

ЕТС. Изменения отчетов Срочного рынка.

Описание изменений к релизу Spectra-9.3.

Оглавление

1	ВСТУПЛЕНИЕ.....	3
2	Цикл обработки сделок/обязательств за сессию	4
2.1	Торги	4
2.2	Клиринг.....	4
2.3	Расчеты	4
3	Описание изменений в отчетах.....	5
3.1	Сравнение отчетов до ЕТС и в ЕТС	5
3.2	Информация по сделкам	6
3.3	Информация по позициям.....	6
3.4	Информация по обеспечению, движение обеспечения за сессию и плановые обязательства/требования по итогам Клиринга	6
3.4.1	До ЕТС	6
3.4.2	В ЕТС информация по обеспечению	6
3.4.3	В ЕТС Плановые обязательства по итогам Клиринга.....	9
3.4.4	В ЕТС движение обеспечения за сессию.	10
3.4.5	В ЕТС monsettl - Отчет по деньгам БФ/РФ по итогам Расчетной сессии.....	11
3.5	В ЕТС контрольные суммы и проверки для некоторых полей некоторых отчетов	11
3.6	Маржинальные требования	12
4	Список изменений в отчетах СР в рамках проекта Единая Торговая сессия.....	13
5	ПРИЛОЖЕНИЕ 1.....	23
5.1	Отчет MONXXYY.csv/MONCLXXYYZZ.csv (Клиринговая сессия), MONSETTLE/MONSETTLCLXXYYZZ.csv (Расчетная Сессия). Структура полей одинаковая.	23

6	ПРИЛОЖЕНИЕ 2.....	40
6.1	Отчет CHARGESXXYY.csv/CHARGESCLXXYYZZZ.csv.	40
6.1.1	Описание логики построения отчета	40
6.1.2	Формат отчета.....	40
7	ПРИЛОЖЕНИЕ 3.....	42
7.1	PayXXYY.csv, PayclXXYYZZZ.csv	42
7.1.1	Описание логики работы отчета	42
7.1.2	Формат отчета.....	42
8	ПРИЛОЖЕНИЕ 4.....	44
8.1	fposXXYY.csv, fposclXXYYZZZ.csv.....	44
8.2	oposXXYY.csv, oposclXXYYZZZ.csv.....	51
9	ПРИЛОЖЕНИЕ 5.....	57
9.1	Отчет F14.xlsx	57
10	Приложение 6. Отчет о маржинальных требованиях mtXX00.csv	66

1 ВСТУПЛЕНИЕ

Начиная с релиза Spectra 9.3, торги на Срочном Рынке будут проводиться в режиме Единой Торговой Сессии (ЕТС). Это означает, что торговый день будет соответствовать календарному дню. Исключение составляют дни, когда проводится Дополнительная Сессия Выходного Дня (ДСВД). Так же, как и сейчас, сделки ДСВД относятся к ближайшему торговому дню и рассчитываются в ближайший клиринг.

До ЕТС

- Клиринговая сессия проходит с 18:50 до 19:05 (расписание здесь и ниже приведено на момент выхода документации).
 - В Клиринговую сессию определяются нетто обязательства/ требования в RUR.
 - В Клиринговую сессию проводятся начисление и расчет начисленных сумм обязательств / требований в RUR, т.е. расчеты проводятся в T+0.
- Отчеты по итогам торгового дня предоставляются после 19:05.
- Позиции по инструментам меняются в момент заключения сделки.
- Торговый день включает в себя период с 19:05 предыдущего календарного дня по 18:50 текущего календарного дня.

В ЕТС

- Клиринг проходит с 23:50 до 00:30. В Клиринговую сессию проводятся начисление и фиксация нетто обязательства/требования в RUR.
- В ЕТС меняется схема расчетов. Расчеты в RUR проводятся в T+1 в Расчетную Сессию (РС) в 20:00 следующего торгового дня. В дни ДСВД Расчетная Сессия не проводится.
- Отчеты предоставляются
 - по итогам Клиринговой Сессии МТМ после 00:30
 - по итогам Расчетной Сессии после 20:00.
- Позиции по инструментам меняются в момент заключения сделки. Логика расчета позиций по инструментам в ЕТС не меняется.
- Торговый день соответствует календарному дню. Сделки ДСВД относятся к дню, когда проводится ближайший клиринг.

Отмена ПК

- В одном релизе с ЕТС выполнена задача по отмене Промежуточного Клиринга (ПК)
 - Начиная с релиза Spectra 9.3, Промежуточный Клиринг не проводится
 - Отчет по итогам Промежуточного Клиринга не предоставляется.

Подробнее о жизненном цикле торгового дня в ЕТС рассказано в [презентации](#) (см. также <https://www.moex.com/s3886>).

2 Цикл обработки сделок/обязательств за сессию

2.1 Торги

- В торговые дни с 8:50 до 23:50 проводятся Аукционы открытия, утренний, дневной и вечерний торговые периоды.
- В ДСВД с 9:00 до 19:00 проводится Аукцион открытия ДСВД и Дополнительная Сессия Выходного Дня.

2.2 Клиринг

- С 23:50 до 00:30 проводится Клиринговая сессия, в которой рассчитываются и фиксируются суммы обязательств / требований (общее название суммы обязательств / требований – «mtm – регистры»), включая вариационную маржу (BM), премии, комиссии, сборы, штрафы и иные платежи.
 - Суммы BM, премии и комиссий рассчитываются, фиксируются в отчетах (f04, o04 – по сделкам и сводные данные в отчетах fpos, opos, mon) и в клиринговой реплике в потоке FORTS_CLR_REPL.
 - По итогам Клиринговой сессии у Участников возникают обязательства/требования с расчетами на следующий торговый день (в T+1).
 - По итогам пятницы возникают обязательства/требования с датой исполнения в понедельник, даже при наличии ДСВД в выходные.
- В Клиринговую сессию проводится расчет нетто обязательства / требования. Итоговая сумма нетто обязательства / требования называется «mtm-регистр».
 - Если значение mtm отрицательное, то сумма mtm спишется в 20:00 в Расчетную сессию
 - Если значение mtm положительное, то сумма mtm зачислится в 20:00 в Расчетную сессию
- Позиция по инструментам меняется в момент заключения сделки.
- Важно! Торговые лимиты рассчитываются с учетом mtm обязательств/требований. В Расчетную сессию не происходит изменения торговых лимитов, так как суммы mtm учтены сразу после Клиринговой сессии.

2.3 Расчеты

- В 20:00 в Расчетную сессию будут проведены расчеты по обязательствам / требованиям, которые были начислены в Клиринговую сессию в предыдущий день. В результате Расчетной сессии:
 - В торговых потоках изменится значение «фактическая позиция в RUR» в таблицах part и part_sa. Фактическая позиция в торговых потоках рассчитывается только по БФ и РК, по 7KK не транслируется.
 - В клиринговой реплике (таблицы money_clearing/ money_clearing_sa) изменятся значения фактической позиции и детализация фактической позиции, т.е. суммы вармаржи, премии, комиссий. Поля «*mtm», т.е. в которых указаны суммы обязательств / требований будут обнулены.
 - По итогам Расчетной сессии формируется отчет monsettl.
- На этом цикл обработки сделок/обязательств за сессию завершен.

3 Описание изменений в отчетах

3.1 Сравнение отчетов до ЕТС и в ЕТС

До ЕТС: что изменится в отчетах

Сейчас Расчеты T+0	Информация по сделкам	Информация по позициям	Информация по обеспечению	Движение обеспечения за сессию
Отчет	f04, o04	<u>fpos</u> , <u>opos</u>	mon	Pay, <u>paycb</u>
Описание	указана ВМ, премия и комиссия по сделкам	определена ВМ по сделкам и ВМ по позициям на начало дня	- Итоги по РК, БФ, 7КК в RUR - Значение <u>mon.pay</u> расшифровано в отчете pay	Детализация платежей, кроме ВМ, премии и комиссии по безадресным сделкам

В ЕТС Расчеты T+1, появляется плановая и фактическая позиции в RUR

В ЕТС Расчеты T+1	Информация по сделкам	Информация по позициям	Информация по обеспечению	Движение обеспечения за сессию, плановые обязательства
Отчет	f04, o04	<u>fpos</u> , <u>opos</u>	mon, <u>monsettl</u>	Pay, <u>paycb</u> , charges
Описание	- Расчеты на T+1. ВМ, премия и комиссия по сделкам – это начисленные значения. - Названия полей не изменились. Изменилось правило обработки указанной суммы. Добавлено поле <u>settle_date</u> – дата Расчетной сессии	- Расчеты на T+1. ВМ по сделкам и ВМ по позициям на начало дня – это начисленные значения. - Названия полей не изменились. Изменилось правило обработки указанной суммы. Добавлено поле <u>settle_date</u> – дата Расчетной сессии	- Итоги по РК, БФ, 7КК в RUR - В отчет добавлены поля для начисленных сумм ВМ, премии и комиссии. - Вместо поля pay появились поля <u>in_out_netto</u> и charges - Значение <u>mon.charges_mtm</u> расшифровано в новом отчете charges	- Pay - Детализация платежей, кроме ВМ, премии В Pay добавлены операции комиссии по безадресным сделкам - Отчет Pay детализирует суммы <u>mon.in_out_netto</u> + <u>mon.charges</u> Charges – детализация начисленных обязательств / требований

3.2 Информация по сделкам

- В конец отчетов f04, o04, multilegf04, multilegf04 добавлено поле settle_date – дата Расчетной сессии. Остальные поля и последовательность полей не изменились.
- В полях отчетов, соответствующих вармарже, премии и комиссиям в ЕТС, указаны начисленные значения.
- Сумма значений по вармарже, премии и комиссиям, сгруппированная по инструментам, указана в соответствующих полях в отчетах fpros, opos.
- Сумма значений по вармарже, премии и комиссиям, сгруппированная по 7KK, БФ, РК, указана в соответствующих полях в отчете mon. В отчет mon добавлены новые поля для отображения начисленных значений («mtm – регистров»).
- Отчет формируется после 00:30 по итогам Клиринговой сессии

3.3 Информация по позициям

- В конец отчетов fpros, opos добавлено поле settle_date – дата Расчетной сессии. Остальные поля и последовательность полей не изменились.
- В полях отчетов, соответствующих вармарже, премии и комиссиям в ЕТС, указаны начисленные значения, рассчитанные на основании сделок, заключенных за сессию, за которую проводится клиринг.
- Корректировки вармаржи, премии или комиссий не учитываются в расчете соответствующих значений в отчетах fpros, opos. В полях отчетов fpros, opos соответствующих вармарже, премии и комиссиям значения рассчитаны на основании сделок.
- Отчет формируется после 00:30 по итогам Клиринговой сессии

3.4 Информация по обеспечению, движение обеспечения за сессию и плановые обязательства/требования по итогам Клиринга

3.4.1 До ЕТС

Ниже приведены две кросс-проверки, которые будут изменены в ЕТС:

- Значение поля mon.rau расшифровано в отчете rau
- Отчет rau не включают комиссию за безадресные сделки. (Комиссия за безадресные сделки указана в полях mon.fut_sbor, mon.opt_sbor).

3.4.2 В ЕТС информация по обеспечению:

Отчет mon:

- Отчет формируется после 00:30 по итогам Клиринговой сессии.

- В отчет добавлены новые поля для отображения нетто обязательств/требований по вармарже, премии, комиссиям, штрафам и иным обязательствам, которые начисляются в Клиринговую сессию. Названия новых полей образованы как «существующее название поля» плюс постфикс «_mtm». Например, var_marg_mtm.
- Из отчета mon удалено поле pay – «Изменение суммы денежных средств в рублях РФ и/ или оценочной стоимости иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу в течение дня (в рублях РФ)». Вместо pay добавлены два новых поля charges и in_out_netto.
- В отчет добавлены поля:
 - in_out_netto - Изменение суммы денежных средств в рублях РФ и/ или оценочной стоимости иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу в течение дня (в рублях РФ) **по операциям ввода / вывода**. В отличие от поля mon.pay, которое было раньше, в новом поле mon.in_out_netto отображаются только операции ввода / вывода.
 - charges_mtm - Начисленные обязательства по уплате комиссий, штрафов и обязательства по выплате / получению единовременного платежа по выходу из вечного фьючерса.
 - charges - Фактическое исполнение обязательства по уплате комиссий, штрафов и обязательства по выплате / получению единовременного платежа по выходу из вечного фьючерса / корректировки вармаржи. Обратите внимание, что корректировка вармаржи будет учтена при расчете mon.charges, а не mon.var_marg.
 - settle_date - Дата Расчетной сессии.
 - var_marg_mtm - вариационная маржа, начисленная в Клиринговую сессию.
 - prem_mtm - премия, начисленная в Клиринговую сессию.
 - fut_sbor_mtm, opt_sbor_mtm, sbor_ex_mtm, sbor_cc_mtm - новые поля о начисленных комиссиях.
 - amount_end_mtm - Плановая, рассчитанная с учетом начисленных mtm значений, сумма денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на конец отчетного дня.
- Вместо поля pay предлагается использовать два поля in_out_netto + charges.
 - In_out_netto – это сумма вводов / выводов за сессию.
 - Charges – сумма расчетов по обязательствам, которые начислены в Клиринговую сессию предыдущего дня и рассчитаны в Расчетную сессию, и ручным операциям и корректировкам за сессию с текущей датой расчетов.
- Значение mon.charges_mtm включает суммы начисленных комиссий, которые детализированы в новых полях комиссий (*_mtm) отчета mon, и другие операции с датой расчетов T+1. Список операций, на основании которых получено значение mon.charges_mtm, расшифрован в новом отчете charges, см. описание «плановые обязательства по итогам Клиринга».

- Сумма значений `mon.in_out_netto` + `mon.charges` расшифрована в отчете `rau`, см. описание [«Движение обеспечения за сессию»](#). Отчет `rau` содержит список платежей за текущую дату, кроме платежей по вармарже и премии. Обратите внимание, что по сравнению с предыдущей версией отчета `rau` отчет будет включать платежи за комиссии за безадресные сделки.
- `Mon.charges` включает суммы комиссий, которые детализированы в полях комиссий отчета `mon`, и другие операции, список которых приведен в отчете `rau`, см. описание «движение обеспечения за сессию».
- `var_marg_mtm` - вариационная маржа, начисленная в Клиринговую сессию. Значение совпадает с суммой вармаржи по сделкам в отчетах `f04`, `o04` по 7КК за сессию, за которую проведен клиринг.
- `var_marg` - вариационная маржа, списанная / зачисленная в Расчетную сессию. В Расчетную сессию рассчитано обязательство / требование по вариационной марже, которая начислена в предыдущую Клиринговую сессию. Значение совпадает с числом в поле `mon.var_marg_mtm` в отчете `mon` за предыдущую Клиринговую сессию.
- `prem_mtm` - премия, начисленная в Клиринговую сессию. Значение совпадает с суммой премий по сделкам в отчете `o04` по 7КК за сессию, за которую проведен клиринг.
- `prem` - премия, списанная / зачисленная в Расчетную сессию. В Расчетную сессию рассчитано обязательство / требование по премии, которая начислена в предыдущую Клиринговую сессию. Значение совпадает с числом в поле `mon.prem_mtm` в отчете `mon` за предыдущую Клиринговую сессию.
- `fut_sbor_mtm`, `opt_sbor_mtm`, `sbor_ex_mtm`, `sbor_cc_mtm` (поля о начисленных комиссиях) – комиссии, начисленные в Клиринговую сессию. Значение совпадает с суммой комиссий по сделкам в отчетах `f04`, `o04` по 7КК за сессию, за которую проведен клиринг.
- `fut_sbor`, `opt_sbor`, `sbor_ex`, `sbor_cc` (поля о комиссиях, по которым проведен расчет) – комиссии, списанные в Расчетную сессию. Значения совпадают с аналогичными полями о начисленных комиссиях (`fut_sbor_mtm`, `opt_sbor_mtm`, `sbor_ex_mtm`, `sbor_cc_mtm`) в отчете `mon` за предыдущую Клиринговую сессию.
- `mtm` – итоговая сумма нетто обязательства / требования. Такого поля не существует в отчетах, однако, этот термин используется при обсуждении расчетов в ETC. Термин `mtm` приведен для информации.
 - $mtm = var_marg_mtm + prem_mtm + charges_mtm$
- В отчете `mon` для RUR $mon.amount_end = amount_beg + var_marg + prem + in_out_netto + charges$, где
 - `amount_beg` - Сумма денежных средств в рублях РФ на начало торгового дня (в рублях РФ)
 - `var_marg` - Вариационная маржа (руб.)
 - `prem` - Опционная премия (руб.)
 - `in_out_netto` – Сумма вводов – выводов в течение торгового дня (в рублях РФ)
 - `charges` - Фактическое исполнение обязательства по уплате комиссий, штрафов и обязательства по выплате / получению единовременного платежа по выходу из вечного фьючерса (руб.)
 - `amount_end` - Сумма денежных средств в рублях РФ и на конец торгового дня (в рублях РФ)
- `amount_end_mtm` - Плановая, рассчитанная с учетом начисленных `mtm` значений, сумма денежных средств в рублях РФ

- $\text{mon.amount_end_mtm} = \text{mon.amount_end} + \text{mtm} = \text{mon.amount_end} + \text{var_marg_mtm} + \text{prem_mtm} + \text{charges_mtm}$

3.4.3 В ЕТС Плановые обязательства по итогам Клиринга:

- Плановые нетто обязательства/требования рассчитываются в Клиринговую сессию. Плановое обязательство требование включает расчеты по вармарже, премии, комиссиям по сделкам, ежемесячным / ежеквартальным и иным начислениям, см. тарифы, платеж за выход из вечного фьючерса и иные обязательства / требования с расчетами в T+1.
- Итоговые значения плановых обязательств/требований по 7кк, БФ, РК содержатся в полях в отчете mon: $\text{mon.charges_mtm} + \text{mon.var_marg_mtm} + \text{mon.prem_mtm}$
 - mon.charges_mtm включает все начисления, сделанные в Клиринговую сессию, кроме вармаржи и премии. Значение mon.charges_mtm расшифровывается отчетом `chargesXXYY.csv/chargesclXXYYZZZ.csv`.
 - mon.var_marg_mtm - вариационная маржа, начисленная в Клиринговую сессию. Значение совпадает с суммой вармаржи по сделкам в отчетах f04, o04 по 7КК за сессию, за которую проведен клиринг.
 - mon.prem_mtm - премия, начисленная в Клиринговую сессию. Значение совпадает с суммой премий по сделкам в отчете o04 по 7КК за сессию, за которую проведен клиринг.
- Отчет `charges` «Отчет о начисленных комиссиях, штрафах и иных обязательствах по РФ/БФ».
 - Отчет содержит список операций, на основании которых получено значение mon.charges_mtm .
 - Отчет формируется после 00:30.
- Формат отчета совпадает с отчетом `rau`.
- Список видов операций в отчете `charges` совпадает со списком видов операций, которые использовался до ЕТС в отчете `rau`. Логика работы со справочником видов операций не меняется.
- Отчет `chargesXXYY.csv/chargesclXXYYZZZ.csv` содержит список комиссий, с детализаций по 7КК, включая
 - комиссии за безадресные сделки. Так как операции `charges` в день T станут операциями `rau` в день T+1, то мы сравниваем логику формирования отчета `charges` в ЕТС с логикой формирования отчета `rau` сейчас и **обращаем внимание, что по сравнению с текущей логикой формирования отчета `rau` (не ЕТС), `charges` будет включать комиссию за безадресные сделки.**
 - комиссии за адресные сделки
 - комиссию исполнения
 - комиссия за ошибочные транзакции
 - штрафы
 - ежемесячная комиссия за формирование отчетов
 - ежеквартальная плата за абонентское обслуживание
 - единовременный платеж за выход из Вечного Фьючерса

- перенос mtm-обязательства при портабилити
 - корректировки/ списание комиссии с датой расчетов T+1 за разовые операции, например, за предоставление отчетов в бумажном виде.
- Операции, которые указаны в отчете chargesXXYY.csv/chargesclXXYYZZ.csv после Клиринговой сессии в дату T, будут рассчитаны в Расчетную сессию в дату T+1 и отражены в отчете payXXYY.csv/payclXXYYZZ.csv после Клиринговой сессии в T+1.

3.4.4 В ЕТС движение обеспечения за сессию:

- Движение обеспечения за сессию включает:
 - Операции ввода/вывода RUR
 - Расчеты по начисленным нетто обязательствам / требованиям в Расчетную сессию в RUR (var_marg_mtm, prem_mtm и charges_mtm за предыдущую Клиринговую сессию)
 - Ручные корректировки вармаржи, комиссии с расчетами в день T
 - Операции ввода / вывода обеспечения
- Сумма операций ввода / вывода указана в поле mon.in_out_netto в отчете mon.
- Итоговые значения рассчитанных обязательств/требований по 7кк, БФ, РК содержатся в отчете mon в полях: mon.charges + mon.var_marg + mon.prem
 - mon.var_marg - вариационная маржа, списанная / зачисленная в Расчетную сессию. Значение совпадает с mon.var_marg_mtm в отчете mon за предыдущую Клиринговую сессию.
 - mon.prem - премия, списанная / зачисленная в Расчетную сессию. Значение совпадает с mon.prem_mtm в отчете mon за предыдущую Клиринговую сессию.
 - Сумма mon.charges складывается из
 - расчетов по начисленным в Клиринговую сессию обязательствам / требованиям. Значение совпадает с mon. charges_mtm в отчете mon за предыдущую Клиринговую сессию.
 - комиссии и штрафы с расчетами в дату T, которые МБ и НКЦ списывают вручную, например, за формирование отчетов в бумажном виде
 - ручные корректировки вармаржи и комиссии, в случае ошибки в расчетах.
- Сумма mon.in_out_netto + mon.charges расшифрована в отчете pay.
- Отчет pay «Информация об операциях по разделам денежного регистра Участника клиринга, Брокерской фирмы»
 - Отчет pay формируется после 00:30, по итогам Клиринговой сессии, так как отчет включает перевод в/из РК ЕП. Для РК ЕП перевод профилей разрешен до 23:50.
 - Формат отчета pay изменился. Из отчета удалены поля payer, inn, bik.
 - Отчет pay включает:
 - Операции ввода/вывода. Сумма операций ввода вывода отображается в mon.in_out_netto

- Исполнение обязательств, начисленных в Клиринговую сессию обязательств / требований (отчет mon, поле charges_mtm за предыдущую Клиринговую сессию)
- Ручные операции списания комиссий, штрафов и корректировки комиссий. Сумма корректировки учтена в отчете mon в поле mon.charges. Разница между mon.charges и mon.charges_mtm за предыдущую сессию – это сумма ручных списаний комиссии за текущую сессию.
 - Логика работы со справочником видов операций не меняется.
- Операции ввода / вывода обеспечения
 - Логика формирования и формат отчета раусб «Информация об операциях с иностранной валютой, а также с Профилем актива, предоставленных в качестве Обеспечения по Участнику клиринга» не меняется.
 - Отчет формируется после 00:30.

3.4.5 В ETC monsettl - Отчет по деньгам БФ/РФ по итогам Расчетной сессии:

- Новый отчет о состоянии денежных средств БФ/РФ по итогам Расчетной сессии.
- Отчет формируется после 20:00 и отправляется в новом пакете отчетов SETTLEYYYYMMDD. Пакет SETTLEYYYYMMDD содержит только отчеты monsettl/monsettlcl
- Формат отчета совпадает с форматом отчета mon
- В Расчетную сессию выполнены обязательства/ требования, начисленные ранее, поэтому все *_mtm поля = 0
- В полях, для расчетов которых нужны зафиксированные позиции и цены, указан 0, так как во время проведения Расчетной сессии идут торги. Ноль указан в полях pov, go, free.
- Логика заполнения остальных полей совпадает с логикой заполнения отчета mon.
- Monsettl.date – дата проведения Расчетной сессии

3.5 В ETC контрольные суммы и проверки для некоторых полей некоторых отчетов:

N	Отчет	Поле	Правила проверки
1.	fpos	Var_marg_p	начисленная вармаржа по инструменту - Сумма f04.var_marg_b / f04.var_marg_s Для полей fpos.комиссии аналогичное правило
2.	opos	Var_marg_p	начисленная вармаржа по инструменту - Сумма o04.var_marg_b / o04.var_marg_s Для полей opos.комиссии аналогичное правило
3.	opos	prem	начисленная премия по инструменту - Сумма o04.prem_buy / o04.prem_sell

N	Отчет	Поле	Правила проверки
4.	Mon	var_marg_mtm	начисленная вармаржа по 7КК/БФ/РК • Или сумма $f04.var_marg_b / f04.var_marg_s + o04.var_marg_b / f04.var_marg_s$ • Или сумма $fpos.var_marg_p + opos.var_marg_p$
5.	Mon	var_marg	расчеты по вармарже в Расчетную сессию Mon.var_marg_mtm в отчете mon за предыдущую Клиринговую сессию
6.	Mon	prem_mtm	начисленная премия по 7КК/БФ/РК • Или сумма $o04.prem_buy / f04.prem_sell$ • Или сумма $opos.prem$
7.	Mon	prem	расчеты по премии в Расчетную сессию Mon.prem_mtm в отчете mon за предыдущую Клиринговую сессию
8.	Mon	Charges_mtm	• Значение расшифровано в новом отчете charges • Сумма всех комиссий по сделкам; ежемесячных/ежеквартальных комиссий; обязательных платежей; ручных списаний и корректировок с датой расчетов T+1
9.	Mon	Charges + in_out_netto	• Значение расшифровано в отчете ray. Отчет ray в ЕТС включает платежи за безадресные сделки. До ЕТС была другая логика проверки и платежей за безадресные сделки не было в отчете ray
10.	Mon	Charges	Mon.charges_mtm в отчете mon за предыдущую Клиринговую сессию + ручные корректировки с датой расчетов T, включая корректировки вармаржи

3.6 Маржинальные требования:

- Маржинальные требования будут выставляться в 10:00, так же как на Фондовом и Валютном Рынках
- Размер маржинального требования рассчитывается исходя из состояния обеспечения на РК на 10:00.
- В дни ДСВД выставление маржинальных требований не производится.
- Отчет о маржинальных требованиях рассылается Участникам, которым выставлен маржин – колл в 10:00 утра. Формат отчета, см описание ниже.

4 Список изменений в отчетах СР в рамках проекта Единая Торговая сессия

Наименование пакета	Наименование отчета	Описание изменений
FOYYYYMMDD_1.zip ПК - отчеты по итогам пром.клиринга (1.zip)		В ЕТС пакет перестанет формироваться
	dayf07.csv/Дневной отчет о торгах фьючерсными контрактами	
	daymonXXYY.csv/Отчет DAYMON	
	dayo07.csv/Дневной отчет о торгах опционными контрактами	
	dayriskparamsXXYY.csv/Дневной отчет с коэффициентом prohibit_coeff по БФ	
SETTLEYYYYMMDD.zip - (новый пакет). Отчет по результатам Расчетной Сессии в 20:00		
	monsettl.csv/monsettlclXXYYZZZ.csv - Отчет по деньгам БФ/РФ/клиента по итогам Расчетной Сессии	Новый отчет monsettl* (см. Приложение 1)
FOYYYYMMDD_2.zip ВК - отчеты по итогам клиринга (2.zip) - Отчеты по итогам Клиринговой сессии в 00:30		
	monXXYY.csv/monclXXYYZZZ.csv - Отчет по деньгам БФ/РФ/клиента	Новая версия отчета mon* (см. Приложение 1) Удаляются поля: pay gowide freewide margincall

Наименование пакета	Наименование отчета	Описание изменений
		vat_ex vat_cc ext_rez
	persinvestXXYY.csv - Отчет об инвестиционных счетах	не меняется
	toeqXXYY.csv - Информация о привязке счетов на срочном и фондовом рынках	не меняется
	multileg_deal.csv - Отчет о связанных сделках	не меняется
	multileg_dict.csv - Отчет о связанных инструментах	не меняется
	multilegf04_XXYY.csv/multilegf04clXXYYZZZ.csv - Отчет о связанных сделках по РФ/БФ/клиента	Удаляются поля vat_ex_b vat_cc_b vat_ex_s vat_cc_s price_rur2 Добавляется поле: settle_date – Дата Расчетной сессии
	f04_XXYY.csv/f04clXXYYZZZ.csv - Отчет о торгах фьючерсными контрактами по РФ/БФ/клиенту	Удаляются поля profit_usd vat_ex_b vat_cc_b vat_ex_s

Наименование пакета	Наименование отчета	Описание изменений
		vat_cc_s Добавляется поле: settle_date – Дата Расчетной сессии
	o04_XXYY.csv/o04clXXYYZZZ.csv - Отчет о торгах опционными контрактами по РФ/БФ/клиенту	Удаляются поля profit_usd vat_ex_b vat_cc_b vat_ex_s vat_cc_s Добавляется поле: settle_date – Дата Расчетной сессии
	f07.csv - Отчет о торгах фьючерсами	Удаляются поля: limit pr_settl - Расчетная цена в дневном клиринге (пункты) pr_settl_r - Расчетная цена в дневном клиринге в руб. spot- Признак инструментов «спот» - не используется base- Базовый контракт для инструментов «спот» - не используется
	o07.csv/Отчет о торгах опционными контрактами	Удаляются поля pr_volat - Волатильность в дневном клиринге

Наименование пакета	Наименование отчета	Описание изменений
		pr_theorpr - Теоретическая цена в дневном клиринга (пункты)
	fposXXYY.csv/fposclXXYYZZZ.csv - информация о позиционном состоянии Участника клиринга/ Брокерской фирмы и их клиентов по фьючерсным контрактам/ коллатеральным инструментам	Полное описание - см. Приложение 2. Удаляются поля go_netto accum_go fee_trans vat_ex vat_cc pos_failed var_marg_prom Добавляется поле: settle_date – Дата Расчетной сессии
	onlineregXXYY.csv/Отчет по клиентам, зарегистрированным онлайн	не меняется
	oposXXYY.csv/oposclXXYYZZZ.csv - Отчет по опционным позициям РФ/БФ/клиента	Удаляются поля: vat_ex vat_cc var_marg_prom prem_prom

Наименование пакета	Наименование отчета	Описание изменений
		<pre>prem_prom_currency</pre> Добавляется поле: <pre>settle_date – Дата Расчетной сессии</pre>
	payXXYY.csv/ payclXXYYZZ.csv Отчет по платежам РФ/клиентским платежам	Полное описание - см. Приложение 3 Удаляются поля: <pre>payer inn bik</pre>
	chargesXXYY.csv - отчет о начисленных комиссиях	Полное описание - см. Приложение 4
	paycbXXYY.csv/paycbXX00.csv - Информация об операциях с иностранной валютой, а также с Профилем актива, предоставленных в качестве Обеспечения по Участнику клиринг	не меняется
	riskparamsXXYY.csv/Отчет с коэффициентом prohibit_coeff по БФ	не меняется
	riskposXXYY.csv/Информация о позиционном состоянии по инструментам	Удаляются поля: <pre>free_risk</pre>
	toeqXXYY.csv/Информация о привязке счетов на срочном и фондовом рынках	не меняется
	clientsXX00.csv/clientsXXYY.csv – информация о разделах клиринговых регистров	Удаляются поля: <pre>isrepo account_forts</pre>
	volat.csv/Параметры кривой волатильности	не меняется

Наименование пакета	Наименование отчета	Описание изменений
	multilegordlog_XXYY.csv/Отчет по логу репо заявок РФ/БФ - фьючерсы	Удаляются поля: date_clr rate
	multilegorglog_trade_XXYY	Удаляются поля: date_clr rate
	moncbXXYY.csv - Движение денежных средств с учетом курса ЦБ	не меняется
	F14_XXYY.xls - Сводная финансовая ведомость	Полное описание - см. Приложение 5
		Добавляется: Плановый Оборот за следующий день дебет кредит Плановый Баланс конец на следующего дня дебет кредит
TR_UPDYYYYMMDD.zip - Отчеты по транзакциям - Отчеты после Клиринговой сессии в 00:30		
	tranerrXXYY.csv - Отчет по ошибочным транзакциям 3 РФ/БФ – отчет о количестве ошибочных транзакций по каждому логину	Не меняется
	tranerrfeeXXYY.csv - Отчет по ошибочным транзакциям 2 РФ/БФ – детализированный отчет о сборах за ошибочные транзакции по каждому логину	Не меняется

Наименование пакета	Наименование отчета	Описание изменений
	tranfeeXXYY.csv - информация о сборах за транзакции по Участнику клиринга/ Брокерской фирмы и их клиентов.	Удаляются поля:
		vat_sbortr futopt mm addtr4 fee
	usersXXYY.csv/ Отчет по ошибочным транзакциям РФ/БФ. информация об итоговом размере сбора	Не меняется
	tranfcfeeXXYY.csv - Отчет tranfcfee_csv по сбору за флуд	Не меняется
	usersfcXXYY.csv - Отчет users по сбору за флуд	Не меняется
EXCHANGEYYYYMMDD.zip - - Отчеты с биржевой информацией после Клиринговой сессии в 00:30		
	multilegordlog_XXYY.csv - Отчет по логу репо заявок РФ/БФ - фьючерсы	Удаляются поля:
		date_clr rate
	onlineregXXYY.csv - Отчет по клиентам зарегистрированным онлайн	не меняется
FUTOPTMM (отчеты для Маркет-мейкеров)		
	mmfutXXYY.csv/ Отчет о выполнении обязательств MM по фьючерсам	не меняется
	mmopt_strikesXXXX.csv/Отчет о выполнении обязательств MM по опционам	не меняется

Наименование пакета	Наименование отчета	Описание изменений
	mmopt_averageXXXX.csv/Отчет о выполнении обязательств ММ по опционам	не меняется
	mm_onesidespredXXYY.csv/Клиентский отчет о лимитах в нетто-обороте	не меняется
	mmLPXXYY.csv/ММ отчет mm_lp_csv	не меняется
	GROUPXX.xls/ Клиентский отчет по вознаграждениям маркетмейкеров по программе ранжирования	не меняется
	MM_PAYMENT_XX00.xls/MM_PAYMENT_XX00.xls	не меняется
RFSYYYYMMDD.zip - Отчет по сделкам RFS		
	ind04_XXYY.csv - Отчет по сделкам RFS	не меняется
	indlink04_XXYY.csv - Отчеты по соответствию Квазисделок фактически заключенным сделкам	не меняется
	requests_XXYY.csv - Отчет о запросах на ликвидность	не меняется
REBATE (Ежемесячно – отчеты по возвратной премии)		
	PREMIUM_XX.xls - Отчет об биржевой возвратной премии участникам маркетинговых программ	не меняется
	rebate_options_XXYY.csv - Отчет по маркетинговой программе по опционам	не меняется
	rebate_at_XXYY.csv - Отчет по маркетинговой программе автоследования	не меняется
FORDLOGYYYYMMDD.zip - БК - заявки по фьючерсам		
	fordlogXXYY.csv - Отчет по принятым заявкам по фьючерсным контрактам	не меняется

Наименование пакета	Наименование отчета	Описание изменений
OORDLOGYYYYYMMDD.zip - BK - заявки по опционам		
	oordlogXXYY.csv - Отчет по принятым заявкам по опционным контрактам	не меняется
ERRLOGYYYYYMMDD.zip - BK - непринятые заявки		
	errlogXXYY.csv - Отчет об отвергнутых заявках	не меняется
EXCHANGEHLDYYYYMMDD.zip	ДСВД - отчеты с биржевой информацией	
	f04_trade_XXYY.csv/f04cl_trade_XXYYZZZ.csv - Отчет о торгах фьючерсными контрактами по РФ/БФ/клиенту в ДСВД	Удаляются поля: profit_usd vat_ex_b vat_cc_b vat_ex_s vat_cc_s Добавляется поле: settle_date – Дата Расчетной сессии
	o04_trade_XXYY.csv/o04cl_trade_XXYYZZZ.csv - Отчет о торгах опционными контрактами по РФ/БФ/клиенту в ДСВД	Удаляются поля: profit_usd vat_ex_b vat_cc_b vat_ex_s

Наименование пакета	Наименование отчета	Описание изменений
		vat_cc_s Добавляется поле: settle_date – Дата Расчетной сессии
	multilegf04_trade_XXYX.csv/multilegf04cl_trade_XXYZZZ.csv - Отчет о связанных сделках по РФ/БФ/клиенту в ДСВД	Удаляются поля: vat_ex_b vat_cc_b vat_ex_s vat_cc_s Добавляется поле: settle_date – Дата Расчетной сессии
	fordlog_trade_XXYX.csv - Отчет по принятым заявкам по фьючерсным контрактам в ДСВД	не меняется
	oordlog_trade_XXYX.csv - Отчет по принятым заявкам по опционным контрактам в ДСВД	не меняется
	multilegordlog_trade_XXYX.csv - Отчет по логу репо заявок РФ/БФ - фьючерсы в ДСВД	Удаляются поля: date_clr rate
	MTYYYYMMDD.zip	Отчет о маржинальном требовании
	mtXX00.csv - отчет о маржинальных требованиях	Новый отчет

5 ПРИЛОЖЕНИЕ 1.

5.1 Отчет MONXXYY.csv/MONCLXXYYZZZ.csv (Клиринговая сессия), MONSETTLE/MONSETTLCLXXYYZZZ.csv (Расчетная Сессия). Структура полей одинаковая.

Название поля	Название полей отчета	Правило формирования сейчас	Правило формирования в ЕТС (КС)	Правило формирования в ЕТС (РС)
date	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)	дата проведения вечерней клиринговой сессии	дата проведения вечерней клиринговой сессии	дата проведения расчетной сессии
settle_date	Дата расчетов T+1, т.е. дата дня, когда будет Расчетная сессия	поле отсутствует сейчас	T+1 - дата следующего торгового дня с Клиринговой Сессией	Дата Расчетной сессии
kod	Код Брокерской фирмы / раздела денежного регистра / Расчетный код	код	код	код
account	Признак Обеспечения:	см. "название поля отчета"	логика не меняется	логика не меняется
	'BF' – суммарные средства, учитываемые на Брокерской фирме,			
	'CL' – средства, учитываемые на разделе денежного регистра,			
	'RK' – суммарные средства, учитываемые на Расчетном коде.			

Название поля	Название полей отчета	Правило формирования сейчас	Правило формирования в ЕТС (КС)	Правило формирования в ЕТС (РС)
	В файле monXX00.csv, формируемого для Участника клиринга, в случае если клиринговые услуги по ведению клиринговых регистров Клиринговый центр оказывает Участнику торгов, не совпадающего в одном лице с Участником клиринга, в поле account по признаку 'CL' не предоставляется информация по коду раздела денежного регистра, открытого в рамках Брокерской фирмы для Участника торгов.			
	Поля kod='Расчетный код' и account='RK' отражаются в отчете monXX00 уровня Участника клиринга.			

Название поля	Название полей отчета	Правило формирования сейчас	Правило формирования в ЕТС (КС)	Правило формирования в ЕТС (РС)
type	Тип Обеспечения:	см. "название поля отчета"	логика не меняется	логика не меняется
	‘MN’ – денежные средства в рублях РФ и/или в иностранной валюте/ в Профиле актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу,			
	‘PL’ – Не используется.			
amount_beg	Сумма денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на начало отчетного дня (в рублях РФ)		логика не меняется	Сумма денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на начало отчетного дня (в рублях РФ) на начало сессии (= на конец предыдущей сессии)

Название поля	Название полей отчета	Правило формирования сейчас	Правило формирования в ЕТС (КС)	Правило формирования в ЕТС (РС)
var_marg	Вариационная маржа (руб.) Поле var_marg должно содержать сумму вариационной маржи по фьючерсам и маржируемым опционам. Поле var_marg должно содержать сумму вариационной маржи по фьючерсам и маржируемым опционам за текущую сессию. Расчет будет выполнен в T+1 в Расчетную сессию		Вариационная маржа (руб.) - фактически зачисленная/списанная за текущий торговый день. Сумма равна var_marg_mtm отчета mon за предыдущую сессию. Совпадает с аналогичным полем в отчете monsettle за текущий торговый день.	Вариационная маржа (руб.) - фактически зачисленная/списанная в Расчетную сессию. Сумма равна var_marg_mtm отчета mon за предыдущую сессию.
var_marg_mtm	Вариационная маржа (руб.) - начисленная в Клиринговую сессию.	нет в текущей версии	Вариационная маржа (руб.) - начисленная в Клиринговую сессию. Сумма вариационной маржи по фьючерсам и маржируемым опционам за текущую сессию	0 - в расчетную сессию проведены расчеты. Обязательства / требования = 0

Название поля	Название полей отчета	Правило формирования сейчас	Правило формирования в ЕТС (КС)	Правило формирования в ЕТС (РС)
prem	Опционная премия (руб.) Поле prem должно содержать сумму премии по сделкам с немаржируемыми опционами.		Опционная премия (руб.) - фактически зачисленная/списанная за текущий торговый день . Сумма равна prem_mtm за предыдущую сессию. Совпадает с аналогичным полем в отчете monsettle за текущий торговый день.	Опционная премия (руб.) - фактически зачисленная/списанная в Расчетную сессию . Сумма равна prem_mtm за предыдущую сессию
prem_mtm	Опционная премия (руб.) - начисленная в Клиринговую сессию.	нет в текущей версии	Опционная премия (руб.) - начисленная в Клиринговую сессию. Сумма премии по сделкам за текущую сессию.	0 - в расчетную сессию проведены расчеты. Обязательства / требования = 0
pay	Изменение суммы денежных средств в рублях РФ и/ или оценочной стоимости иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу в течение дня (в рублях РФ) - в текущей версии	Сумма всех pay (из отчета pay) с одинаковыми значениями полей date, kod, account, type будет равна значению поля pay файла monXXYY с теми же значениями полей date, kod, account, type, что и в файле payXXYY	В ЕТС поле удалено. Вместо поля pay добавлены поля in_out_netto и charges	В ЕТС поле удалено

Название поля	Название полей отчета	Правило формирования сейчас	Правило формирования в ЕТС (КС)	Правило формирования в ЕТС (РС)
in_out_netto	Изменение суммы денежных средств в рублях РФ и/ или оценочной стоимости иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу в течение дня (в рублях РФ) по операциям ввода / вывода	нет в текущей версии	Операции ввода вывода или фактически выполненные корректировки средств обеспечения за текущий торговый день. Для in_out_netto нет in_out_netto_mtm Уточнение: Фактические расчеты по корректировке вармаржи и комиссий будут отображаться в (колонке) charges.	Операции ввода вывода или фактически выполненные корректировки средств обеспечения. Для in_out_netto нет in_out_netto_mtm Уточнение: Фактические расчеты по корректировке вармаржи и комиссий будут отображаться в (колонке) charges.
charges	Фактическое исполнение обязательства по уплате комиссий, штрафов, обязательств и требований, начисленных в Клиринговую сессию T-1 кроме ВК и премии	нет в текущей версии	Фактически зачисленная/списанная за текущий торговый день сумма обязательств, включая обязательный платеж по выходу из ВФ, комиссии (включая комиссии по сделкам, ежемесячные и ежеквартальные комиссии), штрафы и корректировки (если таковые были) вармаржи и комиссии с текущей датой расчетов. (Все платежи, кроме операций ввода-вывода, вармаржи и премии по сделкам).	Фактически зачисленная/списанная в Расчетную сессию сумма обязательств, включая обязательный платеж по выходу из ВФ), комиссии (включая комиссии по сделкам, ежемесячные и ежеквартальные комиссии), штрафы и корректирующие проводки (если таковые были) вармаржи и комиссий с текущей датой расчетов. Динамика движения с начала торгового дня до Расчетной Сессии. (Все платежи, кроме операций ввода-вывода, вармаржи и премии по сделкам)

Название поля	Название полей отчета	Правило формирования сейчас	Правило формирования в ЕТС (КС)	Правило формирования в ЕТС (РС)
			В большинстве случаев совпадает с аналогичным полем в отчете monsettle за текущий торговый день.	Сумма равна charges_mtm отчета mon за предыдущую сессию
charges_mtm	Плановые обязательства по уплате комиссий, штрафов, обязательств и требований, начисленных в Клиринговую сессию, кроме ВК и премии	нет в текущей версии	начисленная по итогам клиринговой сессии сумма обязательств (включая обязательный платеж по выходу из ВФ), комиссий (включая комиссии по сделкам, ежемесячные и ежеквартальные комиссии), штрафов и корректирующих проводок (включая корректировки вармаржи и комиссий с датой расчетов T+1). (Все платежи, кроме операций ввода-вывода, вармаржи и премии по сделкам)	0 - в расчетную сессию проведены расчеты. Обязательства / требования = 0

Название поля	Название полей отчета	Правило формирования сейчас	Правило формирования в ЕТС (КС)	Правило формирования в ЕТС (РС)
fut_sbor	Рассчитанная в Расчетную сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с фьючерсами (руб.)	сумма биржевого и клирингового сбора за заключение безадресных сделок с фьючерсами (руб.) за текущую сессию	Фактически списанная за текущий торговый день сумма биржевого и клирингового сбора за заключение безадресных сделок с фьючерсами (руб.) = сумма биржевого и клирингового сбора за заключение безадресных сделок с фьючерсами (руб.) за предыдущую сессию = fut_sbor_mtm отчета mon за предыдущую сессию. Совпадает с аналогичным полем в отчете monsettle за текущий торговый день.	Фактически списанная сумма в Расчетную сессию сумма биржевого и клирингового сбора за заключение безадресных сделок с фьючерсами . Сумма совпадает с значением fut_sbor_mtm отчета mon за предыдущую Клиринговую сессию
fut_sbor_mtm	Начисленная в Клиринговую Сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с фьючерсами (руб.)	нет в текущей версии	<u>Начисленная</u> в Клиринговую Сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с фьючерсами (руб.) за <u>текущую</u> сессию	0 - в расчетную сессию проведены расчеты. Обязательства / требования = 0

Название поля	Название полей отчета	Правило формирования сейчас	Правило формирования в ЕТС (КС)	Правило формирования в ЕТС (РС)
opt_sbor	Рассчитанная в Расчетную сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с опционами (руб.)	сумма биржевого и клирингового сбора за заключение безадресных сделок с опционами (руб.) за текущую сессию	сумма биржевого и клирингового сбора за заключение безадресных сделок с опционами (руб.)	Фактически зачисленная/списанная в Расчетную сессию сумма биржевого и клирингового сбора за заключение безадресных сделок с опционами . Сумма равна opt_sbor_mtm отчета топ за предыдущую сессию
opt_sbor_mtm	Начисленная в Клиринговую Сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с опционами (руб.)	нет в текущей версии	<u>Начисленная</u> в Клиринговую Сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с опционами (руб.) за <u>текущую</u> сессию	0 - в расчетную сессию проведены расчеты. Обязательства / требования = 0
nov	Оценочная стоимость объема позиций опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги, на конец отчетного дня (в рублях РФ)		Расчет не меняется	0 (значение рассчитывается по позиции по итогам торгового дня, а отчет monsettle формируется в течение торгового дня, поэтому указываем 0)

Название поля	Название полей отчета	Правило формирования сейчас	Правило формирования в ЕТС (КС)	Правило формирования в ЕТС (РС)
go	Сумма гарантийного обеспечения по всем инструментам по риск-параметрам	Сумма гарантийного обеспечения по всем инструментам по риск-параметрам на начало вечерней дополнительной торговой сессии следующего торгового дня (руб.)	Сумма гарантийного обеспечения по всем инструментам по риск-параметрам на начало следующего торгового дня (руб.)	0 (значение рассчитывается по позиции по итогам торгового дня, а отчет monsettle формируется в течение торгового дня, поэтому указываем 0)
amount_end	Сумма денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на конец отчетного дня (в рублях РФ)		amount_end = amount_begin + in_out_netto+ var_marg + prem+ charges	amount_end = amount_begin + in_out_netto+ var_marg + prem+ charges

Название поля	Название полей отчета	Правило формирования сейчас	Правило формирования в ЕТС (КС)	Правило формирования в ЕТС (РС)
amount_end_mtm	Плановая сумма денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на конец отчетного дня (в рублях РФ)	нет в текущей версии	$\text{amount_end_mtm} = \text{amount_end} + \text{var_marg_mtm} + \text{prem_mtm} + \text{charges_mtm}$	$\text{amount_end_mtm} = \text{amount_end}$ (потому что mtm-регистры равны 0)
free	Сумма свободных денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты / Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на конец отчетного дня (в рублях РФ).	Поле free вычисляется как $\text{amount_end} - \text{go} - \text{ext_rez} + \text{nov}$.	Поле free вычисляется как $\text{amount_end_mtm} - \text{go} + \text{nov}$.	0 (значение рассчитывается по позиции по итогам торгового дня, а отчет monsettle формируется в течение торгового дня, поэтому указываем 0)

Название поля	Название полей отчета	Правило формирования сейчас	Правило формирования в ЕТС (КС)	Правило формирования в ЕТС (РС)
du	Признак того, что раздел денежного регистра предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет:		не меняется	не меняется
	1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении,			
	0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении			
gowide	Суммарное ГО по всем инструментам, рассчитанное по широкому лимиту (руб.) - не используется	не используется	удалено	удалено

Название поля	Название полей отчета	Правило формирования сейчас	Правило формирования в ЕТС (КС)	Правило формирования в ЕТС (РС)
freewide	Свободно средств (руб.), с учетом ГО по широкому лимиту - не используется	не используется	удалено	удалено
margincall	Признак margin call. Может принимать одно из трех возможных значений: 'A', 'B', ''. Значение '' означает, что признак margin call не установлен. Не используется.	не используется	удалено	удалено
sbor_ex	Биржевой сбор за адресные и безадресные сделки (руб.)	Биржевой сбор за адресные и безадресные сделки (руб.) за текущую сессию	Сумма <u>биржевого</u> сбора за адресные и безадресные сделки, фактически зачисленная/списанная за текущий торговый день. Уточнение: Сумма начисленного биржевого сбора за адресные и безадресные сделки (руб.) за предыдущую клиринговую сессию, т.е сумма sbor_ex_mtm из отчета mop за предыдущую клиринговую сессию.	Сумма биржевого сбора за адресные и безадресные сделки, рассчитанная в Расчетную сессию. Сумма равна sbor_ex_mtm отчета mop за предыдущую сессию

Название поля	Название полей отчета	Правило формирования сейчас	Правило формирования в ЕТС (КС)	Правило формирования в ЕТС (РС)
sbor_ex_mtm	Обязательства по уплате биржевого сбора за адресные и безадресные сделки (руб.) в Расчетную сессию в T+1	нет в текущей версии	Начисленный биржевой сбор за адресные и безадресные сделки (руб.) за текущую клиринговую сессию	0 - в расчетную сессию проведены расчеты. Обязательства / требования = 0
vat_ex	Сумма НДС в составе биржевого сбора (руб.) – не используется	не используется	удалено	удалено
sbor_cc	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за адресные и безадресные сделки (руб.)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за адресные и безадресные сделки (руб.) за текущую сессию	Фактически зачисленная/списанная за текущий торговый день сумма <u>клирингового</u> сбора за адресные и безадресные сделки Совпадает с аналогичным полем в отчете monsettle за текущий торговый день.	Сумма начисленного клирингового сбора за адресные и безадресные сделки (руб.) рассчитанная в Расчетную сессию. Сумма совпадает со значением sbor_cc_mtm из отчета mon за предыдущую клиринговую сессию.
sbor_cc_mtm	Обязательства по уплате Комиссионного вознаграждения Клирингового центра за адресные и безадресные сделки (руб.) в Расчетную сессию в T+1	нет в текущей версии	Начисленное комиссионное вознаграждение Клирингового центра за адресные и безадресные сделки (руб.) за текущую клиринговую сессию	0 - в расчетную сессию проведены расчеты. Обязательства / требования = 0

Название поля	Название полей отчета	Правило формирования сейчас	Правило формирования в ЕТС (КС)	Правило формирования в ЕТС (РС)
vat_cc	Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра (руб.) – не используется	не используется	удалено	удалено
rub_beg	Сумма денежных средств в рублях РФ на начало торгового дня		не меняется	не меняется
rub_pay	Изменение суммы денежных средств в рублях РФ в течение торгового дня по операциям ввода/вывода	Изменение суммы денежных средств в рублях РФ в течение торгового дня	не меняется (rub_pay = rub_end - rub_beg). Поле показывает итоговое изменение по всем операциям за день	не меняется (rub_pay = rub_end - rub_beg). Поле показывает итоговое изменение по всем операциям за день
rub_end	Сумма денежных средств в рублях РФ на конец торгового дня		rub_end = rub_beg + in_out_netto+ var_marg + prem+ charges	rub_end = rub_beg + in_out_netto+ var_marg + prem+ charges
com_pl_beg	Оценочная стоимость иностранной валюты и/или Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на начало отчетного дня (в рублях РФ)		логика не меняется	логика не меняется

Название поля	Название полей отчета	Правило формирования сейчас	Правило формирования в ЕТС (КС)	Правило формирования в ЕТС (РС)
com_pl_pay	Изменение оценочной стоимости иностранной валюты и/или Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу в течение дня (в рублях РФ)		логика не меняется	логика не меняется
com_pl_prem	Изменение оценочной стоимости объёма позиций опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги, в течение дня (в рублях РФ)		логика не меняется	логика не меняется
com_pl_end	Оценочная стоимость иностранной валюты и/или Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на конец отчетного дня (в рублях РФ)		логика не меняется	логика не меняется

Название поля	Название полей отчета	Правило формирования сейчас	Правило формирования в ЕТС (КС)	Правило формирования в ЕТС (РС)
ext_rez	Сумма (руб.), блокируемая в вечерний клиринг у участников, имеющих позиции по контрактам на RUONIA. Резервируется под изменения ставки RUONIA (используется при расчете вариационной маржи по позициям), публикуемой ЦБ.	FOSQL-2533: оставляем rate_rez = 0 для совместимости с отчетами	удалено	удалено

6 ПРИЛОЖЕНИЕ 2.

6.1 Отчет CHARGESXXYY.csv/CHARGESCLXXYYZZZ.csv.

6.1.1 Описание логики построения отчета

См. п. «В ЕТС Плановые обязательства по итогам Клиринга» в данном документе

6.1.2 Формат отчета

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
DATE	Дата и время клиринговой сессии	
settle_date	Плановая дата и время расчетов по обязательствам	
kod	Код клиента/расчетный код	Код раздела денежного регистра В файле payXX00.csv, формируемого для Участника клиринга, в случае если клиринговые услуги по ведению клиринговых регистров Клиринговый центр оказывает Участнику торгов, не совпадающего в одном лице с Участником клиринга, в поле account по признаку 'CL' не предоставляется информация по коду раздела денежного регистра, открытого в рамках Брокерской фирмы для Участника торгов.
account	Признак обеспечения BF/CL/RK	Признак раздела: всегда 'CL'
id_pay	Идентификатор операции	

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
type_pay	Тип операции. Поле type_pay однозначно идентифицирует поле name. Смысл идентификатора основания платежа описывается полем name.	
amount_charges_mtm	Сумма комиссии или штрафа	
name	Наименование операции (платежа)	
comment		
du	Признак того, что раздел денежного регистра предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет	Признак того, что раздел денежного регистра предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении,

7 ПРИЛОЖЕНИЕ 3

7.1 PayXXYY.csv, PayclXXYYZZZ.csv

7.1.1 Описание логики работы отчета

Обратите внимание, в ЕТС в отчете **pay** будут добавлены платежи для расчетов по комиссии по безадресным сделкам.

7.1.2 Формат отчета

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
date	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)	не меняется
kod	Код раздела денежного регистра В файле payXX00.csv , формируемого для Участника клиринга, в случае если клиринговые услуги по ведению клиринговых регистров Клиринговый центр оказывает Участнику торгов, не совпадающего в одном лице с Участником клиринга, в поле account по признаку 'CL' не предоставляется информация по коду раздела денежного регистра, открытого в рамках Брокерской фирмы для Участника торгов.	не меняется
account	Признак раздела: всегда 'CL'	не меняется
type	Тип средств: 'MN' – денежные средства в рублях РФ и/или в иностранной валюте/ в Профиле актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу; 'PL' – Не используется	не меняется
id_pay	Идентификатор операции	не меняется
type_pay	Тип операции. Поле type_pay однозначно идентифицирует поле name . Смысл идентификатора основания платежа описывается полем name .	не меняется

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
pay	Сумма платежа (руб.) Поле pay может быть положительным и отрицательным. Если pay меньше нуля, то средства списываются, если больше нуля, то зачисляются.	не меняется
	Сумма всех pay с одинаковыми значениями полей date, kod, account, type будет равна значению поля pay файла monXXYY с теми же значениями полей date, kod, account, type, что и в файле payXXYY	
name	Наименование операции (платежа)	не меняется
comment	Номер платежного поручения в случае поступления/ списания средств	не меняется
du	Признак того, что раздел денежного регистра предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет:	не меняется
	1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении,	
	0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении	
payer	Не используется	Удалено
inn	Не используется	Удалено
bik	Не используется	Удалено
purpose	Назначение платежа	не меняется

8 ПРИЛОЖЕНИЕ 4

8.1 fposXXYY.csv, fposclXXYYZZZ.csv

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
date	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)	не меняется
kod	Код Брокерской фирмы / код раздела регистра учета позиций / Расчетный код	не меняется
account	Признак обязательств: 'BF' – суммарные обязательства, учитываемые на разделах регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы, указанный в поле «kod», 'CL' – обязательства, учитываемые на разделе регистра учета позиций, имеющем код, указанный в поле «kod», 'RK' – суммарные обязательства, учитываемые на Расчетном коде, указанный в поле «kod».	не меняется
isin	Уникальный код инструмента (фьючерсный контракт/ коллатеральный инструмент)	не меняется
pos_beg	Количество позиций на начало дня	не меняется
pos_end	Количество позиций на конец дня	не меняется

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
var_marg_p	Вариационная маржа по открытым позициям на начало дня (руб.)	Начисленная вариационная маржа по открытым позициям на начало дня (руб.)
var_marg_d	Вариационная маржа по сделкам (руб.)	Начисленная вариационная маржа по сделкам (руб.)
sbor	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за безадресные сделки (руб.)	Начисленная сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за безадресные сделки (руб.)
go_netto	Не используется	Удалено
go_brutto	Гарантийное обеспечение с учетом направления позиции, как по сделкам покупки, так и по сделкам продажи по риск-параметрам на начало вечерней дополнительной торговой сессии следующего торгового дня (руб.)	не меняется

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
pos_exec	Количество исполненных позиций (больше нуля – исполняется продажа; меньше нуля – покупка)	не меняется
du	Счет ДУ (1 – ДУ, 0 – не ДУ)	не меняется
sbor_exec	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за исполнение (руб.)	Начисленное комиссионное вознаграждение Клирингового центра за исполнение (руб.)
sbor_nosys	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за адресные сделки (руб.).	Сумма начисленного в Клиринговую сессию биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за адресные сделки (руб.).
fee_exec	Пени за просрочку исполнения по фьючерсным контрактам	Начисленные пени за просрочку исполнения по фьючерсным контрактам
fine_exec	Неустойка за неисполнение фьючерсных контрактов	Начисленная неустойка за неисполнение фьючерсных контрактов

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
accum_go	Величина накопленного гарантийного перевода по инструменту «спот» за время существования позиции – не используется	Удалено
fee_trans	Сумма пени за перенос позиции сделкой РЕПО или сделкой купли-продажи для разделов ДУ	Удалено
sbor_ex	Биржевой сбор за адресные и безадресные сделки (руб.)	Начисленный биржевой сбор за адресные и безадресные сделки (руб.)
vat_ex	Сумма НДС в составе биржевого сбора (руб.) – не используется	Удалено
sbor_cc	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за адресные и безадресные сделки (руб.)	Начисленное комиссионное вознаграждение Клирингового центра за адресные и безадресные сделки (руб.)
vat_cc	Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра (руб.) – не используется	Удалено

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
pos_failed	Количество позиций, по которым не исполнено обязательство в день исполнения – не используется в связи с прекращением торговли фьючерсного контракта на ОФЗ	Удалено
var_marg_prom	Вариационная маржа по Сделкам по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ). Для Инструментов с базовым активом на курсы иностранных валют значение является справочным	Удалено
var_marg_p_settl_price	Составляющая часть, связанная с изменением Расчетной цены по фьючерсному контракту, Вариационной маржи по Сделкам, обязательства по которым не прекращены на начало отчетного дня (в рублях РФ)	не меняется

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
var_marg_p_swap_rate	Составляющая часть, связанная со ставкой обеспечения при отклонении цены по однодневному фьючерсному контракту с автопролонгацией от цены базового актива больше заданного на уровне однодневного фьючерсного контракта с автопролонгацией, Вариационной маржи по Сделкам, обязательства по которым не прекращены на начало отчетного дня (в рублях РФ)	не меняется
var_marg_d_settl_price	Составляющая часть, связанная с изменением Расчетной цены по фьючерсному контракту, Вариационной маржи по Сделкам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)	не меняется

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
var_marg_d_swap_rate	Составляющая часть, связанная со ставкой обеспечения при отклонении цены по однодневному фьючерсному контракту с автопролонгацией от цены базового актива больше заданного на уровне однодневного фьючерсного контракта с автопролонгацией, Вариационной маржи по Сделкам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)	не меняется
var_marg_p_index_div	Составляющая часть Вариационной маржи с учетом дивидендных выплат по ценным бумагам, входящих в базу расчетов Индексов Московской Биржи, по Сделкам однодневными фьючерсными контрактами с автопролонгацией на Индексы Московской Биржи, обязательства по которым не прекращены на начало отчетного дня (в рублях РФ)	не меняется

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
var_marg_d_index_div	Составляющая часть Вариационной маржи с учетом дивидендных выплат по ценным бумагам, входящих в базу расчетов Индексов Московской Биржи, по Сделкам однодневными фьючерсными контрактами с автопролонгацией на Индексы Московской Биржи, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)	не меняется
pos_enforcement_exec	количество исполненных принудительно поз для выхода из ВФ	не меняется
pay_enforcement_exec	сумма платежа за принудительное исполнение (с учетом знака)	Начисленная сумма платежа за принудительное исполнение (с учетом знака)
settle_date	Поле отсутствует сейчас	Дата расчетов T+1, т.е. дата дня, когда будет Расчетная сессия

8.2 oposXXYY.csv, oposclXXYYZZZ.csv

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
date	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)	не меняется
kod	Код Брокерской фирмы / код раздела регистра учета позиций / Расчетный код	не меняется
account	Признак обязательств:	не меняется

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
	'BF' – суммарные обязательства, учитываемые на разделах регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы, указанный в поле «kod», 'CL' – обязательства, учитываемые на разделе регистра учета позиций, имеющем код, указанный в поле «kod», 'RK' – суммарные обязательства, учитываемые на Расчетном коде, указанный в поле «kod».	
isin	Опционный контракт	не меняется
pos_beg	Количество позиций на начало дня	не меняется
pos_end	Количество позиций на конец дня	не меняется
prem	Сумма Премий по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)	Начисленная в Клиринговую сессию сумма Премий по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
sbor	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за безадресные сделки (руб.)	Начисленная в Клиринговую сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за безадресные сделки (руб.)
go	Гарантийное обеспечение с учетом направления позиции, как по сделкам покупки, так и по сделкам продажи по риск-параметрам на начало вечерней дополнительной торговой сессии следующего торгового дня (руб.)	не меняется
pos_exec	Количество экспирированных позиций (больше нуля – экспирируются позиции в продажу; меньше нуля – в покупку)	не меняется
pos_endcir	Количество позиций, удаленных в результате истечения срока обращения опциона (больше нуля – истек срок обращения опциона в продажу; меньше нуля – в покупку)	не меняется
du	Счет ДУ (1 – ДУ, 0 – не ДУ)	не меняется

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
sbor_exec	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за исполнение (руб.).	Начисленное в Клиринговую сессию комиссионное вознаграждение Клирингового центра за исполнение (руб.).
sbor_nosys	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за адресные сделки (руб.).	Начисленная в Клиринговую сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за адресные сделки (руб.).
var_marg_p	Вариационная маржа по открытым позициям на начало дня (руб.)	Начисленная в Клиринговую сессию вариационная маржа по открытым позициям на начало дня (руб.)
var_marg_d	Вариационная маржа по сделкам (руб.)	Начисленная в Клиринговую сессию вариационная маржа по сделкам (руб.)
sbor_ex	Биржевой сбор за адресные и безадресные сделки (руб.)	Начисленная в Клиринговую сессию биржевой сбор за адресные и безадресные сделки (руб.)
vat_ex	Сумма НДС в составе Биржевого сбора (руб.) – не используется	Удалено

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
sbor_cc	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за адресные и безадресные сделки (руб.)	Начисленное в Клиринговую сессию комиссионное вознаграждение Клирингового центра за адресные и безадресные сделки (руб.)
vat_cc	Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра (руб.) – не используется	Удалено
var_marg_prom	Вариационная маржа по опционным контрактам по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ). Для опционных контрактов на Инструменты с базисным активом на курсы иностранных валют значение является справочным.	Удалено
prem_currency	Сумма Премий по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в валюте, в которой осуществляются денежные расчеты)	не меняется
prem_prom	Сумма Премий по опционным контрактам по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ)	Удалено

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
prem_prom_currency	Сумма Премий по опционным контрактам по итогам дневной клиринговой сессии (в валюте, в которой осуществляются денежные расчеты)	Удалено
nov	Оценочная стоимость объёма позиций опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги (в рублях РФ)	не меняется
settle_date	Поле отсутствует сейчас	Дата расчетов T+1, т.е. дата дня, когда будет Расчетная сессия

9 ПРИЛОЖЕНИЕ 5

9.1 Отчет F14.xlsx

Наименование регистра	Баланс на начало дня		Оборот за день		Баланс на конец дня		Плановый Оборот за следующий день		Плановый Баланс конец на следующего дня	
	Дебет	Кредит	Дебет	Кредит	Дебет	Кредит	Дебет	Кредит	Дебет	Кредит
ДЕНЕЖНЫЙ РЕГИСТР ОБЕСПЕЧЕНИЯ в российских рублях и в иностранной валюте										
Собственные разделы	Позиция в RUR на собственных РК СК									
Движение по разделам в российских рублях			если сумма в операции >0 попадает в дебет;	если сумма в операции <0 попадает в кредит			если сумма в операции >0 попадает в дебет;	если сумма в операции <0 попадает в кредит		
			сумма вводов в RUR на собственных РК СР + charges, кроме биржевой и клиринговой по собственным РК СР	сумма выводов в RUR на собственных РК СР + charges, кроме биржевой и клиринговой по собственным РК СР			начисленная в КС с расчетами завтра charges, кроме биржевой и клиринговой по собственным РК СР	начисленная в КС с расчетами завтра комиссии (charges), кроме биржевой и клиринговой по собственным РК СР		

Движение по разделам в иностранной валюте			оценочная стоимость иностранной валюты в RUR на собственных РК СР	оценочная стоимость иностранной валюты в RUR на собственных РК СР						
Вариационная маржа			если сумма в операции >0 попадает в дебет;	если сумма в операции <0 попадает в кредит			если сумма в операции >0 попадает в дебет;	если сумма в операции <0 попадает в кредит		
			сумма вармаржи и корректирующих проводок по вариационной марже по собственным РК СР с расчетами сегодня	сумма вармаржи и корректирующих проводок по вариационной марже по собственным РК СР с расчетами сегодня			сумма зачислений начисленной вармаржи с расчетами на следующий день по собственным РК СР и платежи - зачислений с датой расчетов = завтра и по вариационной марже	сумма списаний начисленной вармаржи с расчетами на следующий день по собственным РК СР и платежи - списания с датой расчетов = завтра и по вариационной марже		
Премия по опционам			если сумма в операции >0 попадает в дебет;	если сумма в операции <0 попадает в кредит			если сумма в операции >0 попадает в дебет;	если сумма в операции <0 попадает в кредит		
			сумма премии зачисленной в РС по собственным РК СР	сумма премии списанной в РС по собственным РК СР			сумма зачислений начисленной премии с расчетами завтра по собственным РК СР	сумма списаний начисленной премии с расчетами завтра по собственным РК СР		

Бирж. сбор				сумма биржевой комиссии по безадресным и адресным сделкам, списанная в РС по собственным РК СР				сумма начисленной биржевой комиссии по безадресным и адресным сделкам, с расчетами "завтра" по собственным РК СР		
в т.ч. НДС				0				0		
Комиссионное вознаграждение КЦ				сумма комиссии КЦ по безадресным и адресным сделкам, списанная в РС по собственным РК СР				сумма начисленной комиссии КЦ по безадресным и адресным сделкам, с расчетами "завтра" по собственным РК СР		
в т.ч. НДС				0				0		
Итого в российских рублях					Собственные разделы на начало дня + все операции в RUR по дебету - все операции по кредиту в RUR					+ Итого в российских рублях + плюс все плановые суммы по дебету - минус все плановые суммы по кредиту

Итого в иностранной валюте					так же как сейчас	так же как сейчас				
ИТОГО по собств. разделам					так же как сейчас	так же как сейчас				
Суммарно клиентские разделы	Позиция в RUR на клиентских Р К СК									
Движение по разделам в российских рублях			если сумма в операции >0 попадает в дебет;	если сумма в операции <0 попадает в кредит;			если сумма в операции >0 попадает в дебет;	если сумма в операции <0 попадает в кредит;		
			сумма вводов в RUR на клиентских Р К СР + charges, кроме биржевой и клиринговой по клиентским Р К СР	сумма выводов в RUR на клиентских Р К СР + charges, кроме биржевой и клиринговой по клиентским Р К СР			начисленная в КС с расчетами завтра charges, кроме биржевой и клиринговой по клиентским Р К СР	начисленная в КС с расчетами завтра charges, кроме биржевой и клиринговой по клиентским Р К СР		
Движение по разделам в иностранной валюте			оценочная стоимость иностранной валюты в RUR на клиентских Р К СР	оценочная стоимость иностранной валюты в RUR на клиентских Р К СР						

Вариационная маржа			если сумма в операции >0 попадает в дебет;	если сумма в операции <0 попадает в кредит;			если сумма в операции >0 попадает в дебет;	если сумма в операции <0 попадает в кредит;		
			сумма вармаржи, зачисленной в РС и сумма корректирующих проводок по вариационной марже по клиентским РК СР с расчетами сегодня	сумма вармаржи, списанной в РС по клиентским РК СР и сумма корректирующих проводок по вариационной марже по клиентским РК СР с расчетами сегодня			сумма зачислений начисленной вармаржи с расчетами на следующий день по клиентским РК СР и платежи - зачислений с датой расчетов = завтра и по вариационной марже	сумма списаний начисленной вармаржи с расчетами на следующий день по клиентским РК СР и платежи - списания с датой расчетов = завтра и по вариационной марже		
Премия по опционам			если сумма в операции >0 попадает в дебет;	если сумма в операции <0 попадает в кредит;			если сумма в операции >0 попадает в дебет;	если сумма в операции <0 попадает в кредит;		
			сумма премии зачисленной в РС по клиентским РК СР	сумма премии списанной в РС по клиентским РК СР			сумма зачислений начисленной премии с расчетами завтра по клиентским РК СР	сумма списаний начисленной премии с расчетами завтра по клиентским РК СР		

Бирж. сбор				сумма биржевой комиссии по безадресным и адресным сделкам, списанная в РС по клиентским РК СР				сумма начисленной биржевой комиссии по безадресным и адресным сделкам, с расчетами "завтра" по клиентским РК СР		
в т.ч. НДС				0				0		
Комиссионное вознаграждение КЦ				сумма комиссии КЦ по безадресным и адресным сделкам, списанная в РС по клиентским РК СР				сумма начисленной комиссии КЦ по безадресным и адресным сделкам, с расчетами "завтра" по клиентским РК СР		
в т.ч. НДС				0				0		
Итого в российских рублях					Клиентские разделы на начало дня + все операции в RUR по дебету - все операции по кредиту в RUR					+ Итого в российских рублях + плюс все плановые суммы по дебету - минус все плановые суммы по кредиту

Итого в иностранной валюте					так же как сейчас	так же как сейчас				
ИТОГО по клиентским разделам					так же как сейчас	так же как сейчас				
Суммарно разделы ДУ	Позиция в RUR на РК СК ДУ									
Движение по разделам в российских рублях			если сумма в операции >0 попадает в дебет;	если сумма в операции <0 попадает в кредит;			если сумма в операции >0 попадает в дебет;	если сумма в операции <0 попадает в кредит;		
			сумма вводов в RUR на РК СК ДУ + charges, кроме биржевой и клиринговой по РК СК ДУ	сумма выводов в RUR на РК СК ДУ + charges, кроме биржевой и клиринговой по РК СК ДУ			начисленная в КС с расчетами завтра комиссии (charges), кроме биржевой и клиринговой по РК СК ДУ	начисленная в КС с расчетами завтра комиссии (charges), кроме биржевой и клиринговой по РК СК ДУ		
Движение по разделам в иностранной валюте			оценочная стоимость иностранной валюты в RUR на РК СК ДУ	оценочная стоимость иностранной валюты в RUR на РК СК ДУ						
Вариационная маржа			если сумма в операции >0 попадает в дебет;	если сумма в операции <0 попадает в кредит;			если сумма в операции >0 попадает в дебет;	если сумма в операции <0 попадает в кредит;		

			сумма вармаржи, зачисленной в РС по РК СР ДУ и корректирующих проводок по вариационной марже по РК СР ДУ с расчетами сегодня	сумма вармаржи, списанной в РС по РК СР ДУ и корректирующих проводок по вариационной марже по РК СР ДУ с расчетами сегодня			сумма зачислений начисленной вармаржи с расчетами на следующий день по РК СР ДУ и платежи - зачислений с датой расчетов = завтра и по вариационной марже	сумма списаний начисленной вармаржи с расчетами на следующий день по РК СР ДУ и платежи - списания с датой расчетов = завтра и по вариационной марже		
Премия по опционам			если сумма в операции >0 попадает в дебет; сумма премии зачисленной в РС по РК СР ДУ	если сумма в операции <0 попадает в кредит; сумма премии списанной в РС по РК СР ДУ			если сумма в операции >0 попадает в дебет; сумма зачислений начисленной премии с расчетами завтра по РК СР ДУ	если сумма в операции <0 попадает в кредит; сумма списаний начисленной премии с расчетами завтра по РК СР ДУ		
Бирж. сбор				сумма биржевой комиссии по безадресным и адресным сделкам, списанная в РС по РК СР ДУ				сумма начисленной биржевой комиссии по безадресным и адресным сделкам, с расчетами "завтра" по РК СР ДУ		
в т.ч. НДС				0				0		

Комиссионное вознаграждение КЦ				сумма комиссии КЦ по безадресным и адресным сделкам, списанная в РС по РК СР ДУ				сумма начисленной комиссии КЦ по безадресным и адресным сделкам, с расчетами "завтра" по РК СР ДУ		
в т.ч. НДС				0				0		
Итого в российских рублях					Собственные разделы на начало дня + все операции в RUR по дебету - все операции по кредиту в RUR					+ Итого в российских рублях + плюс все плановые суммы по дебету - минус все плановые суммы по кредиту
Итого в иностранной валюте					так же как сейчас	так же как сейчас				
ИТОГО по разделам ДУ					так же как сейчас	так же как сейчас				
Биржевой сбор										

в т.ч. НДС									
Комиссионное вознаграждение КЦ									
в т.ч. НДС									

10 ПРИЛОЖЕНИЕ 6.

10.1 Отчет о маржинальных требованиях mtXX00.csv

mtXX00.csv - отчет о маржинальных требованиях.

- Отчет направляется только тем Участникам клиринга, у которых есть маржинальное требование хотя бы по одному Расчетному коду.

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
moment	Дата и время выставления Маржинальных требований (гггг-мм-дд чч:мм:сс)	Поток FORTS_POS_REPL - Информация о позициях, Таблица part_sa: Лимиты по Расчетному коду, поле part_sa.margin_call_moment
max_margin_date	Максимальное время исполнения Маржинального требования (гггг-мм-дд чч:мм:сс)	гггг-мм-дд чч – дата выставления Маржинального требования чч:мм:сс – 17:30:00
kod	Расчетный код	Поток FORTS_POS_REPL - Информация о позициях, Таблица part_sa: Лимиты по Расчетному коду, поле part_sa.settlement_account
margin_sum	Сумма Маржинального требования, руб.	Поток FORTS_POS_REPL - Информация о позициях, Таблица part_sa: Лимиты по Расчетному коду, поле part_sa.margin_call_fix