ)
var_marg_d	numeric(16,2)	Вариационная маржа, или Гарантийный перевод 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)	Сумма всех перечисленных Гарантийных переводов по Сделкам T+N, обязательства по которым не прекращены, с учетом знака (в рублях РФ)
fee_trans	numeric(16,2)	Штраф за наличие Необеспеченной позиции по Сделкам T+N (в рублях РФ)
sbor_ex	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора по Сделкам , заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)
vat_ex	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе биржевого сбора (в рублях

		РФ)*
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)	Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра (в рублях РФ)*

## VI. Отчет об обязательствах по опционным контрактам

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Брокерской фирме, имя файла - **oposXXYY.dbf**.

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

Структура DBF-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)	Сумма НДС в составе биржевого сбора (в рублях РФ)*
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)	Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра (в рублях РФ)*

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

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Брокерской фирме, имя файла - **monXXYY.dbf**.

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

Структура DBF-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 денежного регистра (депо регистра обеспечения)
account	char(2)	Признак Средств обеспечения: 'RF' – суммарные средства Расчетной фирмы; 'BF' – суммарные средства Брокерской фирмы;

		'CL' – средства, учитываемые на разделе денежного регистра (депо регистра обеспечения)
type	char(2)	Тип Средств обеспечения: 'MN' – денежные средства в рублях Российской Федерации; 'PL' – ценные бумаги или иностранная валюта
amount_beg	numeric(16,2)	Сумма денежных средств (оценочная стоимость ценных бумаг или иностранной валюты) на начало отчетного дня (в рублях РФ)
var_marg	numeric(16,2)	Сумма обязательств по перечислению Вариационной маржи и Гарантийных переводов (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 Российской Федерации (оценочной стоимости ценных бумаг или иностранной валюты) 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 (оценочная стоимость ценных бумаг или иностранной валюты) на конец отчетного дня (в рублях РФ)
free	numeric(16,2)	Сумма свободных денежных средств (оценочная стоимость свободных ценных бумаг или свободной иностранной валюты) (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)	Сумма НДС в составе биржевого сбора (в рублях РФ)*
sbor_cc	numeric(16,2)	Сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра (в рублях РФ)
vat_cc	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра (в рублях РФ)*



Оценочная стоимость ценных бумаг или иностранной валюты, указываемая в полях «amount\_beg» и «amount\_end», определяется в соответствии с Методикой выбора и оценки иностранной валюты и ценных бумаг, принимаемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, утверждаемой Клиринговым центром.

В файле monXX00.dbf отображаются:

- общая сумма соответствующего актива Средств 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 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.

### **VIII. Предварительный отчет о денежных средствах в рублях, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Средствами гарантийного обеспечения**

Отчет предоставляется по итогам дневной клиринговой сессии.  
Имя файла - **daymonXXYY.dbf**.

Структура DBF-файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	date	Дата проведения клиринга
kod	char(7)	Код Расчетной фирмы / Брокерской фирмы / раздела денежного регистра (депо регистра обеспечения)
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)
type	char(2)	Тип Средств гарантийного обеспечения: 'MN' –денежные средства; 'PL' –ценные бумаги или иностранная валюта, выраженные в рублях РФ
amount_beg	numeric(16,2)	Сумма денежных средств (ценных бумаг) на начало отчетного дня (в рублях РФ)
var_marg	numeric(16,2)	Сумма обязательств по перечислению Вариационной маржи и Гарантийных переводов 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 (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)	Не используется
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 (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 (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

### IX. 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.dbf**.

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

Структура DBF файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	date	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 / иностранная валюта, являющиеся Средствами гарантийного обеспечения, выраженные в рублях РФ
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(254)	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.

#### **Х. Отчет о торговых счетах, закрепленных за разделом регистра учета позиций**

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **delinfoXX00.dbf**.

Структура DBF-файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	date	Дата проведения клиринга
kod	char(7)	Код раздела регистра учета позиций
account	char(2)	Признак раздела: Всегда 'CL'
code_rdep	char(10)	Код Расчетного депозитария
depo_acc	char(32)	Номер торгового счета депо
code_rorg	char(10)	Код Расчетной организации
money_acc	char(20)	Номер денежного торгового счета
check	numeric(1)	Возможность проведения расчетов по торговым счетам / Поставочным счетам: 0 - проведение расчетов невозможно;

		1 - проведение расчетов возможно.
id	char(12)	Идентификатор Участника торгов на ЗАО «ФБ ММВБ» для поставки по контрактам на ОФЗ
shortname	char(12)	Краткое наименование Участника торгов на ЗАО «ФБ ММВБ» для поставки по контрактам на ОФЗ

## XI. Отчет о разделах регистра учета позиций

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – **clientsXX00.dbf**.

Структура DBF-файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	date	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(30)	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
spot	numeric(1)	Возможность заключения Сделок T+N: 0 – заключение Сделок T+N не возможно, 1 – заключение Сделок T+N возможно
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
segr	numeric(1)	Признак Обособленной Брокерской фирмы 0 – не является Обособленной Брокерской фирмой 1 – является Обособленной Брокерской фирмой
isrepo	numeric(1)	Признак возможности заключения Сделки репо при наличии Необеспеченной позиции по Сделкам T+N 0 – заключение сделки репо не возможно, 1 – заключение Сделки репо возможно

## ХII. Отчет об исполнении Сделок

Отчет предоставляется по итогам первого и второго (в случае его проведения) этапа формирования клирингового пула.

При предоставлении отчета по итогам первого этапа формирования клирингового пула имя файла - **delivery\_step1XX00.dbf**.

При предоставлении отчета по итогам второго этапа формирования клирингового пула имя файла - **deliveryXX00.dbf**.

Структура DBF-файлов:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	date	Дата проведения клиринга
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	numeric(11)	Количество Инструментов в заключенных Сделках, обязательства по которым подлежат исполнению на начало данного этапа формирования клирингового пула (в штуках)
pos_iskl	numeric(11)	Всегда равно 0
pos_neisp	numeric(11)	Количество Инструментов в заключенных Сделках, обязательства по которым не включены в клиринговый пул в ходе данного этапа его формирования (в штуках)
neisp	numeric(11)	Признак наличия обязательств, не включенных в клиринговый пул в ходе данного этапа его формирования: 0 – все обязательства включены в клиринговый пул, 1 – есть обязательства, не включенные в клиринговый пул
settl_pair	char(7)	Код торговых счетов, закрепленных за разделом (необязательное поле)
asset_code	char(25)	Код ценной бумаги, присвоенный Организатором торговли, в отношении которой заключена Сделка Т+N или являющейся базовым активом фьючерсного контракта
issue_code	char(25)	Код ценной бумаги в расчетном депозитарии
oblig_rur	numeric(18,2)	Объём обязательств по оплате ценных бумаг на начало данного этапа формирования клирингового пула (в рублях РФ)
oblig_uni	numeric(18)	Объём обязательств по перерегистрации ценных

		бумаг на начало данного этапа формирования клирингового пула (в штуках)
fulfil_rur	numeric(18,2)	Объём обязательств по оплате ценных бумаг, включенных в клиринговый пул в ходе данного этапа его формирования (в рублях РФ)
fulfil_uni	numeric(18)	Объём обязательств по перерегистрации ценных бумаг, включенных в клиринговый пул в ходе данного этапа его формирования (в штуках)
step	numeric(11)	Порядковый номер этапа формирования клирингового пула

### ХIII. Отчет о биржевом сборе за Транзакции

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

Структура DBF-файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	date	Дата проведения клиринга
kod	char(7)	Код Расчетной фирмы / Брокерской фирмы / раздела регистра учета позиций
account	char(2)	Признак обязательств: 'RF' – суммарные обязательства Расчетной фирмы; 'BF' – суммарные обязательства Брокерской фирмы; 'CL' – обязательства, учитываемые на разделе регистра учета позиций
futopt	numeric(1)	Признак биржевого сбора за транзакции: F – по фьючерсным контрактам, O – по опционным контрактам
mm	numeric(1)	Признак маркет-мейкерства: 1 - маркет-мейкер, 0 – не маркет-мейкер
addr	numeric(10)	Количество Транзакций в отношении Сделок / Связок, совершенных с указанием данного раздела регистра учета позиций / разделов регистра учета позиций данной БФ / разделов регистра учета позиций данной РФ
fee	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора по разделу регистра учета позиций / БФ / РФ (в рублях РФ)
sbortr	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора за транзакции по разделу регистра учета позиций / БФ / РФ за отчетный торговый день (в рублях РФ)
vat_sbortr	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе биржевого сбора за транзакции (в рублях РФ)*

### ХIV. Отчет о количестве Транзакций в отношении Сделок и Связок.

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.  
 При предоставлении отчета о количестве Транзакций в отношении фьючерсных контрактов и Сделок T+N имя файла - **tranfXXYY.dbf**.

При предоставлении отчета о количестве Транзакций в отношении опционных контрактов имя файла - **tranoXXYY.dbf**.

Структура DBF-файла:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	date	Дата проведения клиринга
kod	char(7)	Код Расчетной фирмы / Брокерской фирмы / раздела регистра учета позиций
account	char(2)	Признак обязательств: 'RF' – суммарные обязательства Расчетной фирмы; 'BF' – суммарные обязательства Брокерской фирмы; 'CL' – обязательства, учитываемые на разделе регистра учета позиций
isin	char(25)	Код (обозначение) Инструмента.
mm	numeric(1)	Признак маркет-мейкерства: 1 - маркет-мейкер, 0 – не маркет-мейкер
addr	numeric(10)	Количество Транзакций в отношении Сделок / Связок, совершенных с указанием данного раздела регистра учета позиций / разделов регистра учета позиций данной БФ / разделов регистра учета позиций данной РФ

## XV. Отчет о заключенных Связках

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

При формировании отчета по Брокерской фирме, имя файла - multilegf04\_XXYY.dbf.

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

Структура DBF-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: 0 – для Сделки репо, заключенной на основании безадресной Заявки, 1 – для Сделки репо, заключенной на основании адресной Заявки, 2 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки (кроме Сделок репо) 3 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании безадресной Заявки (кроме Сделок репо)
signs	numeric(10)	не используется
var_marg_b	numeric(16,2)	Обязательства Покупателя по уплате Гарантийного перевода по Связке (в рублях РФ)
var_marg_s	numeric(16,2)	Обязательства Продавца по уплате Гарантийного перевода по Связке (в рублях РФ)
user_sell	char(20)	Имя (наименование) Продавца по Связке
user_buy	char(20)	Имя (наименование) Покупателя по Связке
no_buy	numeric(10)	Идентификационный номер Заявки по Связке, поданной Покупателем, на основании которой заключена Связка
no_sell	numeric(10)	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)	Сумма НДС в составе биржевого сбора, подлежащего уплате Покупателем (в рублях РФ)
fee_cc_b	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Покупателем (в рублях РФ)
vat_cc_b	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащего уплате Покупателем (в рублях РФ)
fee_ex_s	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Продавцом (в рублях РФ)
vat_ex_s	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе биржевого сбора, подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ)
fee_cc_s	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Продавцом (в рублях РФ)
vat_cc_s	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащего уплате Продавцом (в рублях РФ)
id_trade	numeric(10)	Идентификационный номер первой Сделки в Связке
price_rur2	numeric(16,5)	Сумма второй части Сделки репо T+N

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

Для Связок, не являющихся Сделками репо, поле price\_rur2 всегда пустое.

#### **XVI. Информация о Сделках составляющих Связку.**

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.  
 Имя файла – multileg\_dict.dbf.

Структура DBF-файлов:

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

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).

### **XVII. Отчет об иностранной валюте и ценных бумагах, предоставленных в качестве Средств гарантийного обеспечения.**

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.

Имя файла – moncb.dbf.

Структура DBF-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(10)	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 или 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»)
--	--	--

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

### XVIII. Сводная финансовая ведомость

Отчет предоставляется по итогам вечерней клиринговой сессии.  
 Имя файла – **F14XXYY.xls**.

Структура XLS файла:

**ЗАО АКБ "Национальный Клиринговый Центр"**  
 Сводная финансовая ведомость за  
 по Расчетной фирме N

Наименование регистра	Баланс на начало дня		Оборот за день		Баланс на конец дня	
	Дебет	Кредит	Дебет	Кредит	Дебет	Кредит
<b>ДЕНЕЖНЫЙ РЕГИСТР в рублях РФ</b>						
Собственные разделы						
Движение по разделам						
Вариационная маржа						
Гарантийный перевод						
Премия по опционам						
Бирж. сбор						
в т.ч. НДС*						
Комиссионное вознаграждение КЦ						
в т.ч. НДС*						
<b>ИТОГО по собств. разделам</b>						
Суммарно клиентские разделы						
Движение по разделам						
Вариационная маржа						
Гарантийный перевод						
Премия по опционам						

Бирж. сбор в т.ч. НДС*						
Комиссионное вознаграждение КЦ в т.ч. НДС*						
<b>ИТОГО по клиентским разделам</b>						
Суммарно разделы ДУ Движение по разделам Вариационная маржа Гарантийный перевод Премия по опционам Бирж. сбор в т.ч. НДС* Комиссионное вознаграждение КЦ в т.ч. НДС*						
<b>ИТОГО по разделам ДУ</b>						
<b>ИТОГО по ДЕНЕЖНОМУ РЕГИСТРУ в рублях РФ</b>						
<b>ДЕПО РЕГИСТР ОБЕСПЕЧЕНИЯ и ДЕНЕЖНЫЙ РЕГИСТР в иностранной валюте</b>						
Собственные разделы Движение по разделам <b>ИТОГО по собств. разделам</b>						
Суммарно клиентские разделы Движение по разделам <b>ИТОГО по суммарным клиентским регистрам</b>						
Суммарно разделы ДУ Движение по разделам <b>ИТОГО по разделам ДУ</b>						
<b>ИТОГО по ДЕПО РЕГИСТРУ ОБЕСПЕЧЕНИЯ и ДЕНЕЖНОМУ РЕГИСТРУ в иностранной валюте</b>						

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

Итого по денежному регистру в рублях РФ:

Итого по депо регистру обеспечения и  
денежному регистру в иностранной  
валюте:

на конец дня  
**Гарантийное обеспечение**  
 сумма свободных средств  
 сумма вноса в СФ  
 сумма к внесению (задолженность)  
 сумма к внесению по разделам ДУ  
 в том числе задолженность перед СФ  
 в том числе задолженность перед ФОО  
 в том числе задолженность перед РФ  
 в том числе задолженность перед СФПУ

На конец дня  
**Гарантийное обеспечение**  
 сумма свободных средств

Аналитика "Движение по счету"

Код разде ла	Дебе т	Креди т	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 иностранной валюты и ценных бумаг, принимаемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, утверждаемой Клиринговым центром.

### **XIX. Отчёт об обязательствах по Сделкам T+N в разрезе торговых счетов**

Отчет предоставляется в 16:05.

Имя файла – **DXXYY.xls**.

Структура XLS файла:

Отчёт о количестве активов, требуемых для поставки по сделкам T+n				Дата
по участнику <i>Участник</i>				
Торговый счёт для поставки	Цена ценной бумаги для расчета обязательства по поставке	Актив	Нетто-требования (к получению)	Нетто-обязательства (к поставке)

**XX. Отчет об обязательствах по поставочным фьючерсным контрактам на облигации федерального займа**

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