

Формы клиринговых отчетов

Оглавление

| | |
|--|-----|
| Оглавление | 113 |
| Перечень изменений..... | 114 |
| Форматы XML документов | 117 |
| Пролог XML документа..... | 118 |
| Элементы XML документа..... | 118 |
| Атрибуты элементов XML документа..... | 118 |
| Условные обозначения | 118 |
| Типы данных..... | 119 |
| Документы Системы электронного документооборота в формате XML | 119 |
| Спецификация форматов отчетов | 119 |
| MFB06 Отчет об обязательствах, допущенных в клиринг (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг)..... | 119 |
| MFB06C Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг (по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга) | 127 |
| MFB13 Отчет об итоговых нетто-обязательствах/нетто-требованиях | 134 |
| MFB14 Отчет о Гарантийном обеспечении, Маржинальном требовании и Задолженности | 136 |
| MFB15 Отчет по обязательствам Участника клиринга по комиссионному вознаграждению | 138 |
| MFB20 Уведомление о торгово-клиринговых счетах Участника клиринга | 141 |
| MFB21 Уведомление о счетах для вывода денежных средств Участника клиринга | 143 |
| MFB22 Отчет о требованиях по погашению задолженности по денежному регистру» | 145 |
| MFB23 Отчет об обязательствах по договорам | 146 |
| MFB23C Уведомление об обязательствах по Договорам (по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга)..... | 148 |
| MFB76 Отчет о взносах в Гарантийный фонд | 150 |
| MFB82 Уведомление о зарегистрированных кодах/кратких кодах клиентов Участника клиринга и (или) Участника клиринга | 151 |
| MFB98 Отчет о глобальных операциях и об обязательствах/требованиях по передаче дохода | 153 |
| MFB98A Уведомление о размере обязательств/требований по передаче Дохода..... | 155 |
| MFB99 Отчет об обеспечении..... | 157 |

Перечень изменений

| Дата изменений | Версия формата | Описание изменений |
|----------------|----------------|---|
| 21.07.2014 | 2 | <ul style="list-style-type: none"> Изменен формат и набор возможных значений для атрибута BoardId элемента BOARD отчетов MFB06 и MFB06C В отчете MFB23 обязательства по Аналитическому ТКК (SUBACCOUNT) перенесены в элемент SUBRECORDS Атрибут PosExec для дочернего элемента SUBRECORDS элемента SUBACCOUNT отчета MFB023 заменен на два атрибута PosExecDebit и PosExecCredit Набор возможных значений для атрибута DebtsType отчета MFB22 дополнен значением BANK |
| 08.08.2014 | 2 | <ul style="list-style-type: none"> Изменена структура отчета MFB23 в части отображения позиций по аналитическим ТКК Добавлен тип обязательств FEE для отчетов MFB13, MFB23 и MFB23C Добавлен тип комиссии 6 и признак Executed в отчет MFB15 |
| 19.08.2014 | 2 | <ul style="list-style-type: none"> Добавлены примеры отчетов без данных |
| 12.09.2014 | 2 | <ul style="list-style-type: none"> Добавлен элемент CURRENCY в отчет MFB15 |
| 17.09.2014 | 2 | <ul style="list-style-type: none"> Изменен список типов инструментов для отчетов MFB06, MFB06C |
| 16.10.2014 | 2 | <ul style="list-style-type: none"> Изменен формат отчета MFB76 для учета различных типов активов в ГФ Отчеты MFB06 и MFB06C. Добавлены новые типы сделок урегулирования Отчет MFB99. Добавлены новые типы штрафов Отчеты MFB06 и MFB06C. Добавлены поля FineDebit и FineCredit, поле VarMargin заменено на VarMarginDebit, VarMarginCredit Отчет MFB98. Добавлено поле TaxRate |
| 06.11.2014 | 2 | <ul style="list-style-type: none"> Отчет MFB20. Добавлен атрибут ExtraDefaultClient |
| 11.11.2014 | 2 | <ul style="list-style-type: none"> Отчет MFB06 и MFB06C. Добавлены атрибуты RepoRate и PriceType |
| 18.11.2014 | 2 | <ul style="list-style-type: none"> Отчеты MFB06, MFB06C. Добавлены атрибуты BalanceSecurityId, FaceValue, SecurityType, SecCurrencyId Добавлен отчет-уведомление MFB98A |
| 09.03.2015 | 3 | <ul style="list-style-type: none"> Отчеты MFB06, MFB06C, добавлен атрибут TradePeriod, добавлена формула расчета значения атрибута Price2 Отчет MFB20, добавлен атрибут BrokerFeeAccount. Отчет MFB82, добавлены атрибуты CheckCrossMarket, IndividualInvestmentAccount. Отчет MFB99, добавлен атрибут Purpose |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | |
|------------|---|--|
| 20.06.2015 | 3 | <p>Добавлена информация о действиях при проведении корпоративного события:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Отчет MFB06, MFB06C: добавлен атрибут CorpEvent • Отчет MFB23, MFB23C: добавлены атрибуты DebitCorpEvCorrection, CreditCorpEvCorrection, DebitIntraday, CreditIntraday • Отчет MFB98, MFB98A: добавлены атрибуты RecordDate, PaymentDate, |
| | 4 | <p>Отчет MFB06, MFB06C:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Расширен список клиринговых сессий • Расширен список режимов торгов • Исключен атрибут TradeLegNo • Добавлены атрибуты PaymentDetails, DeliveryDetails для сделок в режимах без ЦК <p>Отчет MFB13</p> <ul style="list-style-type: none"> • Исключен атрибут DataType • Добавлен опциональный атрибут Shortage <p>Отчет MFB20</p> <ul style="list-style-type: none"> • добавлен атрибут SeparateAccounting • добавлен атрибут ForNonCcpAccounting • добавлен опциональный атрибут TrustClientIdentifier • расширен список типов ТКС <p>Отчет MFB82</p> <ul style="list-style-type: none"> • добавлен атрибут IdentificationCode <p>Отчет MFB98</p> <ul style="list-style-type: none"> • расширен список типов дополнительных обязательств • добавлен атрибут NewSecurityId • добавлен атрибут NewSecShortName • добавлен атрибут NewISIN <p>Отчет MFB99</p> <ul style="list-style-type: none"> • добавлен атрибут CustomerNoc • изменен список видов операций с обеспечением <p>Отчеты MFB23, MFB23C:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Добавлен новый тип обязательств ADDITION в атрибут DataType |
| 25.04.2016 | 4 | <p>Отчет MFB06 и MFB06</p> <ul style="list-style-type: none"> • Добавлен атрибут SpecialPeriod • Добавлен режим торгов RFQ <p>Отчет MFB15</p> <ul style="list-style-type: none"> • Добавлен тип комиссии 8 – за списание с Торгового счета/Субсчета депо ценных бумаг иностранного эмитента, учитываемых в качестве Средств обеспечения Участника клиринга, на основании поручения на списание ценных бумаг в количестве, превышающем совокупное количество ценных бумаг данного иностранного эмитента, внесенных в качестве Средств |

Спецификация клиринговых отчетов

| обеспечения данным Участником клиринга | | |
|--|---|---|
| 05.03.2018 | 4 | <p>Отчет MFB06 и MFB06C</p> <ul style="list-style-type: none"> • Добавлены атрибут FirmINN в корневой элемент MFB06 и FirmTradeINN в элемент FIRM • Расширен список значений для атрибута ClearingType элемента CLEARINGTYPE • Для элемента SESSION добавлен опциональный атрибут ClearingTime , исключен атрибут Session • Исключен атрибут BalanceSecurityId элемента SECURITY • В отчет включены Поручения на клиринг внебиржевых договоров по заключенным Конверсионным договорам и Договоры OTC/ Договоры репо OTC • Добавлены новые группы инструментов в элемент BOARD • Добавлены режимы торгов в атрибуты TradeModeID, TradeModeName • Добавлены атрибуты PrimaryTradeNo и PrimaryOrderID, IsExtraLiquidity, ConversionRate, CPFirmDetails, RepositoryNumber • Расширен список значений для атрибута SpecialPeriod • Атрибут Amount может изменяться при пересчете обязательств, в случае если валюта договора не совпадает с валютой расчета, добавлен атрибут AmountOTC • Исключен атрибут TradePart элемента RECORD • Изменен комментарий с алгоритмом расчета цены второй части РЕПО с учетом договоров с облигациями • Атрибут TradePeriod элемента RECORD сделан необязательным <p>Отчет MFB15</p> <ul style="list-style-type: none"> • Добавлено описание новых типов комиссии <ul style="list-style-type: none"> ○ 9 – комиссия за прием Поручений на клиринг внебиржевых договоров по заключенным Конверсионным договорам с уплатой в день приема поручения ○ 10 – комиссия за прием Поручений на клиринг внебиржевых договоров по заключенным Конверсионным договорам с уплатой в день исполнения Конверсионного договора ○ 12 – комиссия за договора репо, заключённые в Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» на основании Заявок репо, в которых указаны Торгово-клиринговые счета, зарегистрированные на одного Участника торгов <p>Отчет MFB20</p> <ul style="list-style-type: none"> • Добавлены атрибуты DateCreated и DateDeleted, FeeClutch, OtcSettlementCurrency <p>Отчет MFB99</p> <ul style="list-style-type: none"> • Добавлены новые типы операций в атрибут OperationType элемента ENTRY • Добавлены атрибут ClientCode элемента ENTRY • Исключен атрибут TrdAccId • Тип атрибута OperationTime изменен на Time <p>Отчет MFB13</p> <ul style="list-style-type: none"> • Добавлен элемент SESSION с атрибутами, описывающими клиринговый пул |
| 28.03.2018 | 4 | Отчеты MFB06 и MFB06C |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | |
|------------|---|--|
| | | <ul style="list-style-type: none"> • Добавлено значение P в атрибут TradeType • Добавлено значение M в атрибут CorpEvent |
| 20.06.2018 | 4 | <p>Отчеты MFB06 и MFB06C</p> <ul style="list-style-type: none"> • Добавлена поддержка «пары договоров» <p>Отчет MFB20</p> <ul style="list-style-type: none"> • Добавлен атрибут RepoUnavailable |
| 05.10.2018 | 4 | <p>Отчеты MFB99 и MFB15</p> <ul style="list-style-type: none"> • Добавлены новые типы комиссионных сборов <p>Отчет MFB99</p> <ul style="list-style-type: none"> • Добавлен атрибут OpeningDebtsSum для отображения входящей задолженности по денежному регистру <p>Отчеты MFB06, MFB06C</p> <ul style="list-style-type: none"> • Исключен атрибут ISExtraLiquidity |
| 30.10.2018 | 4 | <p>Отчеты MFB06, MFB06C</p> <ul style="list-style-type: none"> • Скорректировано описание атрибутов PrimaryOrderId, OrderId |
| 08.11.2018 | 4 | <p>Отчеты MFB06, MFB06C</p> <ul style="list-style-type: none"> • Добавлено значение MORN для атрибута TradePeriod для отображения дополнительной утренней торговой сессии • Добавлены атрибуты CCPCode, CCPName, CCPDetails, CPFirmDetails <p>Отчет MFB82</p> <ul style="list-style-type: none"> • Изменено описание атрибута IdentificationCode добавлен атрибут Principal для идентификации лица, для которого зарегистрированы коды (учетный регистр) – клиент Участника клиринга или Участник клиринга <p>Отчет MFB99</p> <p>Добавлены два новых типа комиссий</p> <ul style="list-style-type: none"> • 34 - списание клиринговой комиссии за проведение расчетов по итогам клиринга договоров • 35 - списание биржевой комиссии за торговлю в дополнительную утреннюю сессию |

Форматы XML документов

Обмен информацией между клиентским и серверным приложениями происходит сообщениями в формате XML версии 1.0. Полная спецификация языка XML версии 1.0 приводится в документе Extensible Markup Language (XML) 1.0 (Second Edition), разработанном W3C и опубликованном в сети Интернет адресу <http://www.w3.org/TR/REC-xml>.

В главе приводится краткое описание структуры XML документа версии 1.0.

Пролог XML документа

Пролог XML документа предназначен для описания глобальных параметров XML документа, а также для передачи инструкций программе обработки данного документа. Пролог может содержать несколько инструкций, каждая из которых начинается с последовательности символов <? и заканчивается последовательностью символов ?> Первой строкой пролога всегда идёт объявление XML с указанием кодировки символов, используемых в документе.

Пример пролога:

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<?xml-stylesheet type="text/xsl" href="form_individual.xsl"?>
```

, где первая строка – это объявление XML с указанием используемой кодовой таблицы, вторая строка – инструкция программе обработки сообщения.

Ограничение: кодировка документа должна быть исключительно “UTF-8”.

Элементы XML документа

Каждый XML документ содержит один или несколько элементов, границы которых обозначаются либо парой начальный тэг (<elem>) - конечный тэг (</elem>), либо тэгом пустого элемента (<elem />), если элемент не имеет содержимого. Содержимым элемента называется текст между начальным и конечным тэгами. Каждый элемент имеет определенный тип, который опознается по имени и называется "общим идентификатором" элемента. Тип элемента в конечном тэге должен соответствовать типу элемента в начальном тэге. Каждый элемент может иметь набор спецификаций атрибутов. Каждая спецификация атрибута имеет имя и значение. Имя атрибута в начальном тэге или тэге пустого элемента может присутствовать только один раз.

Пример непустого элемента без атрибутов:

```
<elem> содержание элемента </elem>
```

Пример пустого элемента с двумя атрибутами:

```
<elem attr1="значение атрибута 1" attr2="значение атрибута 2" />
```

Документ XML всегда содержит один единственный корневой элемент, который включает в себя любое число других элементов. Каждый элемент может содержать любое количество других элементов. Такие документы называются дочерними элементами по отношению к данному элементу.

Пример дочернего элемента:

```
<parent>
<child> содержание дочернего элемента </child>
</parent>
```

Атрибуты элементов XML документа

Каждый элемент может содержать любое количество атрибутов. Атрибуты предназначены для передачи дополнительной информации об элементе. Атрибуты могут располагаться только в начальных тэгах и тэгах пустых элементов сразу после имени элемента в виде пар атрибут – значение. Значения атрибутов не могут содержать символов левая угловая скобка (<), правая угловая скобка (>), амперсанд (&), апостроф (') и двойная кавычка ("). Данные символы кодируются последовательностями "<", ">", "&", "'", """ соответственно.

Пример пустого элемента с атрибутом:

```
<elem attr="значение атрибута" />
```

Условные обозначения

В таблицах, описывающих прикладные и служебные элементы, в колонке **М/О** символ **М** означает, что соответствующий атрибут или подэлемент является обязательным, а символ **О** – что необязательным. Если какой-либо элемент не указывается, то его атрибуты также не указываются, даже если помечены как обязательные.

В колонке **Rev** указывается номер версии спецификации отчетов, в котором введен в действие данный элемент/атрибут.

Типы данных

| Тип | Описание |
|--------------|--|
| Integer | Целочисленное значение |
| Boolean | Логическое значение (True или False) |
| Numeric(M,N) | Вещественное значение с фиксированной точкой |
| Char | Один символ (символы кириллицы не допускаются) |
| String(M-N) | Строковое значение (символы кириллицы не допускаются) M-минимально допустимое число символов. Если не указано, то поле фиксированной длины N-максимально допустимое число символов |
| WString(M-N) | Строковое значение, включая символы кириллицы M-минимально допустимое число символов. Если не указано, то поле фиксированной длины N-максимально допустимое число символов |
| Date | Дата. Строка в формате: YYYY-MM-DD |
| Time | Время. Строка в формате: hh:mm:ss |
| DateTime | Дата и время. Строка в формате: YYYY-MM-DD hh:mm:ss.cc |

Документы Системы электронного документооборота в формате XML

Для сообщений Системы электронного документооборота в формате XML корневой элемент имеет значение **RTS_DOC**

Каждое сообщение Системы электронного документооборота (включая отчеты МФБ) имеет следующую структуру

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|-------------------|--|-----|----------------|
| RTS_DOC | | Корневой элемент (root element) XML документа | M | |
| DOC_REQUISITES | | Блок информации о документе | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | Идентификатор типа документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | Код отправителя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-120) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | O | |
| < Идентификатор типа документа в Системе электронного документооборота /> | | Дочерний элемент, содержащий бизнес-данные документа | M | Элемент |
| /RTS_DOC | | Корневой элемент | M | |

Спецификация форматов отчетов

МФВ06 Отчет об обязательствах, допущенных в клиринг (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг)

Отчет по Участнику клиринга.

Формируется по итогам клиринга для расчетов по итогам торгов.

Спецификация клиринговых отчетов

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Rev | Тип |
|-------------------|-------------------|--|-----|-----|----------------|
| RTS_DOC | | Корневой элемент (root element) XML документа | M | 1 | |
| DOC_REQUISITES | | Блок информации о документе | M | 1 | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | 1 | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа | M | 1 | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | Всегда MFB06 | M | 1 | String(0-20) |
| | SENDER_ID | Всегда MFBIM | M | 1 | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | 1 | WString(0-120) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | 1 | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| MFB06 | | Блок данных отчета | M | 1 | |
| | ReportDate | Дата отчета | M | 1 | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | 1 | WString(0-128) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | 1 | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | 1 | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | 1 | String(0-16) |
| | FirmName | Наименование Участника клиринга | M | 1 | WString(0-120) |
| | FirmINN | ИНН Участника клиринга | O | 4 | String(0-12) |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | 1 | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | O | 1 | String(0-16) |
| | FirmTradeINN | ИНН Участника торгов | O | 4 | String(0-12) |
| CURRENCY | | Блок данных по валюте расчетов | M | 1 | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты расчётов Для Внебиржевого договора ОТС/Внебиржевого договора репо ОТС указывается идентификатор Валюты расчетов по итогам клиринга | M | 1 | String(0-4) |
| | CurrencyName | Наименование валюты расчётов Для Внебиржевого договора ОТС/Внебиржевого договора репо ОТС указывается наименование Валюты расчетов по итогам клиринга | M | 1 | WString(0-30) |
| INFATYPE | | Блок данных по типу информации | M | 1 | |
| | InfType | Тип информации: 1 – Исполненные договора предыдущих дней; 2 - Исполненные договора текущего дня; 3 - Договора, подлежащие исполнению. | M | 1 | Integer |
| CLEARINGTYPE | | Блок данных по типу клиринга | M | 1 | |
| | ClearingType | Тип клирингового пула Возможное значение: С – Расчетный клиринговый пул I – Клиринговый пул по Договорам размещения и выкупа A - Клиринговый пул по Внутриброкерским Договорам D – Клиринговый пул по Договорам с полным обеспечением с ЦК и клирингового | O | 1 | Char |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|------------|------------------|---|---|---|---------------|
| | | пула по Договорам с полным обеспечением без ЦК N – Клиринговый пул по Договорам без Центрального контрагента | | | |
| SESSION | | Блок данных по клиринговой сессии | M | 1 | |
| | ClearingTime | Дата и время формирования клирингового пула. Не указывается для InfType=3 (Договора, подлежащие исполнению) | O | 4 | Datetime |
| SETTLEDATE | | Блок данных по дате расчётов | M | 1 | |
| | SettleDate | Фактическая дата расчётов | M | 1 | Date |
| BOARD | | Блок данных по группе инструментов | M | 1 | |
| | BoardType | Номер группы инструментов 1 – Российские ценные бумаги 2 – Иностранные ценные бумаги 4 – Иностранная валюта 5 – Еврооблигации 6 - Иностранные ценные бумаги эмитентов из стран СНГ 7 – Инструменты ОТС 8 – Инструменты ОТС (облигации) | M | 1 | Integer |
| | BoardID | Код группы инструментов EQR – Российские ценные бумаги EQF – Иностранные ценные бумаги EBOND – Еврооблигации CRCY_F – Иностранная валюта EQCIS- Иностранные ценные бумаги эмитентов из стран СНГ OTC – Инструменты ОТС OTCBOND – Инструменты ОТС (облигации) | O | 2 | String(0-16) |
| | BoardName | Наименование группы инструментов <ul style="list-style-type: none"> • Российские ценные бумаги • Иностранные ценные бумаги • Иностранная валюта • Еврооблигации • Иностранные ценные бумаги эмитентов из стран СНГ • Инструменты ОТС • Инструменты ОТС (облигации) | O | 1 | WString(0-30) |
| SECURITY | | Блок данных по инструменту | M | 1 | |
| | SecurityId | Идентификатор поставляемого актива (инструмента) | M | 1 | String(0-32) |
| | BaseSecurityCode | Код базового актива (не указывается, если совпадает с SecurityId) | O | 1 | String(0-12) |
| | ISIN | Международный идентификатор поставляемого актива (инструмента) | O | 1 | String(0-20) |
| | SecShortName | Краткое наименование поставляемого актива (инструмента) | M | 1 | WString(0-32) |
| | FaceValue | Номинал ЦБ | O | 2 | String(0-32) |
| | SecCurrencyId | Валюта номинала ЦБ | O | 2 | String(0-3) |
| | PriceCurrencyId | Валюта цены (котирования). | M | 4 | String(0-3) |
| | SecurityType | Категория ЦБ: | O | 2 | Integer |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|---------|----------------|---|---|---|---------------|
| | | 101 - Акции обыкновенные 102 - Акции привилегированные 103 - Пай открытого ПИФ 104 - Пай закрытого ПИФ 105 - ETF 106 - RDR 107 - ADR 108 - GDR 109 - Пай интервального ПИФ 110 – Ипотечный Вексель (Mortgage Note) 201 - Государственные Облигации 202 - Муниципальные Облигации 203 – Облигации Центрального Банка 204 - Корпоративные Облигации 205 – Облигации Кредитной Организации 206 – Биржевые Облигации | | | |
| | PriceType | Тип цены: PERC - процент от номинальной стоимости CASH – в валюте цены | M | 2 | String(0-4) |
| RECORDS | | Блок данных по договору | M | 1 | |
| | RecNo | Номер по порядку | M | 1 | Integer |
| | TradeNo | Номер договора | M | 1 | Integer |
| | TradeNoExtra | Дополнительный номер договора | O | 4 | Integer |
| | TradeDate | Дата заключения договора | M | 1 | Date |
| | TradeTime | Время регистрации договора в Системе торгов/Системе, время приема поручений на клиринг внебиржевых договоров | M | 1 | Time |
| | PrimaryOrderID | Номер заявки/ номер Оферты ОТС | O | 4 | Integer |
| | OrderID | Дополнительный идентификатор Системы/Системы проведения торгов | O | 1 | Integer |
| | Comment | Комментарий | O | 1 | WString(0-64) |
| | TradePlace | Код организатора торгов, зарегистрировавшего договор | O | 1 | Integer |
| | TradePlaceName | Наименование организатора торгов, зарегистрировавшего договор | O | 1 | WString(0-64) |
| | BuySell | Направленность заявки/ Оферты ОТС (покупка (B) / продажа (S)) | M | 1 | Char |
| | SettleCode | Код расчётов по договору | O | 1 | String(0-12) |
| | TradePeriod | Период заключения Биржевых договоров: 1 – Основная торговая сессия 2 – Дополнительная торговая сессия 3 – Дополнительная утренняя торговая сессия Не указывается для внебиржевых договоров | O | 4 | Integer |
| | SpecialPeriod | Специальный период заключения Договоров 1 - Аукцион закрытия 2 - Период повышенной дополнительной ликвидности 3 - Период стандартной дополнительной ликвидности 4 - Период без дополнительной ликвидности 5 - Период с дополнительной ликвидностью | O | 4 | Integer |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|--|---------------------|--|---|---|---------------|
| | | 6 - Период без основной ликвидности | | | |
| | TradeType | Тип договора: T – заключен на основании безадресной заявки; N – заключен на основании адресной заявки; D – заключен без подачи заявки; O – внебиржевой договор, заключенный на основании Оферты ОТС тип 1 P – внебиржевой договор, заключенный на основании Оферты ОТС тип 2 | O | 1 | Char |
| | TradeModeId | Идентификатор Режима торгов/ заключения внебиржевых договоров 1 - Режим основных торгов 2 - Режим переговорных сделок 3 - Режим торгов адресное репо 4 - Режим торгов Аукцион размещения 5 - Режим торгов Адресное размещение 6 - Режим торгов Аукцион по выкупу 7 - Режим торгов Адресный выкуп 8 - Режим торгов РПС без ЦК 9 - Режим торгов адресное репо без ЦК 10 -Режим торгов RFQ 11 - Заключение Конверсионных договоров с передачей на клиринг 12 - Режим торгов анонимное репо 13 – Заключение Внебиржевых договоров с передачей на клиринг 14 – Заключение Внебиржевых договоров ОТС/ Внебиржевых договоров репо ОТС | M | 4 | Integer |
| | TradeModeName | Наименование Режима торгов/ заключения внебиржевых договоров <ul style="list-style-type: none"> • Режим основных торгов • Режим переговорных сделок • Режим торгов адресное репо • Режим торгов Аукцион размещения • Режим торгов Адресное размещение • Режим торгов Аукцион по выкупу • Режим торгов Адресный выкуп • Режим торгов РПС без ЦК • Режим торгов адресное репо без ЦК • Режим торгов RFQ • Заключение Конверсионных договоров с передачей на клиринг • Режим торгов анонимное репо • Заключение Внебиржевых договоров с передачей на клиринг • Заключение Внебиржевых договоров ОТС/ Внебиржевых договоров репо ОТС | O | 4 | WString(0-64) |
| | TradeInstrumentType | Тип инструмента | M | 2 | Integer |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|--|-----------------|--|---|---|----------------|
| | | 1 – фьючерсные инструменты 2 – опционы 3 – инструменты с частичным обеспечением 4 – репо 5 – связанные сделки купли-продажи 6 – договор валютный своп (swap) 9 - инструменты с полным обеспечением | | | |
| | Decimals | Число значимых знаков после запятой в ценах | O | 1 | Integer |
| | Price | Цена за единицу инструмента | M | 1 | Numeric(20,6) |
| | Quantity | Объём договора, в лотах/инструментах | M | 1 | Numeric(28,8) |
| | Value | Объём договора, в валюте цены | M | 1 | Numeric(20,2) |
| | Amount | Обязательство по денежным средствам, в валюте расчетов. Для Внебиржевых договоров ОТС/ Внебиржевых договоров репо ОТС указывается объем денежных средств в Валюте расчетов по итогам клиринга, подлежащий отражению во внутреннем учете Участника клиринга в качестве обязательства по договору, расчеты по которому будут производиться по итогам клиринга | M | 1 | Numeric(20,2) |
| | AmountOTC | Обязательство по денежным средствам по Внебиржевому договору ОТС/ Внебиржевому договору репо ОТС в рублях РФ, определенное в соответствии с порядком, установленном Правилами клиринга До даты исполнения обязательств по договору указывается предварительная оценка обязательства по денежным средствам исходя из текущего курса | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | ConversionRate | Курс валюты цены к валюте расчетов для определения обязательств по Внебиржевому договору ОТС/Внебиржевому договору репо ОТС | O | 4 | Numeric(28,6) |
| | Balance | Обязательство по ценным бумагам | M | 1 | Numeric(28,8) |
| | CorpEvent | Проведение корпоративного события: S – дробление RS – консолидация D – выплата дивидендов SO – выделение N – выплата купона M – слияние и поглощение | O | 3 | Char |
| | ExchComm | Комиссионное вознаграждение за организацию торгов в валюте расчетов (заполняется только для договоров, заключенных в дату формирования отчета) | O | 2 | Numeric(20,8) |
| | ClrComm | Клиринговая комиссия в валюте расчетов (заполняется только для договоров, заключенных в дату формирования отчета) | O | 2 | Numeric(20,8) |
| | LicComm | Лицензионное вознаграждение в валюте расчетов (заполняется только для договоров, заключенных в дату формирования отчета) | O | 2 | Numeric(20,8) |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | 1 | String(0-12) |
| | SubClrAccCode | Код Аналитического ТКС | O | 1 | String(0-16) |
| | PaymentDetails | Реквизиты денежного счета для исполнения обязательств по договору (для договоров без ЦК) | O | 4 | WString(0-255) |
| | DeliveryDetails | Реквизиты счета депо для исполнения обязательств (для договоров без ЦК) | O | 4 | WString(0-255) |
| | ClientDetails | ИНН или № паспорта клиента или иной код | O | 1 | WString(0-41) |
| | CCPCode | Идентификатор Центрального контрагента | O | 4 | String(0-16) |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|--|------------------|--|---|---|---------------|
| | CCPShortName | Краткое наименование Центрального контрагента | O | 4 | WString(0-32) |
| | CCPDetails | ИНН Центрального контрагента | O | 4 | String(0-16) |
| | CPFirmId | Идентификатор контрагента (только для адресных договоров) | O | 1 | String(0-16) |
| | CPFirmShortName | Краткое наименование контрагента (только для адресных договоров) | O | 1 | WString(0-32) |
| | CPFirmDetails | ИНН контрагента (только для адресных договоров) | O | 4 | String(0-16) |
| | ClientCode | Краткий код клиента или клиента клиента Участника клиринга | O | 1 | WString(0-16) |
| | DueDate | Дата исполнения | M | 1 | Date |
| | AccInt | Накопленный купонный доход, рассчитанный в соответствии с количеством актива данного договора, в валюте расчётов | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | VarMarginDebit | Вариационная маржа списанная, в валюте расчетов | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | VarMarginCredit | Вариационная маржа начисленная, в валюте расчетов | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | Price2 | Цена второй части РЕПО* | O | 1 | Numeric(20,6) |
| | RepoPart | Часть РЕПО 1 – первая часть договора РЕПО 2 – вторая часть договора РЕПО | O | 1 | Integer |
| | RepoPeriod | Срок РЕПО в календарных днях | O | 1 | Integer |
| | RepoRate | Ставка РЕПО в % | O | 2 | Numeric(20,6) |
| | Type | Тип договора, заключенной в целях урегулирования возможного неисполнения обязательств и в целях исполнения обязательств по договорам: 1 – договор репо в случае неисполнения обязательств Участником клиринга; 2 – договор купли-продажи в случае неисполнения обязательств Участником клиринга; 3 - договор репо в случае неисполнения обязательств КЦ; 4 – договор купли-продажи в случае неисполнения обязательств КЦ; 5 – договор репо, заключенный КЦ с целью привлечения активов для урегулирования неисполнения обязательств; 6 – договор купли-продажи, заключенный КЦ с целью принудительного закрытия позиции Участника клиринга; 7 – договор купли-продажи, заключенный в целях исполнения обязательств (договор, заключаемый в целях переноса позиции на другого организатора торгов); 8 – договор, заключенный в целях закрытия позиции в результате исполнения поставочного/расчетного фьючерсного контракта; 9 – договор, заключенный в результате исполнения опционного контракта | O | 1 | Integer |
| | FineDebit | Сумма штрафа удержанная, в валюте расчетов | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | FineCredit | Сумма штрафа начисленная, в валюте расчетов | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | RepositoryNumber | Номер, присвоенный Внебиржевому договору репо ОТС Репозитарием | O | 4 | String(0-64) |
| | /RECORDS | | M | 1 | |
| | /SECURITY | | M | 1 | |
| | /BOARD | | M | 1 | |
| | /SETTLEDATE | | M | 1 | |
| | /SESSION | | M | 1 | |
| | /CLEARINGTYPE | | M | 1 | |
| | /INFTYPE | | M | 1 | |
| | /CURRENCY | | M | 1 | |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|----------|--|--|---|---|--|
| /FIRM | | | M | 1 | |
| /MFB06 | | | M | 1 | |
| /RTS_DOC | | | M | 1 | |

*Цена второй части Договора репо с ценными бумагами, за исключением Договора репо, предметом которого является облигация, рассчитывается по следующей формуле:

Price2=Округл (Округл (Price * Balance * (1+ RepoRate * $\left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366}\right)$ / 100); 2) / Balance; Decimals), где:

Price – цена первой части Договора репо;

Balance - объём обязательства по Договору репо, в штуках;

RepoRate – ставка репо в %;

T365 – количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо, приходящихся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T366 - количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо, приходящихся на календарный год, состоящий из 366 дней;

Decimals - число значимых знаков после запятой в ценах.

Цена второй части Договора репо, предметом которого является облигация, рассчитывается по следующей формуле:

Price2= Округл (((BuybackVolume – ACY 2* Balance)/ Balance)/FaceValue * 100; Decimals), где:

BuybackVolume =Округл (Округл ((Price/100) * FaceValue * Balance + ACY1 * Balance) * (1+ RepoRate * $\left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366}\right)$ / 100); 2) / Balance; Decimals)

Price – цена первой части Договора репо, в % от номинала;

Balance - объём обязательства по Договору репо, в штуках;

RepoRate – ставка репо, в %;

T365 – количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо, приходящихся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T366 - количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо, приходящихся на календарный год, состоящий из 366 дней;

ACY1 – накопленный купонный доход по ЦБ на дату исполнения первой части Договора репо;

ACY 2 – накопленный купонный доход по ЦБ на дату исполнения второй части Договора репо;

FaceValue – номинальная стоимость облигации;

Decimals - число значимых знаков после запятой в ценах.

МFB06С Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг (по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга)

Отчет формируется в разрезе клиентов Участника клиринга.

Отчет формируется по итогам клиринга.

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Rev | Тип |
|-------------------|-------------------|--|-----|-----|----------------|
| RTS_DOC | | Корневой элемент (root element) XML документа | M | 1 | |
| DOC_REQUISITES | | Блок информации о документе | M | 1 | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | 1 | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа | M | 1 | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | Всегда МFB06С | M | 1 | String(0-20) |
| | SENDER_ID | Всегда МFBIM | M | 1 | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | 1 | WString(0-120) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | 1 | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| МFB06С | | Блок данных отчета | M | 1 | |
| | ReportDate | Дата отчета | M | 1 | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | 1 | WString(0-128) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | 1 | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | 1 | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | 1 | String(0-16) |
| | FirmName | Наименование Участника клиринга | M | 1 | WString(0-120) |
| | FirmINN | ИНН Участника клиринга | O | 4 | String(0-12) |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | 1 | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | O | 1 | String(0-16) |
| | FirmTradeINN | ИНН Участника торгов | O | 4 | String(0-12) |
| CLIENT | | | M | 1 | |
| | ClientCode | Краткий код клиента или клиента клиента Участника клиринга | M | 1 | WString(0-16) |
| | ClientDetails | ИНН или № паспорта клиента или иной код | M | 1 | WString(0-41) |
| CURRENCY | | Блок данных по валюте расчетов | M | 1 | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты расчётов Для Внебиржевого договора ОТС/Внебиржевого договора репо ОТС указывается идентификатор Валюты расчетов по итогам клиринга | M | 1 | String(0-4) |
| | CurrencyName | Наименование валюты расчётов Для Внебиржевого договора ОТС/Внебиржевого договора репо ОТС указывается наименование Валюты расчетов по итогам клиринга | M | 1 | WString(0-30) |
| INFTYPE | | Блок данных по типу информации | M | 1 | |
| | InfType | Тип информации: 1 – Исполненные договора предыдущих дней; 2 - Исполненные договора текущего дня; 3 - Договора, подлежащие исполнению. | M | 1 | Integer |

Спецификация клиринговых отчетов

| CLEARINGTYPE | | Блок данных по типу клиринга | M | 1 | |
|--------------|------------------|---|---|---|---------------|
| | ClearingType | Тип клирингового пула Возможное значение: С - Расчетно-клиринговый пул, I – Клиринговый пул по договорам размещения/выкупа А - Клиринговый пул по Внутриброкерским договорам D – Клиринговый пул по договорам с полным обеспечением N – Клиринговый пул по договорам без ЦК | O | 1 | Char |
| SESSION | | Блок данных по клиринговой сессии | M | 1 | |
| | ClearingTime | Дата и время формирования клирингового пула. Не указывается для InfType=3 (договоры, подлежащие исполнению) | O | 4 | Integer |
| SETTLEDATE | | Блок данных по дате расчётов | M | 1 | |
| | SettleDate | Фактическая дата расчётов | M | 1 | Date |
| BOARD | | Блок данных по группе инструментов | M | 1 | |
| | BoardType | Номер группы инструментов: 1 – Российские ценные бумаги 2 – Иностранные ценные бумаги 4 – Иностранная валюта 5 –Еврооблигации 6 - Иностранные ценные бумаги эмитентов из стран СНГ 7 - Инструменты ОТС 8 - Инструменты ОТС (облигации) | M | 1 | Integer |
| | BoardID | Код группы инструментов EQR – Российские ценные бумаги EQF – Иностранные ценные бумаги EBOND – Еврооблигации CRCY_F – Иностранная валюта EQCIS- Иностранные ценные бумаги эмитентов из стран СНГ ОТС – Инструменты ОТС ОТСBOND – Инструменты ОТС (облигации) | M | 2 | String(0-16) |
| | BoardName | Наименование группы инструментов <ul style="list-style-type: none"> • Российские ценные бумаги • Иностранные ценные бумаги • Иностранная валюта • Еврооблигации • Иностранные ценные бумаги эмитентов из стран СНГ • Инструменты ОТС • Инструменты ОТС (облигации) | M | 1 | WString(0-64) |
| SECURITY | | Блок данных по инструменту | M | 1 | |
| | SecurityId | Идентификатор поставляемого актива (инструмента) | M | 1 | String(0-32) |
| | BaseSecurityCode | Код базового актива (не указывается, если совпадает с SecurityId) | O | 1 | String(0-12) |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|---------|-----------------|--|---|---|---------------|
| | ISIN | Международный идентификатор поставляемого актива (инструмента) | O | 1 | String(0-20) |
| | SecShortName | Краткое наименование поставляемого актива (инструмента) | M | 1 | WString(0-32) |
| | FaceValue | Номинал ЦБ | O | 2 | String(0-32) |
| | SecCurrencyId | Валюта номинала ЦБ | O | 2 | String(0-3) |
| | PriceCurrencyId | Валюта цены (котирования). Не указывается для облигаций; не указывается, если валюта цены и валюта расчетов совпадают | O | 4 | String(0-3) |
| | SecurityType | Категория ЦБ: 101 - Акции обыкновенные 102 - Акции привилегированные 103 - Пай открытого ПИФ 104 - Пай закрытого ПИФ 105 - ETF 106 - RDR 107 - ADR 108 - GDR 109 - Пай интервального ПИФ 110 – Ипотечный Вексель (Mortgage Note) 201 - Государственные Облигации 202 - Муниципальные Облигации 203 – Облигации Центрального Банка 204 - Корпоративные Облигации 205 – Облигации Кредитной Организации 206 – Биржевые Облигации | O | 2 | Integer |
| | PriceType | Тип цены: PERC - процент от номинала CASH – в валюте | M | 2 | String(0-4) |
| RECORDS | | Блок данных по договору | M | 1 | |
| | RecNo | Номер по порядку | M | 1 | Integer |
| | TradeNo | Номер договора | M | 1 | Integer |
| | TradeNoExtra | Дополнительный номер договора | O | 4 | Integer |
| | TradeDate | Дата заключения договора | M | 1 | Date |
| | TradeTime | Время регистрации договора в Системе торгов/Системе, время приема поручения на клиринг внебиржевых договоров | M | 1 | Time |
| | PrimaryOrderID | Номер заявки/ номер Оферты ОТС | O | 4 | Integer |
| | OrderID | Дополнительный идентификатор Системы/Системы проведения торгов | O | 1 | Integer |
| | Comment | Комментарий | O | 1 | WString(0-64) |
| | TradePlace | Код организатора торгов, зарегистрировавшего договор | O | 1 | Integer |
| | TradePlaceName | Наименование организатора торгов, зарегистрировавшего договор | O | 1 | WString(0-64) |
| | BuySell | Направленность заявки/ Оферты ОТС (покупка (B) / продажа (S)) | M | 1 | Char |
| | SettleCode | Код расчётов по договору | O | 1 | String(0-12) |
| | TradePeriod | Период заключения биржевых договоров: 1 – Основная торговая сессия 2 – Дополнительная вечерняя торговая сессия 3 – Дополнительная утренняя торговая сессия Не указывается для внебиржевых договоров | O | 4 | Integer |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|--|---------------|---|---|---|---------------|
| | SpecialPeriod | <p>Специальный период заключения Договоров</p> <p>1 - Аукцион закрытия</p> <p>2 - Период повышенной дополнительной ликвидности</p> <p>3 - Период стандартной дополнительной ликвидности</p> <p>4 - Период без дополнительной ликвидности</p> <p>5 - Период с дополнительной ликвидностью</p> <p>6 - Период без основной ликвидности</p> | O | 4 | Integer |
| | TradeType | <p>Тип договора:</p> <p>T – заключен на основании безадресной заявки;</p> <p>N – заключен на основании адресной заявки;</p> <p>D – заключен без подачи заявки;</p> <p>O – внебиржевой договор, заключенный на основании Оферты ОТС тип 1</p> <p>P – внебиржевой договор, заключенный на основании Оферты ОТС тип 2</p> | O | 1 | Char |
| | TradeModeId | <p>Идентификатор Режима торгов/ заключения внебиржевых договоров</p> <p>1 - Режим основных торгов</p> <p>2 - Режим переговорных сделок</p> <p>3 - Режим торгов адресное репо</p> <p>4 - Режим торгов Аукцион размещения</p> <p>5 - Режим торгов Адресное размещение</p> <p>6 - Режим торгов Аукцион по выкупу</p> <p>7 - Режим торгов Адресный выкуп</p> <p>8 - Режим торгов РПС без ЦК</p> <p>9 - Режим торгов адресное репо без ЦК</p> <p>10 -Режим торгов RFQ</p> <p>11 - Заключение Конверсионных договоров с передачей на клиринг</p> <p>12 - Режим торгов анонимное репо</p> <p>13 – Заключение Внебиржевых договоров с передачей на клиринг</p> <p>14 – Заключение Внебиржевых договоров ОТС/ Внебиржевых договоров репо ОТС</p> | M | 4 | Integer |
| | TradeModeName | <ul style="list-style-type: none"> • Наименование Режима торгов/ заключения внебиржевых договоров • Режим основных торгов • Режим переговорных сделок • Режим торгов адресное репо • Режим торгов Аукцион размещения • Режим торгов Адресное размещение • Режим торгов Аукцион по выкупу • Режим торгов Адресный выкуп • Режим торгов РПС без ЦК • Режим торгов адресное репо без ЦК • Режим торгов RFQ • Режим торгов анонимное репо | O | 4 | WString(0-64) |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|--|---------------------|---|---|---|----------------|
| | | <ul style="list-style-type: none"> • Заключение Конверсионных договоров с передачей на клиринг • Заключение Внебиржевых договоров с передачей на клиринг • Заключение Внебиржевых договоров OTC/ Внебиржевых договоров репо OTC | | | |
| | TradeInstrumentType | Тип торгового инструмента 1 – фьючерсные инструменты 2 – опционы 3 - инструменты с частичным обеспечением 4 – репо 5 – связанные сделки купли-продажи 6 – договор валютный своп (swap) 9 - инструменты с полным обеспечением | M | 2 | Integer |
| | Decimals | Число значимых знаков после запятой в ценах | O | 1 | Integer |
| | Price | Цена за единицу инструмента | M | 1 | Numeric(20,6) |
| | Quantity | Объём договора, в инструментах | M | 1 | Numeric(28,8) |
| | Value | Объём договора, в валюте расчётов | M | 1 | Numeric(20,2) |
| | Amount | Обязательство по денежным средствам, в валюте расчетов. Для неисполненных Внебиржевых договоров OTC/ Внебиржевых договоров репо OTC представлена предварительная оценка обязательства по текущему курсу | M | 1 | Numeric(28,2) |
| | AmountOTC | Обязательство по денежным средствам по Внебиржевому договору OTC/ Внебиржевому договору репо OTC в рублях РФ, определенное в соответствии с порядком, установленном Правилами клиринга До даты исполнения обязательств по договору указывается предварительная оценка обязательства по денежным средствам исходя из текущего курса | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | ConversionRate | Курс валюты цены к валюте расчетов для определения обязательств по Внебиржевому договору OTC/Внебиржевому договору репо OTC | O | 4 | Numeric(28,6) |
| | Balance | Обязательство по ценным бумагам | M | 1 | Numeric(28,8) |
| | CorpEvent | Проведение корпоративного события: S – дробление RS – консолидация SO – выделение D – выплата дивидендов N – выплата купона M – слияние и поглощение | O | 3 | Char |
| | ExchComm | Комиссионное вознаграждение за организацию торгов в валюте расчетов (заполняется только для договоров, заключенных в дату формирования отчета) | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | ClrComm | Клиринговая комиссия в валюте расчетов (заполняется только для договоров, заключенных в дату формирования отчета) | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | LicComm | Лицензионное вознаграждение в валюте расчетов (заполняется только для договоров, заключенных в дату формирования отчета) | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | 1 | String(0-12) |
| | SubClrAccCode | Код Аналитического ТКС | O | 1 | String(0-16) |
| | PaymentDetails | Реквизиты денежного счета для исполнения обязательств (для договоров без | O | 4 | WString(0-255) |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|--|------------------|--|---|---|----------------|
| | | ЦК) | | | |
| | DeliveryDetails | Реквизиты счета депо для исполнения обязательств (для договоров без ЦК) | O | 4 | WString(0-255) |
| | CCPCode | Идентификатор Центрального контрагента | O | 4 | String(0-16) |
| | CCPShortName | Краткое наименование Центрального контрагента | O | 4 | WString(0-32) |
| | CCPDetails | ИНН Центрального контрагента | O | 4 | String(0-16) |
| | CPFirmId | Идентификатор контрагента | O | 1 | String(0-16) |
| | CPFirmShortName | Краткое наименование контрагента | O | 1 | WString(0-32) |
| | CPFirmDetails | ИНН контрагента | O | 4 | String(0-16) |
| | DueDate | Дата исполнения | M | 1 | Date |
| | AccInt | Накопленный купонный доход, рассчитанный в соответствии с количеством актива данного договора, в валюте расчётов | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | VarMarginDebit | Вариационная маржа списанная, в валюте расчетов | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | VarMarginCredit | Вариационная маржа зачисленная, в валюте расчетов | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | Price2 | Цена второй части РЕПО | O | 1 | Numeric(20,6) |
| | RepoPart | Часть РЕПО 1 – первая часть договора РЕПО 2 – вторая часть договора РЕПО | O | 1 | Integer |
| | RepoPeriod | Срок РЕПО в календарных днях | O | 1 | Integer |
| | RepoRate | Ставка РЕПО в % | O | 2 | Numeric(20,6) |
| | Type | Тип договора, заключенного в целях урегулирования возможного неисполнения обязательств по договорам с частичным обеспечением: 1 – договор репо в случае неисполнения обязательств Участником клиринга; 2 – договор купли-продажи в случае неисполнения обязательств Участником клиринга; 3 - договор репо в случае неисполнения обязательств КЦ; 4 – договор купли-продажи в случае неисполнения обязательств КЦ; 5 – договор репо, заключенный КЦ с целью привлечения активов для урегулирования неисполнения обязательств; 6 – договор купли-продажи, заключенный КЦ с целью принудительного закрытия позиции Участника клиринга; 7 – договор купли-продажи, заключенный в целях исполнения обязательств (договор, заключаемый в целях переноса позиции на другого организатора торгов); 8 – договор, заключенный в целях закрытия позиции в результате исполнения поставочного/расчетного фьючерсного контракта; 9 – договор, заключенный в результате исполнения опционного контракта | O | 1 | Integer |
| | FineDebit | Сумма штрафа удержанная, в валюте расчетов | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | FineCredit | Сумма штрафа начисленная, в валюте расчетов | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | RepositoryNumber | Номер, присвоенный Внебиржевому договору репо ОТС Репозитарием | O | 4 | String(0-64) |
| | /RECORDS | | M | 1 | |
| | /SECURITY | | M | 1 | |
| | /BOARD | | M | 1 | |
| | /SETTLEDATE | | M | 1 | |
| | /SESSION | | M | 1 | |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|---------------|--|--|---|---|--|
| /CLEARINGTYPE | | | M | 1 | |
| /INFTYPE | | | M | 1 | |
| /CURRENCY | | | M | 1 | |
| /CLIENT | | | M | 1 | |
| /FIRM | | | M | 1 | |
| /MFB06C | | | M | 1 | |
| /RTS_DOC | | | M | 1 | |

MFB13 Отчет об итоговых нетто-обязательствах/нетто-требованиях

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Rev | Тип |
|-------------------|-------------------|--|-----|-----|----------------|
| RTS_DOC | | | M | 1 | |
| DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | 1 | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа | M | 1 | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | Всегда MFB13 | M | 1 | String(0-20) |
| | SENDER_ID | Всегда MFBIM | M | 1 | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | 1 | WString(0-120) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | 1 | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| MFB13 | | Блок данных отчета | M | 1 | |
| | ReportDate | Дата отчета | M | 1 | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | 1 | WString(0-128) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | 1 | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | 1 | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | 1 | String(0-16) |
| | FirmName | Наименование Участника клиринга | M | 1 | WString(0-120) |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | 1 | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | O | 1 | String(0-16) |
| CLEARINGTYPE | | | M | 3 | |
| | ClearingType | Тип клирингового пула: A - Клиринговый пул по Внутриброкерским договорам C - Расчетно-клиринговый пул D – Клиринговый пул по договорам с полным обеспечением I – Клиринговый пул по договорам размещения/выкупа N – Клиринговый пул по договорам без ЦК | M | 2 | Integer |
| SESSION | | | M | 2 | |
| | ClearingTime | Дата и время формирования клирингового пула, время MSK | O | 3 | Time |
| | FinalObligations | Признак нетто-обязательств, определенных до процедуры урегулирования нехватки активов для поставки N - итоговые нетто-обязательства до процедуры урегулирования нехватки активов для поставки Y –итоговые нетто-обязательства | M | 2 | Char |
| SETTLE | | Блок данных по ТКС | M | 1 | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | 1 | String(0-16) |
| SETTLEDATE | | Блок данных по дате исполнения | M | 1 | |
| | SettleDate | Дата исполнения | M | 1 | Date |
| POSTYPES | | Блок информации по типам обязательств | M | 1 | |
| | PosType | C - информация о нетто обязательствах/требованиях по денежной позиции | M | 1 | Char |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | S - информация о нетто обязательствах/требованиях по депозитарным разделам | | | |
|---------------|---------------|--|---|---|---------------|
| GROUP | | Блок данных по обязательствам в разрезе регистра | M | 1 | |
| | BankAccCode | Код денежного регистра | O | | String(0-32) |
| | GuarDepUnitId | Счет (субсчет) депо для учета ценных бумаг | O | 1 | String(0-17) |
| RECORDS | | Блок данных по обязательствам | M | 1 | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты обязательства | O | 1 | String(0-4) |
| | CurrencyName | Наименование валюты обязательства | O | 1 | WString(0-32) |
| | SecurityId | Идентификатор ценной бумаги | O | 1 | String(0-12) |
| | SecShortName | Краткое наименование ценной бумаги /эмитента ценной бумаги | O | 1 | WString(0-32) |
| | Debit | Нетто-обязательство / обязательство | M | 1 | Numeric(28,8) |
| | Credit | Нетто-требование / требование | M | 1 | Numeric(28,8) |
| | Shortage | Размер нехватки активов для поставки | O | 4 | Numeric(20,2) |
| /RECORDS | | | M | 1 | |
| /GROUP | | | M | 1 | |
| /POSTYPES | | | M | 1 | |
| /SETTLEDATE | | | M | 1 | |
| /SETTLE | | | M | 1 | |
| /SESSION | | | M | 1 | |
| /CLEARINGTYPE | | | M | 1 | |
| /FIRM | | | M | 1 | |
| /MFB13 | | | M | 1 | |
| /RTS_DOC | | | M | 1 | |

МФВ14 Отчет о Гарантийном обеспечении, Маржинальном требовании и Задолженности

Формируется по итогам клиринга для расчетов по итогам торгов.

Отчет формируется по итогам клиринга.

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Rev | Тип |
|-------------------|------------------------|--|-----|-----|----------------|
| RTS_DOC | | | M | 1 | |
| DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | 1 | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа | M | 1 | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | Всегда МФВ14 | M | 1 | String(0-20) |
| | SENDER_ID | Всегда МФВ1М | M | 1 | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | 1 | WString(0-120) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | 1 | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| МФВ14 | | Блок данных отчета | M | 1 | |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | 1 | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | 1 | WString(0-128) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | 1 | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | 1 | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | 1 | String(0-16) |
| | FirmName | Наименование Участника клиринга | M | 1 | WString(0-120) |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | 1 | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | 1 | String(0-16) |
| SETTLE | | Блок данных по ТКС | M | 1 | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | 1 | String(0-16) |
| COLLATERAL | | Блок информации о средствах обеспечения | M | 1 | |
| | CollateralCurrencyId | Идентификатор валюты обеспечения | M | 1 | String(0-4) |
| | CollateralCurrencyName | Наименование валюты обеспечения | O | 1 | WString(0-30) |
| | CollateralSum | Средства обеспечения | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | CollateralBlocked | Гарантийное обеспечение | O | 1 | Numeric(20,2) |
| /COLLATERAL | | | M | 1 | |
| OBLIGATION | | Блок данных по требованию к ТКС | M | 1 | |
| | ObligationSum | Сумма требования в валюте обеспечения | M | 1 | Numeric(20,2) |
| /OBLIGATION | | | M | 1 | |
| /SETTLE | | | M | 1 | |
| /FIRM | | | M | 1 | |
| OBLIGATION_TYPE | | Блок данных по требованию к Участнику клиринга | M | 1 | |
| | ObligTypeID | Тип требования Возможные значения: N – Маржинальное требование отсутствует MC – Маржинальное требование UMC – непогашенное маржинальное требование | M | 1 | String(3) |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|------------------|---------------|---|---|---|---------------|
| | | D- Задолженность | | | |
| | ObligTypeName | Наименование требования | M | 1 | WString(0-30) |
| | TotalSum | Итоговое требование к Участнику клиринга в валюте обеспечения | M | 1 | Numeric(20,2) |
| /OBLIGATION_TYPE | | | M | 1 | |
| /MFB14 | | | M | 1 | |
| /RTS_DOC | | | M | 1 | |

Спецификация клиринговых отчетов

MFB15 Отчет по обязательствам Участника клиринга по комиссионному вознаграждению

Формируется по итогам клиринга для расчетов по итогам торгов

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Rev | Тип |
|-------------------|-------------------|---|-----|-----|----------------|
| RTS_DOC | | | M | 1 | |
| DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | 1 | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа | M | 1 | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | Всегда MFB15 | M | 1 | String(0-20) |
| | SENDER_ID | Всегда MFBIM | M | 1 | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | 1 | WString(0-120) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | 1 | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| MFB15 | | Блок данных отчета | M | 1 | |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | 1 | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | 1 | WString(0-128) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | 1 | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | 1 | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | 1 | String(0-16) |
| | FirmName | Наименование Участника клиринга | M | 1 | WString(0-120) |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | 1 | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | 1 | String(0-16) |
| SETTLE | | Блок данных по ТКС | | 1 | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | 1 | String(0-16) |
| TYPE | | Блок данных по получателям комиссии | M | 1 | |
| | ComType | 1 - Комиссионное вознаграждение за организацию торгов, 2 - Клиринговая комиссия, 3 - Лицензионное вознаграждение | M | 1 | Char |
| CURRENCY | | | M | 2 | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты комиссии | M | 2 | String(0-4) |
| | CurrencyName | Наименование валюты комиссии | M | 2 | WString(0-30) |
| FEE | | Блок данных по видам комиссии | M | 1 | |
| | FeeType | Признак вида комиссии/возвратной премии: 0 - всего по денежной позиции 1 - оборотная часть с уплатой в день заключения договора 2 - фиксированная комиссия за ведение клиринговых регистров 3 - возвратная премия по данному типу комиссии 5 - комиссия за принудительное закрытие позиции 6 - оборотная часть с уплатой в день исполнения договора 7 – комиссия за проведение процедуры замены валюты денежных средств обеспечения 8 – комиссия за списание с Торгового счета/Субсчета депо ценных бумаг иностранного эмитента, учитываемых в качестве Средств обеспечения Участника клиринга, на основании поручения на списание ценных бумаг в количестве, превышающем совокупное количество | M | 2 | Char |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|--|----------|---|---|---|---------------|
| | | <p>ценных бумаг данного иностранного эмитента, внесенных в качестве Средств обеспечения данным Участником клиринга</p> <p>9 – комиссия за прием Поручений на клиринг внебиржевых договоров по заключенным Конверсионным договорам с уплатой в день приема поручения</p> <p>10 – комиссия за прием Поручений на клиринг внебиржевых договоров по заключенным Конверсионным договорам с уплатой в день исполнения Конверсионного договора</p> <p>12 – комиссия за</p> <p>1) договоры репо, заключённые в Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» на основании Заявок, в которых указаны торгово-клиринговые счета, зарегистрированные на одного Участника торгов,</p> <p>2) внебиржевые договоры репо ОТС (Пары внебиржевых договоров ОТС), заключённые на основании Оферты ОТС типа 2, и связанные Внебиржевые договоры репо ОТС (связанные Пары внебиржевых договоров ОТС), заключенные на основании связанной Оферты ОТС, при условии направления Оферты ОТС типа 2, в которых указаны торгово-клиринговые счета, зарегистрированные на одного Участника клиринга,</p> <p>предметом которых являются ценные бумаги, относящиеся к Группе инструментов «иностранные ценные бумаги», и из Внебиржевых договоров ОТС, за исключением Внебиржевых договоров ОТС, предметом которых являются ценные бумаги российских эмитентов и иностранные финансовые инструменты, квалифицированные в качестве облигаций и номинированные в валюте, отличной от российского рубля</p> <p>13 - комиссии за</p> <p>1) договоры репо, заключённые в Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» на основании Заявок, в которых указаны торгово-клиринговые счета, зарегистрированные на одного Участника торгов,</p> <p>2) внебиржевые договоры репо ОТС (Пары внебиржевых договоров ОТС), заключённые на основании Оферты ОТС типа 2, и связанные Внебиржевые договоры репо ОТС (связанные Пары внебиржевых договоров ОТС), заключенные на основании связанной Оферты ОТС, при условии направления Оферты ОТС типа 2, в которых указаны торгово-клиринговые счета, зарегистрированные на одного Участника клиринга,</p> <p>предметом которых являются ценные бумаги, относящиеся к Группе инструментов «еврооблигации», и из Внебиржевых договоров ОТС, предметом которых являются финансовые инструменты, квалифицированные в качестве облигаций и номинированные в валюте, отличной от российского рубля</p> <p>14 - ежемесячный биржевой сбор</p> <p>15 - клиринговый сбор за возврат Средств обеспечения УК в иностранной валюте</p> <p>16 - клиринговый сбор за ведение клиринговых регистров УК в целях ведения отдельного учета в рамках ТКС, зарегистрированного для отдельного клиента УК</p> <p>17 - клиринговый сбор за проведение расчетов по итогам клиринга договоров</p> <p>18 - биржевой сбор за торговлю в дополнительную утреннюю сессию</p> | | | |
| | TotComm | Обязательство по уплате Комиссионных вознаграждений | M | 1 | Numeric(20,2) |
| | TotVAT | в т.ч. НДС | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | Executed | Признак удержания в отчетную дату: Y – удержано N – не удержано | O | 2 | Char |
| | DateFrom | Дата начала периода, за который начислена комиссия | O | 1 | Date |
| | DateTo | Дата окончания периода, за который начислена комиссия/Дата уплаты комиссии (с уплатой в день исполнения договора) | O | 1 | Date |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|-----------|--|--|---|---|--|
| /FEE | | | M | 1 | |
| /CURRENCY | | | M | 2 | |
| /TYPE | | | M | 1 | |
| /SETTLE | | | M | 1 | |
| /FIRM | | | M | 1 | |
| /MFB15 | | | M | 1 | |
| /RTS_DOC | | | M | 1 | |

МFB20 Уведомление о торгово-клиринговых счетах Участника клиринга

Формируется по итогам клиринга для расчетов по итогам торгов

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Rev | Тип |
|-------------------|-------------------|--|-----|-----|----------------|
| RTS_DOC | | | M | 1 | |
| DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | 1 | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа | M | 1 | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | Всегда МFB20 | M | 1 | String(0-20) |
| | SENDER_ID | Всегда МFBIM | M | 1 | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | 1 | WString(0-120) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | 1 | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| МFB20 | | Блок данных отчета | M | 1 | |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | 1 | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | 1 | WString(0-128) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | 1 | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | 1 | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | 1 | String(0-16) |
| | FirmName | Наименование Участника клиринга | M | 1 | WString(0-120) |
| | FirmType | Тип Участника клиринга: Некредитная Кредитная | M | 1 | WString(0-20) |
| FIRM | | Блок данных по участнику торгов | M | 1 | |
| | FirmID | Идентификатор участника торгов | M | 1 | String(0-16) |
| CLEARING_ACC | | Блок данных по ТКС | M | 1 | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | 1 | String(0-16) |
| | ClrAccStatus | Состояние ТКС | M | 1 | String(0-32) |
| | ClrAccType | Тип ТКС p – собственный некредитной организации b – собственный кредитной организации c – клиентский р m –раздел ДУ i – для учета обязательств Участника клиринга-продавца (для размещения ценных бумаг) n – для учета обязательств по договорам, заключенным без участия ЦК | M | 1 | String(0-16) |
| | DataChanged | Индикатор изменений Y – сегодня произошли изменения N – сегодня изменений не происходило | M | 1 | Char |
| | DateCreated | Дата создания ТКС | M | 3 | Date |
| | DateDeleted | Дата удаления ТКС (если есть) | O | 3 | Date |
| | DefaultClient | Код клиента, используемого согласно п.27.2 Правил клиринга | O | 1 | String(0-16) |
| | CommPaymentAcc | Признак раздела для уплаты возмещения и фиксированной части комиссии | O | 1 | Char |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|---------------|-----------------------|--|---|---|---------------|
| | | Y - является N - не является | | | |
| | BrokerFeeAccount | Код ТКС, с которого осуществляется списание комиссий за операции, произведенные с указанием данного ТКС (указывается в случае, если комиссии удерживаются с иного ТКС) | O | 3 | String(0-16) |
| | SeparateAccounting | Признак выделенного учета Средств обеспечения Y - производится выделенный учет Средств обеспечения, учитываемых на данном ТКС, в соответствии с Правилами клиринга N-выделенный учет не производится | M | 4 | Char |
| | ForNonCcpAccounting | Признак ТКС для учета обязательств по договорам, заключенным без участия ЦК Y - является N - не является | M | 4 | Char |
| | TrustClientIdentifier | Регистрационный код клиента, имущество которого учитывается обособленно на ТКС | O | 4 | String(0-64) |
| | FeeClutch | Признак списания комиссии в дату исполнения договора Y - оборотная часть комиссии списывается в дату исполнения договора N или отсутствие атрибута - оборотная часть комиссии списывается в дату заключения договора | O | 4 | Char |
| | OtcSettlementCurrency | Валюта расчетов обязательств, возникших на основании Внебиржевых договоров OTC/ Внебиржевых договоров репо OTC • RUB • USD | O | 4 | String(3) |
| | RepoUnavailable | Признак заключения договоров купли-продажи при урегулировании случаев неисполнения обязательств Y – заключаются договоры купли-продажи N – заключаются договоры репо | O | 4 | Char |
| BANK_ACC | | Блок данных по денежному регистру | | 1 | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты денежного регистра | M | 1 | String(0-4) |
| | CurrencyName | Наименование валюты денежного регистра | O | 1 | WString(0-32) |
| | RealAccount | Номер счета или идентификатор денежного регистра | O | 1 | String(0-64) |
| | DeliveryOnly | Признак счета, используемого только для проведения расчетов Y - является N - допускается использование средств на счете в качестве ГО | M | 1 | Char |
| /BANK_ACC | | | M | 1 | |
| DEPO_ACC | | Блок данных по депо регистру | M | 1 | |
| | DepositoryName | Код депозитария, в котором открыт субсчет RDC – РДЦ | O | 1 | String(0-16) |
| | GuarDepUnitId | Счет (субсчет) депо для учета ценных бумаг | O | 1 | String(0-64) |
| /DEPO_ACC | | | M | 1 | |
| SUBACCOUNT | | | O | 1 | |
| | FirmID | Идентификатор участника торгов | O | 1 | String(0-16) |
| | SubClrAccCode | Аналитический ТКС | O | 1 | String(0-16) |
| /SUBACCOUNT | | | O | 1 | |
| /CLEARING_ACC | | | M | 1 | |
| /FIRM | | | M | 1 | |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|----------|--|--|---|---|--|
| /MFB20 | | | M | 1 | |
| /RTS_DOC | | | M | 1 | |

MFB21 Уведомление о счетах для вывода денежных средств Участника клиринга

Формируется по итогам клиринга для расчетов по итогам торгов

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Rev | Тип |
|-------------------|-------------------|--|-----|-----|----------------|
| RTS_DOC | | | M | 1 | |
| DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | 1 | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа | M | 1 | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | Всегда MFB21 | M | 1 | String(0-20) |
| | SENDER_ID | Всегда MFBIM | M | 1 | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | 1 | WString(0-120) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | 1 | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| MFB21 | | Блок данных отчета | M | 1 | |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | 1 | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | 1 | WString(0-128) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | 1 | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | 1 | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | 1 | String(0-16) |
| | FirmName | Наименование Участника клиринга | M | 1 | WString(0-120) |
| | FirmType | Тип Участника клиринга: Некредитная Кредитная | M | 1 | WString(0-20) |
| CURRENCY | | Блок данных по валюте счета | M | 1 | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты счета | M | 1 | String(0-16) |
| | CurrencyName | Наименование валюты счета | O | 1 | WString(0-32) |
| BANK_ACC | | Блок данных по счету | M | 1 | |
| | RealAccount | Номер счета получателя | M | 1 | String(0-32) |
| | AccCode | Код счета, присвоенный КЦ при регистрации | M | 1 | String(0-64) |
| | BankName | Наименование банка получателя | M | 1 | WString(0-32) |
| | CorrAcc | Номер корреспондентского счета/номер счета получателя в банке-корреспонденте (для вывода валюты) | M | 1 | String(0-32) |
| | BankBIC | БИК | M | 1 | String(0-12) |
| | RecBankBIC | SWIFT-BIC банка- получателя (для вывода валюты) | O | 1 | String(0-12) |
| | CorBankBIC | SWIFT-BIC банка- корреспондента (для вывода валюты) | O | 1 | String(0-12) |
| | RecipientName | Наименование получателя | O | 1 | WString(0-128) |
| | BIC/BEI | BIC/BEI | O | 1 | String(0-12) |
| SETTLE | | Блок данных по ТКС, с которых можно выводить средства на данный счет | O | 1 | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | O | 1 | String(0-16) |

Спецификация клиринговых отчетов

| | FirmId | Идентификатор участника торгов | O | 3 | String(0-16) |
|-----------|--------|--------------------------------|---|---|--------------|
| /SETTLE | | | O | 1 | |
| /BANK_ACC | | | M | 1 | |
| /CURRENCY | | | M | 1 | |
| /MFB21 | | | M | 1 | |
| /RTS_DOC | | | M | 1 | |

Спецификация клиринговых отчетов

МFB22 Отчет о требованиях по погашению задолженности по денежному регистру»

Формируется по итогам клиринга для расчетов по итогам торгов при возникновении задолженности по денежному регистру

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Rev | Тип |
|-------------------|-------------------|--|-----|-----|----------------|
| RTS_DOC | | | M | 1 | |
| DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | 1 | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа | M | 1 | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | Всегда МFB22 | M | 1 | String(0-20) |
| | SENDER_ID | Всегда МFBIM | M | 1 | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | 1 | WString(0-120) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | 1 | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| MFB22 | | Блок данных отчета | M | 1 | |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | 1 | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | 1 | WString(0-128) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | 1 | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | 1 | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | 1 | String(0-16) |
| | FirmName | Наименование Участника клиринга | M | 1 | WString(0-120) |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | 1 | String(0-16) |
| SETTLE | | Блок данных по ТКС | M | 2 | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | 1 | String(0-16) |
| GROUP | | Блок данных по денежному регистру | M | 1 | |
| | BankAccCode | Код денежного регистра | M | 2 | String(0-32) |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты, в которой учитывается задолженность | M | 1 | String(0-4) |
| | CurrencyName | Наименование валюты, в которой учитывается задолженность | O | 1 | WString(0-32) |
| DEBTS | | Блок данных по задолженности по денежному регистру | M | 1 | |
| | DebtsType | Тип Задолженности: CLEARING – задолженность перед КЦ BANK – задолженность перед банком | M | 1 | String(0-12) |
| | DebtsSum | Сумма задолженности в валюте счета | M | 1 | Numeric(20,2) |
| /DEBTS | | | M | 1 | |
| /GROUP | | | M | 1 | |
| /SETTLE | | | M | 2 | |
| /FIRM | | | M | 1 | |
| /MFB22 | | | M | 1 | |
| /RTS_DOC | | | M | 1 | |

МFB23 Отчет об обязательствах по договорам

Формируется по итогам клиринга для расчетов по итогам торгов

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Rev | Тип |
|-------------------|-------------------|---|-----|-----|----------------|
| RTS_DOC | | | M | 1 | |
| DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | 1 | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа | M | 1 | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | Всегда МFB23 | M | 1 | String(0-20) |
| | SENDER_ID | Всегда МFBIM | M | 1 | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | 1 | WString(0-120) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | 1 | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| МFB23 | | Блок данных отчета | M | 1 | |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | 1 | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | 1 | WString(0-128) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | 1 | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | 1 | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | 1 | String(0-16) |
| | FirmName | Наименование Участника клиринга | M | 1 | WString(0-120) |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | 1 | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | O | 1 | String(0-16) |
| SETTLE | | Блок данных по ТКС | | 1 | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | 1 | String(0-16) |
| SETTLEDATE | | Блок данных по дате исполнения | | 1 | |
| | SettleDate | Дата исполнения | M | 1 | Date |
| POSTYPES | | Блок информации по типам обязательств | | 1 | |
| | PosType | С - информация о нетто обязательствах/требованиях по денежной позиции S - информация о нетто обязательствах/требованиях по депозитарным разделам | M | 1 | Char |
| GROUP | | Блок данных по обязательствам | | 1 | |
| | BankAccCode | Код денежного регистра | O | 1 | String(0-32) |
| | GuarDepUnitId | Счет (субсчет) депо для учета ценных бумаг | O | 1 | String(0-32) |
| RECORDS | | Блок данных по обязательствам | | 1 | |
| | DataType | Тип обязательств: TRADE – по договорам FEE – по оборотной части комиссионного вознаграждения с уплатой в день исполнения Договора | M | 4 | String(0-12) |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|-------------|------------------------|--|---|---|---------------|
| | | DIVIDEND – по возврату дивидендов по сделкам РЕПО ADDITIONAL – дополнительные обязательства, возникшие в связи с корпоративными событиями | | | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты расчётов Для Внебиржевого договора ОТС/Внебиржевого договора репо ОТС указывается идентификатор Валюты расчетов по итогам клиринга | O | 1 | String(0-4) |
| | CurrencyName | Наименование валюты расчётов Для Внебиржевого договора ОТС/Внебиржевого договора репо ОТС указывается наименование Валюты расчетов по итогам клиринга | O | 1 | String(0-30) |
| | SecurityId | Идентификатор инструмента | O | 1 | String(0-16) |
| | SecShortName | Краткое наименование инструмента | O | 1 | WString(0-32) |
| | BaseSecurityCode | Код базового актива (не указывается если совпадает с SecurityId) | O | 1 | String(0-12) |
| | DebitBeg | Входящее нетто-обязательство / обязательство | O | 1 | Numeric(28,8) |
| | CreditBeg | Входящее нетто-требование / требование | O | 1 | Numeric(28,8) |
| | VarMarginBeg | Вариационная маржа по входящему нетто-обязательству/ нетто-требованию | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | VarMargin | Вариационная маржа по сделкам за текущий день | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | DebitIntraday | Изменение обязательств в связи с заключением договоров в текущий день | O | 1 | Numeric(28,8) |
| | CreditIntraday | Изменение требований в связи с заключением договоров в текущий день | O | 1 | Numeric(28,8) |
| | DebitCorpEvCorrection | Изменение обязательств в связи с проведением корпоративного события | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | CreditCorpEvCorrection | Изменение требований в связи с проведением корпоративного события | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | PosExecDebit | Количество исполненных обязательств | O | 1 | Numeric(28,8) |
| | PosExecCredit | Количество исполненных требований | O | 1 | Numeric(28,8) |
| | Debit | Итоговое нетто-обязательство / обязательство | M | 1 | Numeric(28,8) |
| | Credit | Итоговое нетто-требование / требование | M | 1 | Numeric(28,8) |
| /RECORDS | | | M | 1 | |
| /POSTYPES | | | M | 1 | |
| /SETTLEDATE | | | M | 1 | |
| /SUBACCOUNT | | | M | 1 | |
| /SETTLE | | | M | 1 | |
| /FIRM | | | M | 1 | |
| /MFB23 | | | M | 1 | |
| /RTS_DOC | | | M | 1 | |

MFV23C Уведомление об обязательствах по Договорам (по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга)

Формируется по итогам клиринга для расчетов по итогам торгов

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Rev | Тип |
|-------------------|-------------------|---|-----|-----|----------------|
| RTS_DOC | | | M | 1 | |
| DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | 1 | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа | M | 1 | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | Всегда MFV23C | M | 1 | String(0-20) |
| | SENDER_ID | Всегда MFVIM | M | 1 | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | 1 | WString(0-120) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | 1 | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| MFV23C | | Блок данных отчета | M | 1 | |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | 1 | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | 1 | WString(0-128) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | 1 | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | 1 | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор участника клиринга | M | 1 | String(0-16) |
| | FirmName | Наименование участника клиринга | M | 1 | WString(0-120) |
| FIRM | | Блок данных по участнику торгов | M | 1 | |
| | FirmID | Идентификатор участника торгов | O | 1 | String(0-16) |
| CLIENT | | Блок данных по клиенту | | 1 | |
| | ClientCode | Краткий код клиента | M | 1 | String(0-16) |
| | ClientDetails | ИНН или № паспорта клиента | M | 1 | String(0-41) |
| SETTLEDATE | | Блок данных по дате исполнения | | 1 | |
| | SettleDate | Дата исполнения | M | 1 | Date |
| POSTYPES | | Блок информации по типам обязательств | | 1 | |
| | PosType | C - информация о нетто обязательствах/требованиях по денежной позиции S - информация о нетто обязательствах/требованиях по депозитарным разделам | M | 1 | Char |
| RECORDS | | Блок данных по обязательствам | M | 1 | |
| | DataType | Тип обязательств: TRADE – по договорам FEE – по оборотной части комиссионного вознаграждения с уплатой в день исполнения Договора DIVIDEND – по возврату дивидендов ADDITIONAL – дополнительные обязательства, возникшие в связи с корпоративными событиями | M | 4 | String(0-12) |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|-------------|------------------------|--|---|---|---------------|
| | CurrencyId | Идентификатор валюты расчётов Для Внебиржевого договора ОТС/Внебиржевого договора репо ОТС указывается идентификатор Валюты расчетов по итогам клиринга | O | 1 | String(0-4) |
| | CurrencyName | Наименование валюты расчётов Для Внебиржевого договора ОТС/Внебиржевого договора репо ОТС указывается наименование Валюты расчетов по итогам клиринга | O | 1 | String(0-30) |
| | SecurityId | Идентификатор инструмента | O | 1 | String(0-16) |
| | SecShortName | Краткое наименование инструмента | O | 1 | String(0-32) |
| | BaseSecurityCode | Код базового актива (не указывается если совпадает с SecurityId) | O | 1 | String(0-12) |
| | DebitBeg | Входящее нетто-обязательство / обязательство | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | CreditBeg | Входящее нетто-требование / требование | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | VarMarginBeg | Вариационная маржа по входящему нетто-обязательству/ нетто-требованию | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | VarMargin | Вариационная маржа по сделкам за текущий день | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | DebitIntraday | Изменение обязательств в связи с заключением договоров в текущий день | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | CreditIntraday | Изменение требований в связи с заключением договоров в текущий день | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | DebitCorpEvCorrection | Изменение обязательств в связи с проведением корпоративного события | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | CreditCorpEvCorrection | Изменение требований в связи с проведением корпоративного события | O | 1 | Numeric(20,2) |
| | PosExecDebit | Количество исполненных обязательств | O | 1 | Numeric(20,0) |
| | PosExecCredit | Количество исполненных требований | O | 1 | Numeric(20,0) |
| | Debit | Итоговое нетто-обязательство / обязательство | M | 1 | Numeric(20,2) |
| | Credit | Итоговое нетто-требование / требование | M | 1 | Numeric(20,2) |
| /RECORDS | | | M | 1 | |
| /POSTYPES | | | M | 1 | |
| /SETTLEDATE | | | M | 1 | |
| /CLIENT | | | M | 1 | |
| /FIRM | | | M | 1 | |
| /MFB23C | | | M | 1 | |
| /RTS_DOC | | | M | 1 | |

МFB76 Отчет о взносах в Гарантийный фонд

Формируется по итогам клиринга для расчетов по итогам торгов

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Rev | Тип |
|-------------------|------------------------|---|-----|-----|----------------|
| RTS_DOC | | | M | 1 | |
| DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | 1 | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа | M | 1 | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | Всегда МFB76 | M | 1 | String(0-20) |
| | SENDER_ID | Всегда МFBIM | M | 1 | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | 1 | WString(0-120) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | 1 | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| МFB76 | | Блок данных отчета | M | 1 | |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | 1 | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | 1 | WString(0-128) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | 1 | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | 1 | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | 1 | String(0-16) |
| | FirmName | Наименование Участника клиринга/Гаранта | M | 1 | WString(0-120) |
| ENTRY | | Блок данных по взносу в Гарантийный фонд | O | 1 | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты взноса | O | 1 | String(0-4) |
| | CurrencyName | Наименование валюты взноса | O | 1 | WString(0-30) |
| | SecurityId | Идентификатор инструмента | O | 1 | String(0-16) |
| | ISIN | Международный идентификатор ценной бумаги | O | 1 | String(0-32) |
| | ContributionSum | Количество | M | 1 | Numeric(20,2) |
| /ENTRY | | | O | | |
| RECORDS | | Блок данных по обязательствам | M | | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты фонда | O | 1 | String(0-4) |
| | CurrencyName | Наименование валюты фонда | O | 1 | WString(0-30) |
| | GFObligation | Обязательство по взносу в Гарантийный фонд | M | 1 | Numeric(20,2) |
| | GFContribution | Величина взноса Участника клиринга/Гаранта в Гарантийный фонд участников/специальный Гарантийный фонд | M | 1 | Numeric(20,2) |
| | ContributionSharePart | Доля взноса Участника клиринга в Гарантийном фонде участников | M | 1 | Numeric(20,4) |
| | ContributionShareTotal | Доля взноса Участника клиринга в общей величине Гарантийного фонда участников | M | 1 | Numeric(20,4) |
| /RECORDS | | | M | 1 | |
| /МFB76 | | | M | 1 | |
| /RTS_DOC | | | M | 1 | |

MFB82 Уведомление о зарегистрированных кодах/кратких кодах клиентов Участника клиринга и (или) Участника клиринга

Формируется по итогам клиринга для расчетов по итогам торгов

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Rev | Тип |
|-------------------|-----------------------------|--|-----|-----|----------------|
| RTS_DOC | | | M | 1 | |
| DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | 1 | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа | M | 1 | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | Всегда MFB82 | M | 1 | String(0-20) |
| | SENDER_ID | Всегда MFBIM | M | 1 | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | 1 | WString(0-120) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | 1 | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| MFB82 | | Блок данных отчета | M | 1 | |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | 1 | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | 1 | WString(0-128) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | 1 | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | 1 | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | 1 | String(0-16) |
| | FirmName | Наименование Участника клиринга | M | 1 | WString(0-120) |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | 1 | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | 1 | String(0-16) |
| RECORDS | | Блок данных о клиентах | M | 1 | |
| | ClientCode | Краткий код клиента | M | 1 | String(0-16) |
| | Principal | Идентификация лица, для которого зарегистрированы коды (учетный регистр) – клиент Участника клиринга или Участник клиринга Y – Участник клиринга N – клиент Участника клиринга | M | 1 | Char |
| | Type | Тип клиента/ Участника клиринга | M | 1 | String(0-3) |
| | Details | ИНН или № паспорта клиента или иной код клиента/ Участника клиринга | M | 1 | WString(0-41) |
| | CountryCode | Код страны | O | 1 | String(0-4) |
| | Q_Investor | Признак квалифицированного инвестора: Y – да N – нет. | O | 1 | Char |
| | IdentificationCode | Регистрационный код клиента/ Участника клиринга | M | 4 | WString(0-120) |
| | IndividualInvestmentAccount | Признак ИИС: Y – да N – нет. | O | 3 | Char |
| | Status | Статус клиента A - активный | M | 1 | Char |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|----------|-------------|--|---|---|------|
| | | N – неактивированный D - удаленный | | | |
| | DateOpen | Дата регистрации клиента | M | 1 | Date |
| | DateClose | Дата удаления клиента | O | 1 | Date |
| | DataChanged | Индикатор изменений Y – сегодня произошли изменения N – сегодня изменений не происходило | M | 1 | Char |
| /RECORDS | | | M | 1 | |
| /FIRM | | | M | 1 | |
| /MFB82 | | | M | 1 | |
| /RTS_DOC | | | M | 1 | |

МFB98 Отчет о глобальных операциях и об обязательствах/требованиях по передаче дохода

Формируется с даты включения обязательств/требований по передаче дохода в клиринговый пул или с даты заключения Договора, порядок исполнения обязательств по которому подлежит изменению в связи с реорганизацией эмитента ценных бумаг, конвертацией и (или) дроблением ценных бумаг, проводимой без реорганизации эмитента ценных бумаг, или иных действия, влияющих на исполнение обязательств по Договору, до момента исполнения этих обязательств

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Rev | Тип |
|-------------------|-------------------|---|-----|-----|----------------|
| RTS_DOC | | Корневой элемент (root element) XML документа | M | 1 | |
| DOC_REQUISITES | | Блок информации о документе | M | 1 | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | 1 | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа | M | 1 | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | Всегда МFB98 | M | 1 | String(0-20) |
| | SENDER_ID | Всегда МFBIM | M | 1 | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | 1 | WString(0-120) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | 1 | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| MFB98 | | Блок данных отчета | M | 1 | |
| | ReportDate | Дата отчета | M | 1 | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | 1 | WString(0-128) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | 1 | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | 1 | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | 1 | String(0-12) |
| | FirmName | Наименование Участника клиринга | M | 1 | WString(0-120) |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | 1 | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | 1 | String(0-12) |
| SETTLE | | Блок данных по ТКС | M | 1 | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | 1 | String(0-12) |
| GROUP | | Блок данных по обязательствам | O | 1 | |
| | BankAccCode | Код денежного регистра | O | 1 | String(0-32) |
| | GuarDepUnitId | Счет (субсчет) депо для учета ценных бумаг | O | 1 | String(0-32) |
| RECORDS | | Блок данных по обязательствам | M | 1 | |
| | TradeNo | Номер договора в Системе торгов | M | 1 | Integer |
| | OperationNo | Номер операции по передаче Дохода/ ценных бумаг | O | 1 | Integer |
| | ClientCode | Краткий код клиента или клиента Участника клиринга | O | 2 | String(0-16) |
| | TradeDate | Дата заключения договора | M | 1 | Date |
| | SettleDate1 | Дата исполнения 1-ой части | M | 1 | Date |
| | SettleDate2 | Дата исполнения 2-ой части (если есть) | O | 2 | Date |
| | DebitCredit | Направленность обязательства по передаче Дохода/по передаче ценных бумаг D – Обязательство C - Требование | M | 1 | Char |
| | SecurityId | Идентификатор ценной бумаги по договору | M | 1 | String(0-16) |
| | SecShortName | Краткое наименование ценной бумаги по договору | O | 1 | WString(0-30) |
| | ISIN | ISIN ценной бумаги по договору | O | 1 | String(12) |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|----------|-----------------|--|---|---|---------------|
| | Quantity | Объём договора, в ценных бумагах | M | 1 | Numeric(20,0) |
| | Type | Вид дохода/операции: DIVIDEND_PAYMENT - дивиденды COUPON_PAYMENT – купонный доход STOCK_SPLIT – начисление ценных бумаг в связи с проведением дробления REVERSE_SPLIT – списание ценных бумаг в связи с проведением консолидации SPIN_OFF – выделение компании | M | 1 | String(0-20) |
| | RecordDate | Дата закрытия реестра по корпоративному событию | M | 2 | Date |
| | PaymentDate | Дата проведения корпоративного события эмитентом | M | 2 | Date |
| | ObligationDate | Дата передачи Дохода/ ценных бумаг/корректировка обязательств КЦ | M | 2 | Date |
| | FullNetto | Способ исполнения обязательств по передаче Дохода: атрибут не указывается, если Дата исполнения не наступила Y - исполнение обязательств зачетом (атрибут OperationNo не заполняется) N - перевод активов при исполнении нетто-обязательств (атрибут OperationNo заполняется) | O | 2 | Char |
| | NewSecurityId | Идентификатор ценной бумаги, начисляемой как дополнительное обязательство или дивиденды в натуральной форме | O | 4 | String(0-16) |
| | NewSecShortName | Краткое наименование ценной бумаги, начисляемой как дополнительное обязательство или дивиденды в натуральной форме | O | 4 | WString(0-30) |
| | NewISIN | ISIN ценной бумаги, начисляемой как дополнительное обязательство или дивиденды в натуральной форме | O | 4 | String(12) |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты Доходов (указывается при выплате доходов в денежной форме) | O | 4 | String(0-4) |
| | CurrencyName | Наименование валюты Доходов (указывается при выплате доходов в денежной форме) | O | 1 | WString(0-32) |
| | Price | Доход на одну ценную бумагу (купон или амортизация)/ количество ценных бумаг, начисляемое/списываемое на одну ценную бумагу | M | 1 | Numeric(20,6) |
| | TaxRate | Ставка налога на дивиденды (в процентах) | O | 2 | Numeric(18,8) |
| | Sum | Сумма обязательства / требования по передаче Дохода/ ценных бумаг | M | 1 | Numeric(20,2) |
| /RECORDS | | | M | 1 | |
| /GROUP | | | M | 1 | |
| /SETTLE | | | M | 1 | |
| /FIRM | | | M | 1 | |
| /MFB98 | | | M | 1 | |
| /RTS_DOC | | | M | 1 | |

Спецификация клиринговых отчетов

MFB98A Уведомление о размере обязательств/требований по передаче Дохода

Формируется в день расчета или корректировки предварительной оценки обязательств/требований по передаче дохода

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Rev | Тип |
|-------------------|-------------------|--|-----|-----|----------------|
| RTS_DOC | | Корневой элемент (root element) XML документа | M | 1 | |
| DOC_REQUISITES | | Блок информации о документе | M | 1 | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | 1 | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа | M | 1 | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в системе ЭДО | M | 1 | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | Всегда MFB98A | M | 1 | String(0-20) |
| | SENDER_ID | Всегда MFBIM | M | 1 | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | 1 | WString(0-120) |
| | RECEIVER_ID | Код ЭДО РТС получателя | M | 1 | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | 1 | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| MFB98 | | Блок данных отчета | M | 1 | |
| | ReportDate | Дата отчета | M | 1 | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | 1 | WString(0-128) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | 1 | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | 1 | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | 1 | String(0-16) |
| | FirmName | Наименование Участника клиринга | M | 1 | WString(0-120) |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | 1 | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | 1 | String(0-12) |
| SETTLE | | Блок данных по ТКС | M | 1 | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | 1 | String(0-12) |
| GROUP | | Блок данных по обязательствам | O | 1 | |
| | BankAccCode | Код денежного регистра | O | 1 | String(0-32) |
| | GuarDepUnitId | Счет (субсчет) депо для учета ценных бумаг | O | 1 | String(0-32) |
| RECORDS | | Блок данных по обязательствам | M | 1 | |
| | TradeNo | Номер договора в Системе торгов | M | 1 | Integer |
| | ClientCode | Краткий код клиента или клиента Участника клиринга | O | 1 | String(0-12) |
| | TradeDate | Дата заключения договора | M | 1 | Date |
| | SettleDate1 | Дата исполнения 1-ой части | M | 1 | Date |
| | SettleDate2 | Дата исполнения 2-ой части | M | 1 | Date |
| | DebitCredit | Направленность обязательства по передаче Дохода D – Обязательство C - Требование | M | 1 | Char |
| | SecurityId | Идентификатор ценной бумаги | M | 1 | String(0-12) |
| | SecShortName | Краткое наименование ценной бумаги | O | 1 | WString(0-30) |
| | ISIN | ISIN ценной бумаги | O | 1 | String(12) |
| | Quantity | Объём договора, в ценных бумагах | M | 1 | Numeric(20,0) |
| | Type | Вид дохода: DIVIDEND_PAYMENT - дивиденды. | M | 1 | String(0-20) |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | COUPON_PAYMENT – купонный доход | | | |
|----------|-----------------|---|---|---|---------------|
| | RecordDate | Дата закрытия реестра по корпоративному событию | M | 2 | Date |
| | PaymentDate | Дата проведения корпоративного события эмитентом | M | 2 | Date |
| | ObligationDate | Дата передачи Дохода (дивидендов) КЦ | M | 2 | Date |
| | NewSecurityId | Идентификатор ценной бумаги, начисляемой как дивиденды акциями | O | 4 | String(0-16) |
| | NewSecShortName | Краткое наименование ценной бумаги, начисляемой как дивиденды акциями | O | 4 | WString(0-30) |
| | NewISIN | ISIN ценной бумаги, начисляемой как дивиденды акциями | O | 4 | String(12) |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты Доходов (указывается при выплате доходов в денежной форме) | O | 1 | String(0-4) |
| | CurrencyName | Наименование валюты Доходов (указывается при выплате доходов в денежной форме) | O | 1 | WString(0-32) |
| | Price | Доход на одну ценную бумагу (размер дивиденда, купон или амортизация) | M | 1 | Numeric(20,6) |
| | TaxRate | Ставка налога на денежный Доход (в процентах) | O | 2 | Numeric(18,8) |
| | Sum | Сумма обязательства/требования по передаче Дохода | M | 1 | Numeric(20,2) |
| /RECORDS | | | M | 1 | |
| /GROUP | | | M | 1 | |
| /SETTLE | | | M | 1 | |
| /FIRM | | | M | 1 | |
| /MFB98 | | | M | 1 | |
| /RTS_DOC | | | M | 1 | |

МФВ99 Отчет об обеспечении

Формируется по итогам клиринга для расчетов по итогам торгов

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Rev | Тип |
|-------------------|-------------------|---|-----|-----|----------------|
| RTS_DOC | | Корневой элемент (root element) XML документа | M | 1 | |
| DOC_REQUISITES | | Блок информации о документе | M | 1 | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | 1 | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа | M | 1 | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | Всегда МФВ99 | M | 1 | String(0-20) |
| | SENDER_ID | Всегда МФВIM | M | 1 | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | 1 | WString(0-120) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | 1 | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | 1 | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | 1 | |
| МФВ99 | | Блок данных отчета | M | 1 | |
| | ReportDate | Дата отчета | M | 1 | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | 1 | WString(0-128) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | 1 | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | 1 | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | 1 | String(0-16) |
| | FirmName | Наименование Участника клиринга | M | 1 | WString(0-120) |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | 1 | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | 1 | String(0-16) |
| SETTLE | | Блок данных по ТКС | M | 1 | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | 1 | String(0-16) |
| POSTYPES | | Блок информации по типам обязательств | M | 1 | |
| | PosType | C - информация о средствах, учитываемых на денежном регистре S - информация позициях, учитываемых на депо регистре | M | 1 | Char |
| GROUP | | Блок данных по обязательствам | M | 1 | |
| | BankAccCode | Код денежного регистра | O | 1 | String(0-32) |
| | GuarDepUnitId | Счет (субсчет) депо для учета ценных бумаг | O | 1 | String(0-32) |
| RECORDS | | Блок данных по обязательствам | M | 1 | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты средств обеспечения | O | 1 | String(0-4) |
| | CurrencyName | Наименование валюты средств обеспечения | O | 1 | WString(0-32) |
| | SecurityId | Идентификатор инструмента | O | 1 | String(0-16) |
| | ISIN | Международный идентификатор ценной бумаги | O | 1 | String(0-32) |
| | SecShortName | Краткое наименование инструмента | O | 1 | WString(0-32) |
| | OpeningBalance | Входящий остаток | M | 1 | Numeric(28,8) |
| | ClosingBalance | Исходящий остаток | M | 1 | Numeric(28,8) |
| | OpeningDebtsSum | Входящая задолженность по денежному регистру | O | 3 | Numeric(28,8) |
| | DebtsSum | Задолженность по денежному регистру | O | 1 | Numeric(28,8) |
| | DebitSum | Итого по дебету | M | 1 | Numeric(28,8) |
| | CreditSum | Итого по кредиту | M | 1 | Numeric(28,8) |

Спецификация клиринговых отчетов

| ENTRY | | Данные по операции | M | 1 | |
|-------|---------------|--|---|---|-------------|
| | OperationCode | <p>Код операции с Обеспечением:</p> <p>1- внесение/возврат средств обеспечения/ 2- внесение/возврат средств обеспечения на основании перевода между регистрами, осуществленного Участником; 5- исполнение обязательств/требований по договорам с наступившей Датой исполнения; 8 – обязательства по передаче дохода/ценных бумаг; 9- списание/ зачисление вариационной маржи; 10- списание оборотной части/начисление возвратной премии по комиссионному вознаграждению за организацию торгов; 11- списание оборотной части/начисление возвратной премии по клиринговой комиссии; 12- списание оборотной части/начисление возвратной премии по лицензионному вознаграждению; 13- списание ежемесячного торгового сбора; 14- списание ежемесячной клиринговой комиссии; 15- списание ежемесячного лицензионного вознаграждения; 16- списание штрафа за возникновение задолженности по денежному регистру; 17- списание комиссии за принудительное закрытие позиции; 18- внесение/возврат средств в Гарантийный Фонд; 19- списание штрафа за невыполнение донорских обязательств; 20 – списание/начисление штрафа в связи с заключением с КЦ договоров репо (двух договоров купли-продажи) с целью урегулирования возможного неисполнения обязательств и с целью исполнения обязательств по договорам 21- списание штрафа за неисполнение обязательств перед другим участником клиринга (по внебиржевым договорам) 22 – списание/начисление компенсации при принудительном закрытии Участника клиринга при наличии возможного неисполнения обязательств 23 – списание/зачисление денежных средств при проведении процедуры замены валюты денежных средств обеспечения 24 – списание клиринговой комиссии за списание с Торгового счета/Субсчета депо ценных бумаг иностранного эмитента, учитываемых в качестве Средств обеспечения Участника клиринга, на основании поручения на списание ценных бумаг или на основании поручения на перевод ценных бумаг, если в качестве счета депо зачисления указывается не Торговый счет/Субсчет депо, в количестве, превышающем совокупное количество ценных бумаг данного иностранного эмитента, внесенных в качестве Средств обеспечения данным Участником клиринга, а также полученных на Торговый счет депо/Субсчет депо в результате осуществления глобальной операции с ценными бумагами 25 – списание клиринговой комиссии за проведение процедуры замены валюты денежных средств обеспечения 26 – списание комиссии за прием Поручений на клиринг внебиржевых договоров по заключенным Конверсионным договорам 28 - ввод-вывод активов в результате корпоративных действий 29 - списание клиринговой комиссии за 1) договоры репо, заключённые в Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» на основании Заявок, в которых указаны торгово-клиринговые счета,</p> | M | 3 | String(0-3) |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|-----------|---------------|---|---|---|---------------|
| | | <p>зарегистрированные на одного Участника торгов, 2) внебиржевые договоры репо ОТС (Пары внебиржевых договоров ОТС), заключённые на основании Оферты ОТС типа 2, и связанные Внебиржевые договоры репо ОТС (связанные Пары внебиржевых договоров ОТС), заключенные на основании связанной Оферты ОТС, при условии направления Оферты ОТС типа 2, в которых указаны торгово-клиринговые счета, зарегистрированные на одного Участника клиринга, предметом которых являются ценные бумаги, относящиеся к Группе инструментов «иностранные ценные бумаги», и из Внебиржевых договоров ОТС, за исключением Внебиржевых договоров ОТС, предметом которых являются ценные бумаги российских эмитентов и иностранные финансовые инструменты, квалифицированные в качестве облигаций и номинированные в валюте, отличной от российского рубля</p> <p>30 - списание клиринговой комиссии за 1) договоры репо, заключённые в Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» на основании Заявок, в которых указаны торгово-клиринговые счета, зарегистрированные на одного Участника торгов, 2) внебиржевые договоры репо ОТС (Пары внебиржевых договоров ОТС), заключённые на основании Оферты ОТС типа 2, и связанные Внебиржевые договоры репо ОТС (связанные Пары внебиржевых договоров ОТС), заключенные на основании связанной Оферты ОТС, при условии направления Оферты ОТС типа 2, в которых указаны торгово-клиринговые счета, зарегистрированные на одного Участника клиринга, предметом которых являются ценные бумаги, относящиеся к Группе инструментов «еврооблигации», и из Внебиржевых договоров ОТС, предметом которых являются финансовые инструменты, квалифицированные в качестве облигаций и номинированные в валюте, отличной от российского рубля</p> <p>31 - списание клиринговой комиссии за ведение клиринговых регистров УК в целях ведения отдельного учета в рамках ТКС, зарегистрированного для отдельного клиента УК 32 - списание клиринговой комиссии за возврат Средств обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте 33 - списание клиринговой комиссии за ведение клиринговых регистров Участника клиринга, допущенного к клиринговому обслуживанию 34 - списание клиринговой комиссии за проведение расчетов по итогам клиринга договоров 35 - списание биржевой комиссии за торговлю в дополнительную утреннюю сессию</p> | | | |
| | Purpose | Пояснения к операции (если есть) | O | 3 | WString(512) |
| | OperationTime | Время проведения операции в учете КЦ | O | 1 | Time |
| | DocNo | Номер документа, присвоенный КЦ | O | 1 | String(0-32) |
| | CustomerNo | Номер документа, присвоенный участником (если есть) | O | 3 | String(0-32) |
| | Debit | Дебет | M | 1 | Numeric(28,8) |
| | Credit | Кредит | M | 1 | Numeric(28,8) |
| | ClientCode | Краткий код клиента, указанный в заявлении на операцию с активами | O | 3 | String(0-32) |
| /ENTRY | | | | 1 | |
| /RECORDS | | | | 1 | |
| /GROUP | | | | 1 | |
| /POSTYPES | | | | 1 | |
| /SETTLE | | | | 1 | |

Спецификация клиринговых отчетов

| | | | | | |
|----------|--|--|--|---|--|
| /FIRM | | | | 1 | |
| /MFB99 | | | | 1 | |
| /RTS_DOC | | | | 1 | |