1. **Новый отчет. Файл riskposXXYY.csv - информация о позиционном состоянии расчетной фирмы (РФ) / брокерской фирмы (БФ) и их клиентов по инструментам risk, фьючерсам, опционам и инструментам Standard, где XXYY – код брокерской фирмы. Файл формата CSV.**

В отчет включены как действующие поручения на управление риском (инструмент risk), так и позиции по фьючерсам, опционам, инструментам Standard.

Структура файла **riskposXXYY.csv**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Название поля | Тип поля | Описание поля |
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| kod | char(7) | Код 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’ – инструмент risk, ’F’ – фьючерсный контракт, ’O’ – опционный контракт, ’S’ – инструмент Standard) |
| pos\_beg | numeric(11) | Позиций на начало дня |
| pos\_end | numeric(11) | Позиций на конец дня |
| go\_brutto | numeric(16,2) | Брутто-ГО (руб.) |
| fee\_risk | numeric(16,2) | Сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра по инструментам risk(руб.) |
| sbor | numeric(16,2) | Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра (руб.) за исключением инструментов risk |

Примечание:

1. Ключевые поля date, kod, account, isin
2. Для РФ поля pos\_beg и pos\_end вычисляются как нетто-позиция по РФ и всем ее клиентам, включая БФ и всех их клиентов.
3. Для БФ поля pos\_beg и pos\_end вычисляются как нетто-позиция по БФ и всем ее клиентам
4. Для РФ поле go\_brutto вычисляются как сумма полей go\_brutto по всем ее БФ.
5. Для БФ поле go\_brutto вычисляются как брутто-ГО по всем клиентам БФ.
6. **Новый отчет. Файл tofxXXYY.csv – информация о привязке счетов брокерской фирмы (БФ) на срочном рынке к расчетному коду участника клиринга на валютном рынке, где XXYY – код брокерской фирмы. Файл формата CSV.**

Структура файла tofxXXYY.csv

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Название поля | Тип поля | Описание поля |
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| kod\_bf | char(7) | Код клирингового раздела Брокерской фирмы на Срочном рынке |
| kod\_tks | char(12) | Расчетный код на Валютном рынке |

1. **Новый отчет. Файл toeqXXYY.csv – информация о привязке счетов на срочном рынке и на фондовом рынке, где XXYY – код брокерской фирмы. Файл формата CSV.**

Структура файла toeqXXYY.csv

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Название поля | Тип поля | Описание поля |
| date | char(10) | Дата проведения клиринга |
| kod | char(7) | Код клирингового раздела РФ/БФ/клиента на Срочном рынке |
| account | char(2) | Признак РФ/БФ/клиента ('RF' - РФ; 'BF' - БФ; 'CL' - клиент) на срочном рынке |
| kod\_tks | char(12) | Код Торгово-клирингового счета на Фондовом рынке |
| kod\_client | char(12) | Краткий код клиента участника торгов на Фондовом рынке |

1. **Изменения в отчете clientsXX00.csv (Информация о разделах регистра учета позиций расчетной фирмы (РФ), включая все ее брокерские фирмы, где XX – код расчетной фирмы.)**

Добавляются два новых поля rk и rk\_type, указываемые для БФ и РФ:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| rk | char(5) | Расчетный код на уровне Брокерской фирмы |
| rk\_type | char(1) | Тип Расчетного кода на уровне Брокерской фирмы:  «L» - Собственный  «S» - Клиентский  «D» - ДУ  «B» - Не принадлежащий ни одному из перечисленных типов |

1. **Изменения в отчете f04\_XXYY.csv (Отчет о заключенных сделках)**

В отчет добавляются зарегистрированные поручения на управление риском (сделки по **инструментам risk**). Для сделок по **инструментам risk** добавляется значение в полях:

- type (Тип сделки: 16 – сделка по инструменту risk)

1. **Изменения в отчетах monXXYY.csv и daymonXXYY.csv (Отчеты о денежных средствах в рублях, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Средствами обеспечения)**

Добавляется признак ‘RK’ – расчетный код в поле account. Новый уровень агрегации для РФ.

В поле kod появляется Расчетный код для признака.

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| kod | char(7) | код /РФ/БФ/клиента/расчетный код |
| account | char(2) | признак РФ/БФ/клиента/расчетного кода ( 'RF' - РФ; 'BF' - БФ; 'CL' - клиент, ‘RK’ – расчетный код) |

1. **Примечания:**

* Инструмент risk добавляется в отчет f07.csv (Отчет об итогах Торгов Инструментами и Связками)
* Сделки по инструменту **risk *не* добавляются** в отчет fut\_deal.csv (Публичный анонимный отчет о сделках за день)