**Приложение № 5**

к Регламенту осуществления клиринговой деятельности на рынке ценных бумаг

Открытого акционерного общества "Клиринговый центр МФБ"

Формы клиринговых отчетов

## Оглавление

[Оглавление 81](#_Toc413925117)

[Перечень изменений 82](#_Toc413925118)

[Форматы XML документов 83](#_Toc413925119)

[Пролог XML документа 83](#_Toc413925120)

[Элементы XML документа 83](#_Toc413925121)

[Атрибуты элементов XML документа 83](#_Toc413925122)

[Условные обозначения 84](#_Toc413925123)

[Типы данных 84](#_Toc413925124)

[Документы ЭДО РТС в формате XML 84](#_Toc413925125)

[Спецификация форматов отчетов 85](#_Toc413925126)

[MFB06. Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг 85](#_Toc413925127)

[MFB06C. Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг (по договорам клиентов) 92](#_Toc413925128)

[MFB13. Отчет об итоговых нетто-обязательствах/нетто-требованиях 98](#_Toc413925129)

[MFB14. Отчет о Гарантийном обеспечении, Маржинальном требовании и Задолженности 101](#_Toc413925130)

[MFB15. Отчет по обязательствам Участника клиринга по комиссионному вознаграждению 103](#_Toc413925131)

[MFB20. Уведомление о торгово-клиринговых счетах Участника клиринга 105](#_Toc413925132)

[MFB21. Уведомление о счетах для вывода денежных средств Участника клиринга 107](#_Toc413925133)

[MFB22. Отчет «Требование о погашении задолженности по денежному регистру» 109](#_Toc413925134)

[MFB23. Отчет об обязательствах по Договорам 111](#_Toc413925135)

[MFB23C. Отчет об обязательствах по Договорам (по договорам клиентов) 114](#_Toc413925136)

[MFB76. Отчет о взносах в Гарантийный фонд участников 117](#_Toc413925137)

[MFB82. Отчет о клиентах Участника клиринга 120](#_Toc413925138)

[MFB98. Отчет об обязательствах/требованиях по передаче дохода 122](#_Toc413925139)

[MFB98A. Уведомление о размере обязательств/требований по передаче дохода 124](#_Toc413925140)

[MFB99. Отчет об обеспечении 126](#_Toc413925141)

## Перечень изменений

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Дата изменений** | **Версия формата** | **Описание изменений** |
| 21.07.2014 | 2 | * Изменен формат и набор возможных значений для атрибута BoardId элемента BOARD отчетов MFB06 и MFB06C * В отчете MFB23 обязательства по Аналитическому ТКС (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 | * Изменена структура отчета MFB23 в части отображения позиций по аналитическим ТКС * Добавлен тип обязательств FEE для отчетов MFB13, MFB23 и MFB23C * Добавлен тип комиссии 6 и признак Executed в отчет MFB15 |
| 19.08.2014 | 2 | * Добавлены примеры отчетов без данных |
| 12.09.2014 | 2 | * Добавлен элемент CURRENCY в отчет MFB15 |
| 17.09.2014 | 2 | * Изменен список типов инструментов для отчетов MFB06, MFB06C |
| 16.10.2014 | 2 | * 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 | * Отчет MFB20. Добавлен атрибут ExtraDefaultClient |
| 11.11.2014 | 2 | * Отчет MFB06 и MFB06C. Добавлены атрибуты RepoRate и PriceType |
| 18.11.2014 | 2 | * Отчеты MFB06, MFB06C. Добавлены атрибуты BalanceSecurityId, FaceValue, SecurityType, SecCurrencyId * Добавлен отчет-уведомление MFB98A |
| 09.03.2015 | 3 | * Отчеты MFB06, MFB06C, добавлен атрибут TradePeriod, добавлена формула расчета значения атрибута Price2 * Отчет MFB20, добавлен атрибут BrokerFeeAccount. * Отчет MFB82, добавлены атрибуты CheckCrossMarket, IndividualIvestmentAccount. * Отчет MFB99, добавлен атрибут Purpose |

## 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 тегами. 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 тегах и тегах 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 “&lt;”, “&gt;”, “&amp;”, “&apos;”, “&quot;” соответственно.

Пример пустого элемента с атрибутом:

<elem attr=”значение атрибута” />

### Условные обозначения

В таблицах, описывающих прикладные и служебные элементы, в колонке **M/O** символ **M** означает, что соответствующий атрибут или подэлемент является обязательным, а символ **O** – 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 ЭДО РТС в формате XML

Для сообщений системы электронного документооборота ЭДО РТС в формате XML корневой элемент имеет значение **RTS\_DOC**

Каждое сообщение ЭДО РТС (включая отчеты МФБ) имеет следующую структуру

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Название элемента** | **Название атрибута** | **Описание** | **M/O** | **Тип** |
| RTS\_DOC |  | Корневой элемент (root element) XML документа | М |  |
| DOC\_REQUISITES |  | Блок информации о документе | М |  |
|  | DOC\_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
|  | DOC\_TIME | Время формирования документа | M | Time |
|  | DOC\_NO | Уникальный учетный номер документа в системе ЭДО | M | String(0-20) |
|  | DOC\_TYPE\_ID | Идентификатор типа документа в системе ЭДО | M | String(0-20) |
|  | SENDER\_ID | Код ЭДО РТС отправителя | M | String(3-7) |
|  | SENDER\_NAME | Краткое наименование отправителя | О | WString(0-120) |
|  | RECEIVER\_ID | Код ЭДО РТС получателя | M | String(3-7) |
|  | REMARKS | Текст примечания к документу | О | WString(0-120) |
| /DOC\_REQUISITES |  |  | О |  |
| *<* Идентификатор типа документа в системе ЭДО*/>* |  | Дочерний элемент, содержащий бизнес-данные документа | M | Элемент |
| /RTS\_DOC |  | Корневой элемент | M |  |

## Спецификация форматов отчетов

### MFB06. Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг

Отчет по участнику клиринга

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Название элемента** | **Название атрибута** | **Описание** | **M/O** | **Rev** | **Тип** |
| RTS\_DOC |  | Корневой элемент (root element) XML документа | М | 1 |  |
| DOC\_REQUISITES |  | Блок информации о документе | М | 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 **MFB06** | M | 1 | String(0-20) |
|  | SENDER\_ID | Всегда **MFBIM** | M | 1 | String(3-7) |
|  | SENDER\_NAME | Краткое наименование отправителя | О | 1 | WString(0-120) |
|  | RECEIVER\_ID | Код ЭДО РТС получателя | M | 1 | String(3-7) |
|  | REMARKS | Текст примечания к документу | О | 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) |
| FIRM |  | Блок данных по участнику торгов | M | 1 |  |
|  | FirmID | Идентификатор участника торгов | O | 1 | String(0-16) |
| CURRENCY |  | Блок данных по валюте расчетов | M | 1 |  |
|  | CurrencyId | Идентификатор валюты расчётов | M | 1 | String(0-4) |
|  | CurrencyName | Наименование валюты расчётов | 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 |
| CLEARINGTYPE |  | Блок данных по типу клиринга | M | 1 |  |
|  | ClearingType | Тип клиринга  Возможное значение:  **С** – клиринг по договорам с частичным обеспечением | O | 1 | Char |
| SESSION |  | Блок данных по клиринговой сессии | M | 1 |  |
|  | Session | Номер клиринговой сессии:  **1** - для договоров с клирингом по итогам торгов и договоров с частичным обеспечением. | O | 1 | Integer |
| SETTLEDATE |  | Блок данных по дате расчётов | M | 1 |  |
|  | SettleDate | Фактическая дата расчётов | M | 1 | Date |
| BOARD |  | Блок данных по режиму торгов | M | 1 |  |
|  | BoardType | Режим торгов:  1 – Фондовая российская секция  2 – Фондовая зарубежная секция  3 - Товарная секция  4 – Валютная секция | M | 1 | Integer |
|  | BoardID | Режим торгов:  EQR – Российские ЦБ  EQF – Иностранные ЦБ  Commodity - Товарная секция  CRCY\_F– Валютная секция | O | 2 | String(0-16) |
|  | BoardName | Наименование режима торгов (из перечня выше) | 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) |
|  | BalanceSecurityId | Код балансового (клирингового) инструмента | M | 1 | String(0-32) |
|  | FaceValue | Номинал ЦБ | O | 2 | String(0-32) |
|  | SecCurrencyId | Валюта номинала ЦБ | O | 2 | 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 – Корзина Облигаций (ETF) | O | 2 | Integer |
|  | PriceType | Тип цены:  PERC - процент от номинала  CASH – в валюте расчетов) | M | 2 | String(0-4) |
| RECORDS |  | Блок данных по договору | M | 1 |  |
|  | RecNo | Номер по порядку | M | 1 | Integer |
|  | TradeNo | Номер договора в Системе торгов | M | 1 | Integer |
|  | TradeDate | Дата торгов | M | 1 | Date |
|  | TradeTime | Время регистрации договора в Системе торгов | M | 1 | Time |
|  | OrderID | Номер заявки | 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 (покупка (**B**) / продажа (**S**)) | M | 1 | Char |
|  | SettleCode | Код расчётов по договору | O | 1 | String(0-12) |
|  | TradePeriod | Торговый период  1 – Основная торговая сессия  2 – Дополнительная торговая сессия  3 – Аукцион закрытия | M | 3 | Integer |
|  | TradeType | Тип договора:  **T** – заключен на основании безадресной заявки;  **N** – заключен на основании адресной заявки;  **D** – заключен без подачи заявки;  **O** – внебиржевой договор | O | 1 | Char |
|  | TradeInstrumentType | Тип торгового инструмента  1 – фьючерсные инструменты  2 – опционы  3 - инструменты с частичным обеспечением  4 – репо  5 – связанные сделки купли-продажи валюты  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 лотах/инструментах | M | 1 | Numeric(20,0) |
|  | Value | Объём договора, в валюте расчётов | M | 1 | Numeric(20,2) |
|  | Amount | Обязательство по денежным средствам, в валюте расчетов | M | 1 | Numeric(20,2) |
|  | Balance | Обязательство по ценным бумагам | M | 1 | Numeric(20,0) |
|  | 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) |
|  | ClientDetails | ИНН или № паспорта клиента или иной код | O | 1 | WString(0-41) |
|  | CPFirmId | Идентификатор контрагента | O | 1 | String(0-16) |
|  | CPFirmShortName | Краткое наименование контрагента | O | 1 | WString(0-32) |
|  | 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 данной 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) |
|  | TradeLegNo | Номер договора в торговом инструменте с одновременным заключением нескольких связанных договоров (ноги составного инструмента) | O | 1 | Integer |
|  | TradePart | Количество договоров в торговом инструменте с одновременным заключением нескольких связанных договоров | O | 1 | Integer |
|  | 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 Клиринговым центром; **4** – договор купли-продажи в случае неисполнения обязательств Клиринговым центром;  5 – договор репо, заключенный Клиринговым центром с целью привлечения активов для урегулирования неисполнения обязательств; **6** – договор купли-продажи, заключенный Клиринговым центром 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) |
| /RECORDS |  |  | M | 1 |  |
| /SECURITY |  |  | M | 1 |  |
| /BOARD |  |  | M | 1 |  |
| /SETTLEDATE |  |  | M | 1 |  |
| /SESSION |  |  | M | 1 |  |
| /CLEARINGTYPE |  |  | M | 1 |  |
| /INFTYPE |  |  | M | 1 |  |
| /CURRENCY |  |  | M | 1 |  |
| /FIRM |  |  | M | 1 |  |
| /MFB06 |  |  | M | 1 |  |
| /RTS\_DOC |  |  | M | 1 |  |

\*Цена второй части РЕПО рассчитывается по следующей формуле:

Price2=Округл (Округл (Price \* Quantity \* Lot \* (1+ RepoRate \* / 100); 2) / Quantity; Decimals), где

Price – цена первой части РЕПО;

Quantity - объём договора, в лотах;

Lot – размер лота;

RepoRate – ставка РЕПО в %;

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

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

Decimals - число значимых знаков после запятой в ценах.

Пример отчета

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?><?xml-stylesheet type="text/xsl" href="ftp://ftp.nprts.ru/mse/schema/MFB06.xslt"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2014-06-11" DOC\_TIME="18:43:21" DOC\_NO="RPT000000000329" DOC\_TYPE\_ID="MFB06" SENDER\_ID="MFBIM" SENDER\_NAME="ОАО &quot;КЦ МФБ&quot;" RECEIVER\_ID="FIRM" REMARKS=""></DOC\_REQUISITES>

<MFB06 ReportDate="2014-06-11" ReportDesc="Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг(отчет по участнику клиринга)" Weekday="Среда" MainFirmId="FIRM" FirmName="ООО &quot;FIRM&quot;">

<FIRM FirmID="FIRM">

<CURRENCY CurrencyId="RUB" CurrencyName="Russian Ruble">

<INFTYPE>

<CLEARINGTYPE ClearingType="C">

<SESSION Session="1">

<SETTLEDATE SettleDate="2014-06-17">

<BOARD BoardType="1" BoardId="EQR" BoardName="Российские ЦБ">

<SECURITY SecurityId="SNGS" BalanceSecurityId="SNGS-17.06.14" SecShortName="СургутНефтеГаз, ао" PriceType="CASH" >

<RECORDS RecNo="1" TradeNo="5" TradeDate="2014-06-10" TradeTime="18:40:36" TradePlace="1000" TradePlaceName="SPBXM" OrderID="29964" Comment="" BuySell="S" TradePeriod="1" TradeType="N" TradeInstrumentType="3" Decimals="6" Price="27.165000" Quantity="1" Value="2716.50" Amount="2716.50" Balance="100" ExchComm="0.00" ClrComm="0" LicComm="0" ClrAccCode="Z01+00000Z00" ClientDetails="7700000001" CPFirmId="MFBIM" CPFirmShortName="ОАО &quot;Клиринговый центр МФБ&quot;" ClientCode="CL0002" DueDate="2014-06-17" Type="0"></RECORDS>

</SECURITY>

</BOARD>

</SETTLEDATE>

<SETTLEDATE SettleDate="2014-06-16">

<BOARD BoardType="1" BoardId="EQR" BoardName="Российские ЦБ">

<SECURITY SecurityId="SNGS" BalanceSecurityId="SNGS-16.06.14" SecShortName="СургутНефтеГаз, ао" PriceType="CASH">

<RECORDS RecNo="2" TradeNo="7" TradeDate="2014-06-10" TradeTime="16:03:05" TradePlace="1000" TradePlaceName="SPBXM" OrderID="20634" Comment="" BuySell="S" TradePeriod="1" TradeType="T" TradeInstrumentType="3" Decimals="6" Price="27.165000" Quantity="1" Value="2716.50" Amount="2716.50" Balance="100" ExchComm="0.00" ClrComm="0" LicComm="0" ClrAccCode="Z01+00000Z00" ClientDetails="7700000001" CPFirmId="MFBIM" CPFirmShortName="ОАО &quot;Клиринговый центр МФБ&quot;" ClientCode="CL0002" DueDate="2014-06-16" Type="0"></RECORDS>

<RECORDS RecNo="3" TradeNo="9" TradeDate="2014-06-10" TradeTime="18:40:36" TradePlace="1000" TradePlaceName="SPBXM" OrderID="29963" Comment="" BuySell="B" TradePeriod="1" TradeType="N" TradeInstrumentType="3" Decimals="6" Price="27.165000" Quantity="1" Value="2716.50" Amount="2716.50" Balance="100" ExchComm="0.00" ClrComm="0" LicComm="0" ClrAccCode="L01+00000F00" ClientDetails="7700000001" CPFirmId="MFBIM" CPFirmShortName="ОАО &quot;Клиринговый центр МФБ&quot;" ClientCode="CL0002" DueDate="2014-06-16" Type="0"></RECORDS>

</SECURITY>

<SECURITY SecurityId="SBER" BalanceSecurityId="SBER-16.06.14" SecShortName="СБЕРБАНК, ао" PriceType="CASH">

<RECORDS RecNo="4" TradeNo="20" TradeDate="2014-06-10" TradeTime="17:44:46" TradePlace="1000" TradePlaceName="SPBXM" OrderID="24479" Comment="" BuySell="S" TradePeriod="1" TradeType="T" TradeInstrumentType="3" Decimals="6" Price="88.470000" Quantity="1" Value="884.70" Amount="884.70" Balance="10" ExchComm="0.00" ClrComm="0" LicComm="0" ClrAccCode="L01+00000F00" ClientDetails="7700000001" CPFirmId="MFBIM" CPFirmShortName="ОАО &quot;Клиринговый центр МФБ&quot;" ClientCode="CL0002" DueDate="2014-06-16" Type="0"></RECORDS>

</SECURITY>

</BOARD>

</SETTLEDATE>

</SESSION>

</CLEARINGTYPE>

</INFTYPE>

<INFTYPE InfType="1">

<CLEARINGTYPE ClearingType="C">

<SESSION Session="1">

<SETTLEDATE SettleDate="2014-06-11">

<BOARD BoardType="1" BoardId="EQR" BoardName="Российские ЦБ">

<SECURITY SecurityId="SBER" BalanceSecurityId="SBER-11.06.14" SecShortName="СБЕРБАНК, ао" PriceType="CASH">

<RECORDS RecNo="5" TradeNo="19" TradeDate="2014-06-09" TradeTime="10:42:58" TradePlace="1000" TradePlaceName="SPBXM" OrderID="12" Comment="/" BuySell="S" TradePeriod="1" TradeType="T" TradeInstrumentType="3" Decimals="6" Price="89.000000" Quantity="1" Value="890.00" Amount="890.00" Balance="10" ExchComm="0.00" ClrComm="0" LicComm="0" ClrAccCode="L01+00000F00" ClientDetails="7818056412" CPFirmId="MFBIM" CPFirmShortName="ОАО &quot;Клиринговый центр МФБ&quot;" ClientCode="L0002" DueDate="2014-06-11" Type="0"></RECORDS>

</SECURITY>

<SECURITY SecurityId="GAZP" BalanceSecurityId="GAZP-11.06.14" SecShortName="ГАЗПРОМ, ао" PriceType="CASH">

<RECORDS RecNo="6" TradeNo="3" TradeDate="2014-06-09" TradeTime="11:35:02" TradePlace="1000" TradePlaceName="SPBXM" OrderID="614" Comment="" BuySell="S" TradePeriod="1" TradeType="T" TradeInstrumentType="3" Decimals="6" Price="144.980000" Quantity="1" Value="1449.80" Amount="1449.80" Balance="10" ExchComm="0.00" ClrComm="0" LicComm="0" ClrAccCode="L01+00000F00" ClientDetails="7818056412" CPFirmId="MFBIM" CPFirmShortName="ОАО &quot;Клиринговый центр МФБ&quot;" ClientCode="L0002" DueDate="2014-06-11" Type="0"></RECORDS>

</SECURITY>

</BOARD>

</SETTLEDATE>

</SESSION>

</CLEARINGTYPE>

</INFTYPE>

</CURRENCY>

</FIRM>

</MFB06>

</RTS\_DOC>

Пример отчета без данных

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<?xml-stylesheet type="text/xsl" href="ftp://ftp.nprts.ru/mse/schema/MFB06C.xslt"?><?xml-stylesheet type="text/xsl" href="C:\RTS\MFB06C.xslt"?><RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2014-06-11" DOC\_TIME="18:43:21" DOC\_NO="RPT000000000329" DOC\_TYPE\_ID="MFB06" SENDER\_ID="MFBIM" SENDER\_NAME="ОАО &quot;КЦ МФБ&quot;" RECEIVER\_ID="FIRM" REMARKS="На отчетную дату данных нет"></DOC\_REQUISITES>

<MFB06 ReportDate="2014-06-11" ReportDesc="Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг(отчет по участнику клиринга)" Weekday="Среда" MainFirmId="FIRM" FirmName="ООО &quot;FIRM&quot;">

<FIRM>

<CLIENT>

<CURRENCY>

<INFTYPE>

<CLEARINGTYPE>

<SESSION>

<SETTLEDATE>

<BOARD>

<SECURITY>

<RECORDS/>

</SECURITY>

</BOARD>

</SETTLEDATE>

</SESSION>

</CLEARINGTYPE>

</INFTYPE>

</CURRENCY>

</CLIENT>

</FIRM>

</MFB06C>

</RTS\_DOC>

### MFB06C. Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг (по договорам клиентов)

Отчет в разрезе клиентов

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Название элемента** | **Название атрибута** | **Описание** | **M/O** | **Rev** | **Тип** |
| RTS\_DOC |  | Корневой элемент (root element) XML документа | М | 1 |  |
| DOC\_REQUISITES |  | Блок информации о документе | М | 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 **MFB06C** | M | 1 | String(0-20) |
|  | SENDER\_ID | Всегда **MFBIM** | M | 1 | String(3-7) |
|  | SENDER\_NAME | Краткое наименование отправителя | О | 1 | WString(0-120) |
|  | RECEIVER\_ID | Код ЭДО РТС получателя | M | 1 | String(3-7) |
|  | REMARKS | Текст примечания к документу | О | 1 | WString(0-120) |
| /DOC\_REQUISITES |  |  | M | 1 |  |
| MFB06C |  | 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) |
| 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 | M | 1 | String(0-4) |
|  | CurrencyName | Наименование валюты расчётов | 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 |
| CLEARINGTYPE |  | Блок данных по типу клиринга | M | 1 |  |
|  | ClearingType | Тип клиринга  Возможное значение:  **С** – клиринг по договорам с частичным обеспечением | O | 1 | Char |
| SESSION |  | Блок данных по клиринговой сессии | M | 1 |  |
|  | Session | Номер клиринговой сессии:  **1** - для договоров с клирингом по итогам торгов и договоров с частичным обеспечением. | O | 1 | Integer |
| SETTLEDATE |  | Блок данных по дате расчётов | M | 1 |  |
|  | SettleDate | Фактическая дата расчётов | M | 1 | Date |
| BOARD |  | Блок данных по режиму торгов | M | 1 |  |
|  | BoardType | Режим торгов:  1 – Российские ЦБ  2 – Иностранные ЦБ  3 - Товарная секция  4 – Валютная секция | M | 1 | Integer |
|  | BoardID | Режим торгов:  EQR – Российские ЦБ  EQF – Иностранные ЦБ  Commodity - Товарная секция  CRCY\_F – Валютная секция | M | 2 | String(0-16) |
|  | BoardName | Наименование режима торгов (из перечня выше) | M | 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) |
|  | BalanceSecurityId | Код балансового (клирингового) инструмента | M | 2 | String(0-32) |
|  | FaceValue | Номинал ЦБ | O | 2 | String(0-32) |
|  | SecCurrencyId | Валюта номинала ЦБ | O | 2 | 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 – Корзина Облигаций (ETF) | O | 2 | Integer |
|  | PriceType | Тип цены:  PERC - процент от номинала  CASH – в валюте расчетов | M | 2 | String(0-4) |
| RECORDS |  | Блок данных по договору | M | 1 |  |
|  | RecNo | Номер по порядку | M | 1 | Integer |
|  | TradeNo | Номер договора в Системе торгов | M | 1 | Integer |
|  | TradeDate | Дата торгов | M | 1 | Date |
|  | TradeTime | Время регистрации договора в Системе торгов | M | 1 | Time |
|  | TradePlace | Код организатора торгов, зарегистрировавшего договор | O | 1 | Integer |
|  | TradePlaceName | Наименование организатора торгов, зарегистрировавшего договор | O | 1 | WString(0-64) |
|  | BuySell | Направленность заявки (покупка (**B**) / продажа (**S**)) | M | 1 | Char |
|  | SettleCode | Код расчётов по договору | O | 1 | String(0-12) |
|  | TradePeriod | Торговый период  1 – Основная торговая сессия  2 – Дополнительная торговая сессия  3 – Аукцион закрытия | M | 3 | Integer |
|  | TradeType | Тип договора:  **T** – заключен на основании безадресной заявки;  **N** – заключен на основании адресной заявки;  **D** – заключен без подачи заявки;  **O** – внебиржевой договор | O | 1 | Char |
|  | TradeInstrumentType | Тип торгового инструмента  1 – фьючерсные инструменты  2 – опционы  3 - инструменты с частичным обеспечением  4 – репо  5 – связанные сделки купли-продажи валюты  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(20,0) |
|  | Value | Объём договора, в валюте расчётов | M | 1 | Numeric(20,2) |
|  | Amount | Обязательство по денежным средствам, в валюте расчетов | M | 1 | Numeric(20,2) |
|  | Balance | Обязательство по ценным бумагам | M | 1 | Numeric(20,0) |
|  | 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) |
|  | CPFirmId | Идентификатор контрагента | O | 1 | String(0-16) |
|  | CPFirmShortName | Краткое наименование контрагента | O | 1 | WString(0-32) |
|  | 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) |
|  | TradeLegNo | Номер договора в торговом инструменте с одновременным заключением нескольких связанных договоров (ноги составного инструмента) | O | 1 | Integer |
|  | TradePart | Количество договоров в торговом инструменте с одновременным заключением нескольких связанных договоров | O | 1 | Integer |
|  | 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 Клиринговым центром; **4** – договор купли-продажи в случае неисполнения обязательств Клиринговым центром;  5 – договор репо, заключенный Клиринговым центром с целью привлечения активов для урегулирования неисполнения обязательств; **6** – договор купли-продажи, заключенный Клиринговым центром 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) |
| /RECORDS |  |  | M | 1 |  |
| /SECURITY |  |  | M | 1 |  |
| /BOARD |  |  | M | 1 |  |
| /SETTLEDATE |  |  | M | 1 |  |
| /SESSION |  |  | M | 1 |  |
| /CLEARINGTYPE |  |  | M | 1 |  |
| /INFTYPE |  |  | M | 1 |  |
| /CURRENCY |  |  | M | 1 |  |
| /CLIENT |  |  | M | 1 |  |
| /FIRM |  |  | M | 1 |  |
| /MFB06C |  |  | M | 1 |  |
| /RTS\_DOC |  |  | M | 1 |  |

\*Цена второй части РЕПО рассчитывается по следующей формуле:

Price2=Округл (Округл (Price \* Quantity \* Lot \* (1+ RepoRate \* / 100); 2) / Quantity; Decimals), где

Price – цена первой части РЕПО;

Quantity - объём договора, в лотах;

Lot – размер лота;

RepoRate – ставка РЕПО в %;

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

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

Decimals - число значимых знаков после запятой в ценах.

Пример отчета

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?><?xml-stylesheet type="text/xsl" href="ftp://ftp.nprts.ru/mse/schema/MFB06C.xslt"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2014-06-10" DOC\_TIME="19:22:44" DOC\_NO="RPT000000000109" DOC\_TYPE\_ID="MFB06C" SENDER\_ID="MFBIM" SENDER\_NAME="ОАО &quot;КЦ МФБ&quot;" RECEIVER\_ID="FIRM" REMARKS=""></DOC\_REQUISITES>

<MFB06C ReportDate="2014-06-09" ReportDesc="Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (отчет по участнику клиринга с разбивкой по клиентам)" Weekday="Понедельник" MainFirmId="FIRM" FirmName="&quot;FIRM&quot; (ОАО)">

<FIRM FirmID="FIRM">

<CLIENT ClientCode="CL0002" ClientDetails="7700000001">

<CURRENCY CurrencyId="RUB" CurrencyName="Russian Ruble">

<INFTYPE InfType="3">

<CLEARINGTYPE ClearingType="C">

<SESSION Session="1">

<SETTLEDATE SettleDate="2014-06-11">

<BOARD BoardType="1" BoardName="Российские ЦБ">

<SECURITY SecurityId="VTBR" BalanceSecurityId="VTBR-11.06.14" SecShortName="ВТБ, ао" PriceType="CASH">

<RECORDS RecNo="5" TradeNo="4" TradeDate="2014-06-09" TradeTime="12:36:48" TradePlace="1000" TradePlaceName="SPBXM" OrderID="20115" Comment="" BuySell="B" TradePeriod="1"TradeType="T" TradeInstrumentType="3" Decimals="6" Price="0.047600" Quantity="1" Value="476.00" Amount="476.00" Balance="10000" ExchComm="0.00" ClrComm="0" LicComm="0" ClrAccCode="Z01+00000Z00" CPFirmId="MFBIM" CPFirmShortName="ОАО &quot;Клиринговый центр МФБ&quot;" DueDate="2014-06-11" Type="0"></RECORDS>

<RECORDS RecNo="6" TradeNo="11" TradeDate="2014-06-09" TradeTime="17:38:38" TradePlace="1000" TradePlaceName="SPBXM" OrderID="56980" Comment="" BuySell="S" TradePeriod="1"TradeType="T" TradeInstrumentType="3" Decimals="6" Price="0.047670" Quantity="1" Value="476.70" Amount="476.70" Balance="10000" ExchComm="0.00" ClrComm="0" LicComm="0" ClrAccCode="Z01+00000Z00" CPFirmId="MFBIM" CPFirmShortName="ОАО &quot;Клиринговый центр МФБ&quot;" DueDate="2014-06-11" Type="0"></RECORDS>

</SECURITY>

<SECURITY SecurityId="GAZP" BalanceSecurityId="GAZP-11.06.14" SecShortName="ГАЗПРОМ, ао" PriceType="CASH">

<RECORDS RecNo="1" TradeNo="3" TradeDate="2014-06-09" TradeTime="11:35:02" TradePlace="1000" TradePlaceName="SPBXM" OrderID="6176" Comment="" BuySell="B" TradePeriod="1"TradeType="T" TradeInstrumentType="3" Decimals="6" Price="144.980000" Quantity="1" Value="1449.80" Amount="1449.80" Balance="10" ExchComm="0.00" ClrComm="0" LicComm="0" ClrAccCode="Z01+00000Z00" CPFirmId="MFBIM" CPFirmShortName="ОАО &quot;Клиринговый центр МФБ&quot;" DueDate="2014-06-11" Type="0"></RECORDS>

<RECORDS RecNo="2" TradeNo="5" TradeDate="2014-06-09" TradeTime="12:46:54" TradePlace="1000" TradePlaceName="SPBXM" OrderID="21061" Comment="" BuySell="S" TradePeriod="1"TradeType="T" TradeInstrumentType="3" Decimals="6" Price="145.400000" Quantity="1" Value="1454.00" Amount="1454.00" Balance="10" ExchComm="0.00" ClrComm="0" LicComm="0" ClrAccCode="Z01+00000Z00" CPFirmId="MFBIM" CPFirmShortName="ОАО &quot;Клиринговый центр МФБ&quot;" DueDate="2014-06-11" Type="0"></RECORDS>

</SECURITY>

<SECURITY SecurityId="LKOH" BalanceSecurityId="LKOH-11.06.14" SecShortName="ЛУКОЙЛ, ао" PriceType="CASH">

<RECORDS RecNo="3" TradeNo="6" TradeDate="2014-06-09" TradeTime="12:54:04" TradePlace="1000" TradePlaceName="SPBXM" OrderID="22213" Comment="" BuySell="B" TradePeriod="1" TradeType="T" TradeInstrumentType="3" Decimals="6" Price="2030.900000" Quantity="1" Value="2030.90" Amount="2030.90" Balance="1" ExchComm="0.00" ClrComm="0" LicComm="0" ClrAccCode="Z01+00000Z00" CPFirmId="MFBIM" CPFirmShortName="ОАО &quot;Клиринговый центр МФБ&quot;" DueDate="2014-06-11" Type="0"></RECORDS>

<RECORDS RecNo="4" TradeNo="12" TradeDate="2014-06-09" TradeTime="17:43:58" TradePlace="1000" TradePlaceName="SPBXM" OrderID="57078" Comment="" BuySell="S" TradePeriod="1" TradeType="T" TradeInstrumentType="3" Decimals="6" Price="2038.700000" Quantity="1" Value="2038.70" Amount="2038.70" Balance="1" ExchComm="0.00" ClrComm="0" LicComm="0" ClrAccCode="Z01+00000Z00" CPFirmId="MFBIM" CPFirmShortName="ОАО &quot;Клиринговый центр МФБ&quot;" DueDate="2014-06-11" Type="0"></RECORDS>

</SECURITY>

</BOARD>

</SETTLEDATE>

</SESSION>

</CLEARINGTYPE>

</INFTYPE>

</CURRENCY>

</CLIENT>

</FIRM>

</MFB06C>

</RTS\_DOC>

Пример отчета без данных

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<?xml-stylesheet type="text/xsl" href="ftp://ftp.nprts.ru/mse/schema/MFB06C.xslt"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2014-06-11" DOC\_TIME="18:43:21" DOC\_NO="RPT000000000329" DOC\_TYPE\_ID="MFB06C" SENDER\_ID="MFBIM" SENDER\_NAME="ОАО &quot;КЦ МФБ&quot;" RECEIVER\_ID="FIRM" REMARKS="На отчетную дату данных нет"></DOC\_REQUISITES>

<MFB06C ReportDate="2014-06-11" ReportDesc="Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг(отчет по участнику клиринга)" Weekday="Среда" MainFirmId="FIRM" FirmName="ООО &quot;FIRM&quot;">

<FIRM>

<CURRENCY>

<INFTYPE>

<CLEARINGTYPE>

<SESSION>

<SETTLEDATE>

<BOARD>

<SECURITY>

<RECORDS/>

</SECURITY>

</BOARD>

</SETTLEDATE>

</SESSION>

</CLEARINGTYPE>

</INFTYPE>

</CURRENCY>

</FIRM>

</MFB06>

</RTS\_DOC>

### MFB13. Отчет об итоговых нетто-обязательствах/нетто-требованиях

Формируется по итогам определения итоговых нетто-обязательств/нетто-требований по Договорам c наступившей датой исполнения.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Название элемента** | **Название атрибута** | **Описание** | **M/O** | **Rev** | **Тип** |
| RTS\_DOC |  |  | М | 1 |  |
| DOC\_REQUISITES |  |  | М | 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 **MFB13** | M | 1 | String(0-20) |
|  | SENDER\_ID | Всегда **MFBIM** | M | 1 | String(3-7) |
|  | SENDER\_NAME | Краткое наименование отправителя | О | 1 | WString(0-120) |
|  | RECEIVER\_ID | Код ЭДО РТС получателя | M | 1 | String(3-7) |
|  | REMARKS | Текст примечания к документу | О | 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 | Integer |
| 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  **S -** информация о нетто обязательствах/требованиях по депозитарным разделам | M | 1 | Char |
| 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 |  |
|  | DataType | Тип обязательств: **TRADE** – по Договорам  **FEE** – по оборотной части комиссионного вознаграждения с уплатой в день исполнения Договора  **DIVIDEND** – по возврату дивидендов по сделкам РЕПО | O | 2 | String(0-16) |
|  | CurrencyId | Идентификатор валюты расчётов | O | 1 | String(0-4) |
|  | CurrencyName | Наименование валюты расчётов | O | 1 | WString(0-32) |
|  | SecurityId | Идентификатор инструмента | O | 1 | String(0-12) |
|  | SecShortName | Краткое наименование инструмента | O | 1 | WString(0-32) |
|  | Debit | Нетто-обязательство / обязательство | M | 1 | Numeric(20,2) |
|  | Credit | Нетто-требование / требование | M | 1 | Numeric(20,2) |
| /RECORDS |  |  | M | 1 |  |
| /GROUP |  |  | M | 1 |  |
| /POSTYPES |  |  | M | 1 |  |
| /SETTLEDATE |  |  | M | 1 |  |
| /SETTLE |  |  | M | 1 |  |
| /FIRM |  |  | M | 1 |  |
| /MFB13 |  |  | M | 1 |  |
| /RTS\_DOC |  |  | M | 1 |  |

Пример отчета

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?> <?xml-stylesheet type="text/xsl" href="ftp://ftp.nprts.ru/mse/schema/MFB13.xslt"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2013-04-15" DOC\_NO="RPT8340695" DOC\_TYPE\_ID="MFB13" SENDER\_ID="MFBIM" RECEIVER\_ID="FIRM"/>

<MFB13 ReportDate="2013-04-15" ReportDesc="Отчет об Итоговых нетто-обязательствах / нетто-требованиях" MainFirmId="FIRM" FirmName="FirmName">

<FIRM FirmID="FirmID">

<SETTLE ClrAccCode="MyClearingAcc">

<SETTLEDATE SettleDate="2013-04-15">

<POSTYPES PosType="C">

<GROUP BankAccCode="MyClearingAcc\_RUB" >

<RECORDS DataType="TRADE" CurrencyId="RUB" CurrencyName=" Russian Ruble" Debit="1122567.8" Credit="0"/> </GROUP>

</POSTYPES>

</SETTLEDATE>

<SETTLEDATE SettleDate="2013-04-15">

<POSTYPES PosType="S">

<GROUP GuarDepUnitId="123099001B">

<RECORDS DataType="TRADE" SecurityID="LKOH" SecShortName="а.о. Лукойл" Credit="12000" Debit="0"/>

</GROUP>

</POSTYPES>

</SETTLEDATE>

</SETTLE>

</FIRM>

</MFB13>

</RTS\_DOC>

Пример отчета без данных

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<?xml-stylesheet type="text/xsl" href="ftp://ftp.nprts.ru/mse/schema/MFB13.xslt"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2013-04-15" DOC\_NO="RPT8340695" DOC\_TYPE\_ID="MFB13" SENDER\_ID="MFBIM" RECEIVER\_ID="FIRM" REMARK="На отчетную дату данных нет"/>

<MFB13 ReportDate="2013-04-15" ReportDesc="Отчет об Итоговых нетто-обязательствах / нетто-требованиях" MainFirmId="FIRM" FirmName="FirmName">

<FIRM>

<SETTLE>

<SETTLEDATE>

<POSTYPES>

<GROUP>

<RECORDS/>

</GROUP>

</POSTYPES>

</SETTLEDATE>

</SETTLE>

</FIRM>

</MFB13>

</RTS\_DOC>

### MFB14. Отчет о Гарантийном обеспечении, Маржинальном требовании и Задолженности

Формируется по итогам клиринга.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Название элемента** | **Название атрибута** | **Описание** | **M/O** | **Rev** | **Тип** |
| RTS\_DOC |  |  | М | 1 |  |
| DOC\_REQUISITES |  |  | М | 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 **MFB14** | M | 1 | String(0-20) |
|  | SENDER\_ID | Всегда **MFBIM** | M | 1 | String(3-7) |
|  | SENDER\_NAME | Краткое наименование отправителя | О | 1 | WString(0-120) |
|  | RECEIVER\_ID | Код ЭДО РТС получателя | M | 1 | String(3-7) |
|  | REMARKS | Текст примечания к документу | О | 1 | WString(0-120) |
| /DOC\_REQUISITES |  |  | M | 1 |  |
| MFB14 |  | 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 **D**- Задолженность | M | 1 | String(3) |
|  | 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 |  |

Пример отчета

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2013-04-15" DOC\_NO="DOC\_NO" DOC\_TYPE\_ID="MFB14" SENDER\_ID="MFBIM" RECEIVER\_ID="FIRM"/>

<MFB14 ReportDate="2013-04-15" MainFirmId="FIRM" FirmName="FirmName">

<FIRM FirmID="FIRM">

<SETTLE ClrAccCode="MyClearingAcc">

<COLLATERAL CollateralCurency="RUR" CollateralCurrencyName="Российский рубль" CollateralSum="3432.95" CollateralBlocked="3432.66" />

<OBLIGATION ObligationSum="0.00" />

</SETTLE>

</FIRM>

<FIRM FirmID="CLIENT">

<SETTLE ClrAccCode="ClientClearingAcc">

<COLLATERAL CollateralCurency="RUR" CollateralCurrencyName="Российский рубль" CollateralSum="786856.95" CollateralBlocked="66432.66" />

<OBLIGATION ObligationSum="0.00" />

</SETTLE>

</FIRM>

<OBLIGATION\_TYPE ObligTypeID="N" ObligTypeName="Маржинальное требование отсутствует" TotalSum="0" />

</MFB14>

</RTS\_DOC>

### MFB15. Отчет по обязательствам Участника клиринга по комиссионному вознаграждению

Формируется по итогам клиринга

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Название элемента** | **Название атрибута** | **Описание** | **M/O** | **Rev** | **Тип** |
| RTS\_DOC |  |  | М | 1 |  |
| DOC\_REQUISITES |  |  | М | 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 **MFB15** | M | 1 | String(0-20) |
|  | SENDER\_ID | Всегда **MFBIM** | M | 1 | String(3-7) |
|  | SENDER\_NAME | Краткое наименование отправителя | О | 1 | WString(0-120) |
|  | RECEIVER\_ID | Код ЭДО РТС получателя | M | 1 | String(3-7) |
|  | REMARKS | Текст примечания к документу | О | 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 расчётов | M | 2 | String(0-4) |
|  | CurrencyName | Наименование валюты расчётов | M | 2 | WString(0-30) |
| FEE |  | Блок данных по видам комиссии | M | 1 |  |
|  | FeeType | Признак вида комиссии/штрафа/возвратной премии: **0** - всего по денежной позиции **1** - оборотная часть с уплатой в день заключения договора **2** - постоянная часть  **3** - возвратная премия по данному типу комиссии  **4** - штраф за возникновение задолженности  **5** – комиссия за принудительное закрытие позиции  **6** - оборотная часть с уплатой в день исполнения договора | M | 2 | Char |
|  | 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 | O | 1 | Date |
| /FEE |  |  | M | 1 |  |
| /CURRENCY |  |  | M | 2 |  |
| /TYPE |  |  | M | 1 |  |
| /SETTLE |  |  | M | 1 |  |
| /FIRM |  |  | M | 1 |  |
| /MFB15 |  |  | M | 1 |  |
| /RTS\_DOC |  |  | M | 1 |  |

Пример отчета

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2013-04-15" DOC\_NO="RPT382834" DOC\_TYPE\_ID="MFB15" SENDER\_ID="MFBIM" RECEIVER\_ID="FIRM"/>

<MFB15 ReportDate="2013-04-15" Weekday="Понедельник" MainFirmId="FIRM" FirmName="FirmName">

<FIRM FirmID="FIRM">

<SETTLE ClrAccCode="MyClearingAcc">

<TYPE ComType="1">

<CURRENCY CurrencyId="RUB" CurrencyName="Russian Ruble">

<FEE FeeType="0" TotComm="93545.23" TotVAT="0" />

<FEE FeeType="1" TotComm="91545.23" TotVAT="0" DateFrom="2013-04-15" DateTo="2013-04-15" Executed="Y"/>

<FEE FeeType="2" TotComm="2000.00" TotVAT="0" DateFrom="2013-04-01" DateTo="2013-04-30" Executed="Y"/>

</CURRENCY>

</TYPE>

<TYPE ComType="2">

<CURRENCY CurrencyId="RUB" CurrencyName="Russian Ruble">

<FEE FeeType="0" TotComm="100" TotVAT="0"/>

<FEE FeeType="2" TotComm="100" TotVAT="0" DateFrom="2013-04-01" DateTo="2013-04-30" Executed="Y"/>

</CURRENCY>

</TYPE>

<TYPE ComType="3">

<CURRENCY CurrencyId="RUB" CurrencyName="Russian Ruble">

<FEE FeeType="0" TotComm="62454.77" TotVAT="0" />

<FEE FeeType="1" TotComm="58454.77" TotVAT="0" DateFrom="2013-04-15" DateTo="2013-04-15" Executed="Y"/>

<FEE FeeType="2" TotComm="4000" TotVAT="0" DateFrom="2013-04-01" DateTo="2013-04-30" Executed="Y"/>

</CURRENCY>

</TYPE>

</SETTLE>

</FIRM>

</MFB15>

</RTS\_DOC>

### MFB20. Уведомление о торгово-клиринговых счетах Участника клиринга

Формируется по итогам клиринга

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Название элемента** | **Название атрибута** | **Описание** | **M/O** | **Rev** | **Тип** |
| RTS\_DOC |  |  | М | 1 |  |
| DOC\_REQUISITES |  |  | М | 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 **MFB20** | M | 1 | String(0-20) |
|  | SENDER\_ID | Всегда **MFBIM** | M | 1 | String(3-7) |
|  | SENDER\_NAME | Краткое наименование отправителя | О | 1 | WString(0-120) |
|  | RECEIVER\_ID | Код ЭДО РТС получателя | M | 1 | String(3-7) |
|  | REMARKS | Текст примечания к документу | О | 1 | WString(0-120) |
| /DOC\_REQUISITES |  |  | M | 1 |  |
| MFB20 |  | 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 | M | 1 | String(0-16) |
|  | DataChanged | Индикатор изменений  **Y** – сегодня произошли изменения  **N** – сегодня изменений не происходило | M | 1 | Char |
|  | DefaultClient | Код клиента, использующегося согласно п.27.2 Правил клиринга | O | 1 | String(0-16) |
|  | ExtraDefaultClient | Дополнительный код клиента, использующегося согласно п.27.2 Правил клиринга | O | 1 | String(0-16) |
|  | CommPaymentAcc | Признак раздела для уплаты возмещения и фиксированной части комиссии  **Y** - является  **N** - не является | O | 1 | Char |
|  | 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) |
| BANK\_ACC |  | Блок данных по денежному регистру |  | 1 |  |
|  | CurrencyId | Идентификатор валюты расчётов | M | 1 | String(0-4) |
|  | CurrencyName | Наименование валюты расчётов | 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 |  |
|  | DepositaryName | 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 |  |
| /MFB20 |  |  | M | 1 |  |
| /RTS\_DOC |  |  | M | 1 |  |

Пример отчета

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2013-04-15" DOC\_NO="RPT8748" DOC\_TYPE\_ID="MFB20" SENDER\_ID="MFBIM" RECEIVER\_ID="FIRM"/>

<MFB20 ReportDate="2013-04-15" Weekday="Понедельник" MainFirmId="MainFirmId" FirmName="FIRM" FirmType="Некредитная">

<FIRM FirmID="FIRM">

<CLEARING\_ACC ClrAccId="MyClearingAcc" ClrAccType="p" DataChanged="N" ClrAccStatus="A" CommPaymentAcc="Y">

<BANK\_ACC CurrencyID="RUB" CurrencyName="Российский рубль" DeliveryOnly="N" />

<BANK\_ACC CurrencyID="USD" ClearingCenterID="MFBIM" DeliveryOnly="N" />

<DEPO\_ACC DepositaryName="RDC" GuarDepUnitID="123099001B "/>

</CLEARING\_ACC>

<CLEARING\_ACC ClrAccId="ClientClearingAcc" ClrAccType="c" DataChanged="N" ClrAccStatus="A" DefaultClient="client1" CommPaymentAcc="N">

<BANK\_ACC CurrencyID="RUB" CurrencyName="Российский рубль" DeliveryOnly="N" />

<BANK\_ACC CurrencyID="USD" ClearingCenterID="MFBIM" DeliveryOnly="N" />

<DEPO\_ACC DepositaryName="RDC" GuarDepUnitID="123199001B"/>

<SUBACCOUNT FirmID="STRN1M" SubClrAccCode="SubBroker1" />

<SUBACCOUNT FirmID="STRN2M" SubClrAccCode="SubBroker2" />

</CLEARING\_ACC>

</FIRM>

</MFB20>

</RTS\_DOC>

### MFB21. Уведомление о счетах для вывода денежных средств Участника клиринга

Формируется по итогам клиринга

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Название элемента** | **Название атрибута** | **Описание** | **M/O** | **Rev** | **Тип** |
| RTS\_DOC |  |  | М | 1 |  |
| DOC\_REQUISITES |  |  | М | 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 **MFB21** | M | 1 | String(0-20) |
|  | SENDER\_ID | Всегда **MFBIM** | M | 1 | String(3-7) |
|  | SENDER\_NAME | Краткое наименование отправителя | О | 1 | WString(0-120) |
|  | RECEIVER\_ID | Код ЭДО РТС получателя | M | 1 | String(3-7) |
|  | REMARKS | Текст примечания к документу | О | 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 расчётов | 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) |
|  | 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 |  |

Пример отчета

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2013-04-15" DOC\_NO="RPT8748" DOC\_TYPE\_ID="MFB21" SENDER\_ID="MFBIM" RECEIVER\_ID="FIRM"/>

<MFB21 ReportDate="2013-04-15" Weekday="Понедельник" MainFirmId="MainFirmId" FirmName="FIRM" FirmType="Некредитная">

<CURRENCY CurrencyID="RUR" CurrencyName="Российский рубль" >

<BANK\_ACC AccCode="67587" RealAccount="30218810000000000001" BankName="NRD" BankBIC="7703858345" CorrAcc="312346810000000000001" />

<SETTLE ClrAccCode="MyAccount" FirmId="FIRM" />

<SETTLE ClrAccCode="MyAccount2" FirmId="FIRM" />

</CURRENCY>

<CURRENCY CurrencyID="USD" >

<BANK\_ACC AccCode="67588" RealAccount="47375834/488" BankName="BONY" RecBankBIC="BONEYMM" RecipientName="OAO Firmname, Moscow, PO34628" />

</CURRENCY>

</MFB21>

</RTS\_DOC>

Пример отчета без данных

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2013-04-15" DOC\_NO="RPT8748" DOC\_TYPE\_ID="MFB21" SENDER\_ID="MFBIM" RECEIVER\_ID="FIRM" REMARK="На отчетную дату данных нет"/>

<MFB21 ReportDate="2013-04-15" Weekday="Понедельник" MainFirmId="MainFirmId" FirmName="FIRM" FirmType="Некредитная">

<CURRENCY>

<BANK\_ACC/>

</CURRENCY>

</MFB21>

</RTS\_DOC>

### MFB22. Отчет «Требование о погашении задолженности по денежному регистру»

Формируется по итогам клиринга при возникновении задолженности по денежному регистру

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Название элемента** | | **Название атрибута** | **Описание** | **M/O** | **Rev** | **Тип** |
| RTS\_DOC | |  |  | М | 1 |  |
| DOC\_REQUISITES | |  |  | М | 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 **MFB22** | M | 1 | String(0-20) |
|  | | SENDER\_ID | Всегда **MFBIM** | M | 1 | String(3-7) |
|  | | SENDER\_NAME | Краткое наименование отправителя | О | 1 | WString(0-120) |
|  | | RECEIVER\_ID | Код ЭДО РТС получателя | M | 1 | String(3-7) |
|  | | REMARKS | Текст примечания к документу | О | 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 расчётов | M | 1 | String(0-4) |
|  | | CurrencyName | Наименование валюты расчётов | O | 1 | WString(0-32) |
| DEBTS | |  | Блок данных по задолженности по денежному регистру | M | 1 |  |
|  | | DebtsType | Тип Задолженности: **CLEARING** – задолженность перед Клиринговым Центром;  **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 |  |

Пример отчета

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2013-04-15" DOC\_NO="DOC\_NO" DOC\_TYPE\_ID="MFB22" SENDER\_ID="MFBIM" RECEIVER\_ID="FIRM"/>

<MFB22 ReportDate="2013-04-15 10:00:48" MainFirmId="FIRM" FirmName="FirmName">

<FIRM FirmID="FIRM">

<SETTLE ClrAccCode="MyClearingAcc">

<GROUP BankAccCode="MyClearingAcc\_RUB" CurrencyID="RUB" CurrencyName="Russian Ruble" >

<DEBTS DebtsType="CLEARING" DebtsSum="1122567.8" />

</GROUP>

<GROUP BankAccCode="MyClearingAcc\_USD" CurrencyID="USD" CurrencyName="US Dollar">

<DEBTS DebtsType="CLEARING" DebtsSum="567.48" />

</GROUP>

</SETTLE>

</FIRM>

</MFB22>

</RTS\_DOC>

Пример отчета без данных

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2013-04-15" DOC\_NO="DOC\_NO" DOC\_TYPE\_ID="MFB22" SENDER\_ID="MFBIM" RECEIVER\_ID="FIRM" REMARK="На отчетную дату данных нет"/>

<MFB22 ReportDate="2013-04-15 10:00:48" MainFirmId="FIRM" FirmName="FirmName">

<FIRM>

<SETTLE>

<GROUP>

<DEBTS/>

</GROUP>

</SETTLE>

</FIRM>

</MFB22>

</RTS\_DOC>

### MFB23. Отчет об обязательствах по Договорам

Формируется по итогам клиринга

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Название элемента** | **Название атрибута** | **Описание** | **M/O** | **Rev** | **Тип** |
| RTS\_DOC |  |  | М | 1 |  |
| DOC\_REQUISITES |  |  | М | 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 **MFB23** | M | 1 | String(0-20) |
|  | SENDER\_ID | Всегда **MFBIM** | M | 1 | String(3-7) |
|  | SENDER\_NAME | Краткое наименование отправителя | О | 1 | WString(0-120) |
|  | RECEIVER\_ID | Код ЭДО РТС получателя | M | 1 | String(3-7) |
|  | REMARKS | Текст примечания к документу | О | 1 | WString(0-120) |
| /DOC\_REQUISITES |  |  | M | 1 |  |
| MFB23 |  | 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 | **C -** 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(0-16) |
|  | 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  **DIVIDEND** – по возврату дивидендов по сделкам РЕПО | M | 2 | String(0-12) |
|  | CurrencyId | Идентификатор валюты расчётов | O | 1 | String(0-4) |
|  | CurrencyName | Наименование валюты расчётов | 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(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) |
|  | 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 |  |
| SUBACCOUNT |  | Блок данных по Аналитическому ТКС (если есть) | O | 1 |  |
|  | SubClrAccCode | Код Аналитического ТКС | M | 1 | String(0-16) |
| SUBRECORDS |  | Блок данных по обязательствам по Аналитическому ТКС | M | 2 |  |
|  | DataType | Тип обязательств: **TRADE** – по договорам  **FEE** – по оборотной части комиссионного вознаграждения с уплатой в день исполнения Договора  **DIVIDEND** – по возврату дивидендов по сделкам РЕПО | O | 1 | String(0-12) |
|  | CurrencyId | Идентификатор валюты расчётов | O | 1 | String(0-4) |
|  | CurrencyName | Наименование валюты расчётов | 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) |
|  | PosExecDebit | Количество исполненных обязательств | O | 2 | Numeric(20,0) |
|  | PosExecCredit | Количество исполненных требований | O | 2 | Numeric(20,0) |
|  | Debit | Итоговое нетто-обязательство / обязательство | O | 1 | Numeric(20,2) |
|  | Credit | Итоговое нетто-требование / требование | O | 1 | Numeric(20,2) |
| /SUBRECORDS |  |  | M | 1 |  |
| /POSTYPES |  |  | M | 1 |  |
| /SETTLEDATE |  |  | M | 1 |  |
| /SUBACCOUNT |  |  | M | 1 |  |
| /SETTLE |  |  | M | 1 |  |
| /FIRM |  |  | M | 1 |  |
| /MFB23 |  |  | M | 1 |  |
| /RTS\_DOC |  |  | M | 1 |  |

Пример отчета

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2014-04-15" DOC\_NO="RPT839725" DOC\_TYPE\_ID="MFB23" SENDER\_ID="MFBIM" RECEIVER\_ID="FIRM"/>

<MFB23 ReportDate="2014-04-15" MainFirmId="FIRM" FirmName="FirmName">

<FIRM FirmID="FIRM">

<SETTLE ClrAccCode="MyClearingAcc">

<SETTLEDATE SettleDate="2014-04-16">

<POSTYPES PosType="C">

<GROUP BankAccCode="MyClearingAcc">

<RECORDS DataType="TRADE" CurrencyId="RUB" CurrencyName="Российские рубли" DebitBeg="228532.80" CreditBeg="0.00" Debit="228532.80" Credit="0.00"/>

<RECORDS DataType="FEE" CurrencyId="RUB" CurrencyName="Российские рубли" Debit="22.85" Credit="0.00"/>

<SUBACCOUNT SubClrAccCode="MyVirtClrAcc">

<SUBRECORDS DataType="TRADE" CurrencyId="RUB" CurrencyName="Российские рубли" DebitBeg="228532.80" CreditBeg="0.00" Debit="228532.80" Credit="0.00"/>

</SUBACCOUNT>

</GROUP>

</POSTYPES>

</SETTLEDATE>

<SETTLEDATE SettleDate="2014-04-17">

<POSTYPES PosType="C">

<GROUP BankAccCode="MyClearingAcc">

<RECORDS DataType="TRADE" CurrencyId="RUB" CurrencyName="Российские рубли" Debit="372215.5" Credit="0"/>

</GROUP>

</POSTYPES>

<POSTYPES PosType="S">

<GROUP GuarDepUnitId ="53534/78" TrdAccId="MyClearingAcc">

<RECORDS SecurityId="GAZP" SecShortName="ГАЗПРОМ ао" Debit="935" Credit="0"/>

</GROUP>

</POSTYPES>

</SETTLEDATE>

</SETTLE>

</FIRM>

</MFB23>

</RTS\_DOC>

Пример отчета без данных

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<?xml-stylesheet type="text/xsl" href="ftp://ftp.nprts.ru/mse/schema/MFB23.xslt"?><?xml-stylesheet type="text/xsl" href="C:\RTS\MFB23.xslt"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2014-08-26" DOC\_TIME="17:25:57" DOC\_TYPE\_ID="MFB23" SENDER\_ID="MFBIM" SENDER\_NAME="ОАО &quot;КЦ МФБ&quot;" RECEIVER\_ID="FIRM" REMARKS="На отчетную дату данных нет"/>

<MFB23 ReportDate="2014-08-26" ReportDesc="Отчет об обязательствах по сделкам" ReportVersion="001" Weekday="Вторник" MainFirmId="FIRM" FirmName="ООО &quot;РОМАШКА&quot; ">

<FIRM>

<SETTLE>

<SETTLEDATE>

<POSTYPES>

<GROUP>

<RECORDS/>

</GROUP>

</POSTYPES>

</SETTLEDATE>

</SETTLE>

</FIRM>

</MFB23>

</RTS\_DOC>

### MFB23C. Отчет об обязательствах по Договорам (по договорам клиентов)

Формируется по итогам клиринга

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Название элемента** | **Название атрибута** | **Описание** | **M/O** | **Rev** | **Тип** |
| RTS\_DOC |  |  | М | 1 |  |
| DOC\_REQUISITES |  |  | М | 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 **MFB23C** | M | 1 | String(0-20) |
|  | SENDER\_ID | Всегда **MFBIM** | M | 1 | String(3-7) |
|  | SENDER\_NAME | Краткое наименование отправителя | О | 1 | WString(0-120) |
|  | RECEIVER\_ID | Код ЭДО РТС получателя | M | 1 | String(3-7) |
|  | REMARKS | Текст примечания к документу | О | 1 | WString(0-120) |
| /DOC\_REQUISITES |  |  | M | 1 |  |
| MFB23C |  | 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 | M | 2 | String(0-12) |
|  | CurrencyId | Идентификатор валюты расчётов | O | 1 | String(0-4) |
|  | CurrencyName | Наименование валюты расчётов | 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) |
|  | 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 |  |

Пример отчета

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2014-04-15" DOC\_NO="RPT389578912" DOC\_TYPE\_ID="MFB23C" SENDER\_ID="MFBIM" RECEIVER\_ID="FIRM"/>

<MFB23C ReportDate="2014-04-15" MainFirmId="FIRM" FirmName="FirmName">

<FIRM FirmID="FIRM">

<CLIENT ClientCode="client1" ClientDetails="77035834758">

<SETTLEDATE SettleDate="2014-04-16">

<POSTYPES PosType="C">

<RECORDS DataType="TRADE" CurrencyId="RUB" CurrencyName="Российские рубли" Debit="228532.8" Credit="0"/>

</POSTYPES>

</SETTLEDATE>

<SETTLEDATE SettleDate="2014-04-17">

<POSTYPES PosType="C">

<RECORDS DataType="TRADE" CurrencyId="RUB" CurrencyName="Российские рубли" Debit="372215.5" Credit="0"/>

</POSTYPES>

<POSTYPES PosType="S">

<RECORDS SecurityId="GAZP" SecShortName="ГАЗПРОМ ао" Debit="935" Credit="0"/>

</POSTYPES>

</SETTLEDATE>

</CLIENT>

</FIRM>

</MFB23C>

</RTS\_DOC>

Пример отчета без данных

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<?xml-stylesheet type="text/xsl" href="ftp://ftp.nprts.ru/mse/schema/MFB23C.xslt"?><?xml-stylesheet type="text/xsl" href="C:\RTS\MFB23C.xslt"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2014-08-26" DOC\_TIME="17:25:57" DOC\_TYPE\_ID="MFB23C" SENDER\_ID="MFBIM" SENDER\_NAME="ОАО &quot;КЦ МФБ&quot;" RECEIVER\_ID="FIRM" REMARKS="На отчетную дату данных нет"/>

<MFB23C ReportDate="2014-08-26" ReportDesc="Отчет об обязательствах по сделкам клиентов" ReportVersion="001" Weekday="Вторник" MainFirmId="FIRM" FirmName="ООО &quot;РОМАШКА&quot; ">

<FIRM>

<CLIENT>

<SETTLEDATE>

<POSTYPES>

<RECORDS/>

</POSTYPES>

</SETTLEDATE>

</CLIENT>

</FIRM>

</MFB23C>

</RTS\_DOC>

### MFB76. Отчет о взносах в Гарантийный фонд участников

Формируется по итогам клиринга

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Название элемента** | **Название атрибута** | **Описание** | **M/O** | **Rev** | **Тип** |
| RTS\_DOC |  |  | М | 1 |  |
| DOC\_REQUISITES |  |  | М | 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 **MFB76** | M | 1 | String(0-20) |
|  | SENDER\_ID | Всегда **MFBIM** | M | 1 | String(3-7) |
|  | SENDER\_NAME | Краткое наименование отправителя | О | 1 | WString(0-120) |
|  | RECEIVER\_ID | Код ЭДО РТС получателя | M | 1 | String(3-7) |
|  | REMARKS | Текст примечания к документу | О | 1 | WString(0-120) |
| /DOC\_REQUISITES |  |  | M | 1 |  |
| MFB76 |  | 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) |
| 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) |
|  | ContibutionSum | 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 участников | M | 1 | Numeric(20,2) |
|  | GFContribution | Величина взноса Участника в Гарантийный фонд участников | M | 1 | Numeric(20,2) |
|  | ContributionSharePart | Доля взноса участника в Гарантийном фонде участников | M | 1 | Numeric(20,4) |
|  | ContributionShareTotal | Доля взноса участника в общей величине Гарантийного фонда участников и Специального гарантийного фонда | M | 1 | Numeric(20,4) |
| / RECORDS |  |  | M | 1 |  |
| /MFB76 |  |  | M | 1 |  |
| /RTS\_DOC |  |  | M | 1 |  |

Пример отчета

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2014-04-15" DOC\_NO="RPT3898912" DOC\_TYPE\_ID="MFB76" SENDER\_ID="MFBIM" RECEIVER\_ID="FIRM"/>

<MFB76 ReportDate="2014-04-15" MainFirmId="FIRM" FirmName="FirmName" ReportDesc="Отчет о взносах в Гарантийный фонд участников" ReportVersion="1">

<ENTRY CurrencyId="USD" CurrencyName="Доллар США" ContributionSum="100000.00" >

<RECORDS CurrencyId="RUB" CurrencyName="Российские рубли" GFOblifation="3000000.00" GFContribution="4000000.00" ContributionSharePart="7.2215" ContributionShareTotal="7.5465" />

</MFB76>

</RTS\_DOC>

*Пример отчета без данных*

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<?xml-stylesheet type="text/xsl" href="ftp://ftp.nprts.ru/mse/schema/MFB76.xslt"?><?xml-stylesheet type="text/xsl" href="C:\RTS\MFB76.xslt"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2014-08-26" DOC\_TIME="17:25:57" DOC\_TYPE\_ID="MFB76" SENDER\_ID="MFBIM" SENDER\_NAME="ОАО &quot;КЦ МФБ&quot;" RECEIVER\_ID="FIRM" REMARKS="На отчетную дату данных нет"/>

<MFB76 ReportDate="2014-08-26" ReportDesc="Отчет о взносах в Гарантийный фонд участников" Weekday="Вторник" MainFirmId="FIRM" FirmName="ООО &quot;РОМАШКА&quot; ">

<RECORDS/>

</MFB76>

</RTS\_DOC>

### MFB82. Отчет о клиентах Участника клиринга

Формируется по итогам клиринга

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Название элемента** | **Название атрибута** | **Описание** | **M/O** | **Rev** | **Тип** |
| RTS\_DOC |  |  | М | 1 |  |
| DOC\_REQUISITES |  |  | М | 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 **MFB82** | M | 1 | String(0-20) |
|  | SENDER\_ID | Всегда **MFBIM** | M | 1 | String(3-7) |
|  | SENDER\_NAME | Краткое наименование отправителя | О | 1 | WString(0-120) |
|  | RECEIVER\_ID | Код ЭДО РТС получателя | M | 1 | String(3-7) |
|  | REMARKS | Текст примечания к документу | О | 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) |
|  | Type | Тип клиента | M | 1 | String(0-3) |
|  | Details | Идентификация клиента (из заявления на регистрацию) | 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 |
|  |  |  |  |  |  |
|  | IndividualIvestmentAccount | Признак ИИС:  **Y** –да  **N** – нет. | O | 3 | Char |
|  | Status | Статус клиента  **A** - активный  **N** – неактивированный  **D** - удаленный | M | 1 | Char |
|  | 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 |  |

Пример отчета

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2014-04-15" DOC\_NO="RPT3898912" DOC\_TYPE\_ID="MFB82" SENDER\_ID="MFBIM" RECEIVER\_ID="FIRM"/>

<MFB82 ReportDate="2014-04-15" MainFirmId="FIRM" FirmName="FirmName" ReportDesc="Отчет о клиентах" ReportVersion="1">

<FIRM FirmID="FIRM">

<RECORDS ClientCode="client1" Type="01" Details="774363464" Status="A" DateOpen="2014-03-15" DataChanged="N" />

<RECORDS ClientCode="client2" Type="01" Details="774653000" Status="A" DateOpen="2014-03-15" DataChanged="N" />

<RECORDS ClientCode="client3" Type="01" Details="554673555" Status="A" DateOpen="2014-03-15" DataChanged="N" />

</FIRM>

</MFB82>

</RTS\_DOC>

### MFB98. Отчет об обязательствах/требованиях по передаче дохода

Формируется с даты включения обязательств/требований по передаче дохода в клиринговый пул до момента исполнения этих обязательств

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Название элемента** | **Название атрибута** | **Описание** | **M/O** | **Rev** | **Тип** |
| RTS\_DOC |  | Корневой элемент (root element) XML документа | М | 1 |  |
| DOC\_REQUISITES |  | Блок информации о документе | М | 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 **MFB98** | M | 1 | String(0-20) |
|  | SENDER\_ID | Всегда **MFBIM** | M | 1 | String(3-7) |
|  | SENDER\_NAME | Краткое наименование отправителя | О | 1 | WString(0-120) |
|  | RECEIVER\_ID | Код ЭДО РТС получателя | M | 1 | String(3-7) |
|  | REMARKS | Текст примечания к документу | О | 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(0-16) |
| SETTLE |  | Блок данных по ТКС | M | 1 |  |
|  | ClrAccCode | Код ТКС | M | 1 | String(0-16) |
| GROUP |  | Блок данных по обязательствам | O | 1 |  |
|  | BankAccCode | Код денежного регистра | O | 1 | String(0-16) |
|  | 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 начислению Дохода в Системе торгов | M | 1 | Integer |
|  | 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(0-16) |
|  | 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** - по передаче дохода (дивиденды). | M | 1 | String(0-20) |
|  | CurrencyId | Идентификатор валюты дивидендов | M | 1 | String(0-4) |
|  | CurrencyName | Наименование валюты дивидендов | O | 1 | WString(0-32) |
|  | Price | Доход на одну ценную бумагу (купон или амортизация) | M | 1 | Numeric(20,6) |
|  | TaxRate | Ставка налога на дивиденды (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 |  |

Пример отчета

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2013-04-15" DOC\_NO="RPT835982" DOC\_TYPE\_ID="MFB98" SENDER\_ID="MFBIM" RECEIVER\_ID="FIRM"/>

<MFB98 ReportDate="2013-04-15" MainFirmId="FIRM" FirmName="FirmName">

<FIRM FirmID="FIRM">

<SETTLE ClrAccCode="MyClearingAcc">

<GROUP BankAccId="MyClearingAcc">

<RECORDS TradeNo="324432" OperationNo="35345" TradeDate="2014-04-12" SettleDate1="2014-04-12" SettleDate2="2014-04-18" DebitCredit="D" SecurityID="LKOH" CurrencyId="RUB" CurrencyName="Российские рубли" Type="DIVIDEND\_PAYMENT" Quantity="10000" Price="135.4508" TaxRate="10.00" Sum="1219057.20" />

</GROUP>

</SETTLE>

</FIRM>

</MFB98>

</RTS\_DOC>

### MFB98A. Уведомление о размере обязательств/требований по передаче дохода

Формируется в день сбора реестра

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Название элемента** | **Название атрибута** | **Описание** | **M/O** | **Rev** | **Тип** |
| RTS\_DOC |  | Корневой элемент (root element) XML документа | М | 1 |  |
| DOC\_REQUISITES |  | Блок информации о документе | М | 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 **MFB98** | M | 1 | String(0-20) |
|  | SENDER\_ID | Всегда **MFBIM** | M | 1 | String(3-7) |
|  | SENDER\_NAME | Краткое наименование отправителя | О | 1 | WString(0-120) |
|  | RECEIVER\_ID | Код ЭДО РТС получателя | M | 1 | String(3-7) |
|  | REMARKS | Текст примечания к документу | О | 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(0-16) |
| SETTLE |  | Блок данных по ТКС | M | 1 |  |
|  | ClrAccCode | Код ТКС | M | 1 | String(0-16) |
| GROUP |  | Блок данных по обязательствам | O | 1 |  |
|  | BankAccCode | Код денежного регистра | O | 1 | String(0-16) |
|  | 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 |
|  | 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(0-16) |
|  | 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** - по передаче дохода (дивиденды). | M | 1 | String(0-20) |
|  | CurrencyId | Идентификатор валюты дивидендов | M | 1 | String(0-4) |
|  | CurrencyName | Наименование валюты дивидендов | O | 1 | WString(0-32) |
|  | Price | Доход на одну ценную бумагу (купон или амортизация) | M | 1 | Numeric(20,6) |
|  | TaxRate | Ставка налога на дивиденды (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 |  |

Пример отчета

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2013-04-15" DOC\_NO="RPT835982" DOC\_TYPE\_ID="MFB98" SENDER\_ID="MFBIM" RECEIVER\_ID="FIRM"/>

<MFB98A ReportDate="2013-04-15" MainFirmId="FIRM" FirmName="FirmName">

<FIRM FirmID="FIRM">

<SETTLE ClrAccCode="MyClearingAcc">

<GROUP BankAccId="MyClearingAcc">

<RECORDS TradeNo="324432" OperationNo="35345" TradeDate="2014-04-12" SettleDate1="2014-04-12" SettleDate2="2014-04-18" DebitCredit="D" SecurityID="LKOH" CurrencyId="RUB" CurrencyName="Российские рубли" Type="DIVIDEND\_PAYMENT" Quantity="10000" Price="135.4508" TaxRate="10.00" Sum="1219057.20" />

</GROUP>

</SETTLE>

</FIRM>

</MFB98A>

</RTS\_DOC>

### MFB99. Отчет об обеспечении

Формируется по итогам клиринга

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Название элемента** | **Название атрибута** | **Описание** | **M/O** | **Rev** | **Тип** |
| RTS\_DOC |  | Корневой элемент (root element) XML документа | М | 1 |  |
| DOC\_REQUISITES |  | Блок информации о документе | М | 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 **MFB99** | M | 1 | String(0-20) |
|  | SENDER\_ID | Всегда **MFBIM** | M | 1 | String(3-7) |
|  | SENDER\_NAME | Краткое наименование отправителя | О | 1 | WString(0-120) |
|  | RECEIVER\_ID | Код ЭДО РТС получателя | M | 1 | String(3-7) |
|  | REMARKS | Текст примечания к документу | О | 1 | WString(0-120) |
| /DOC\_REQUISITES |  |  | M | 1 |  |
| MFB99 |  | 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 нетто обязательствах/требованиях по денежной позиции  **S** - информация о нетто обязательствах/требованиях по депозитарным разделам | M | 1 | Char |
| GROUP |  | Блок данных по обязательствам | M | 1 |  |
|  | BankAccCode | Код денежного регистра | O | 1 | String(0-16) |
|  | GuarDepUnitId | Счет (субсчет) депо для учета ценных бумаг | O | 1 | String(0-32) |
|  | TrdAccId | Код депо регистра | O | 1 | String(0-16) |
| RECORDS |  | Блок данных по обязательствам | M | 1 |  |
|  | CurrencyId | Идентификатор валюты расчётов | O | 1 | String(0-4) |
|  | CurrencyName | Наименование валюты расчётов | 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(20,2) |
|  | ClosingBalance | Исходящий остаток | M | 1 | Numeric(20,2) |
|  | DebtsSum | Задолженность по денежному регистру | O | 1 | Numeric(20,2) |
|  | DebitSum | Итого по дебету | M | 1 | Numeric(20,2) |
|  | CreditSum | Итого по кредиту | M | 1 | Numeric(20,2) |
| ENTRY |  | Данные по операции | M | 1 |  |
|  | OperationCode | Код операции с Обеспечением: 1- внесение/возврат денег в обеспечение через Расчетную организацию;  2- внесение/возврат денег в обеспечение на основании перевода, осуществленного Участником внутри системы;  5- исполнение обязательств/требований по договорам с наступившей Датой исполнения;  6 – обязательства по передаче дохода (купон);  7 - обязательства по передаче дохода (амортизация);  8 - обязательства по передаче дохода (дивиденды);  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 фиксированной части комиссионного вознаграждения за организацию торгов;  14- списание фиксированной части клиринговой комиссии;  15- списание фиксированной части 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 Клиринговым центром 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 | M | 1 | String(0-3) |
|  | Purpose | Пояснения к операции (если есть) | O | 3 | WString(255) |
|  | OperationTime | Время операции | O | 1 | Datetime |
|  | DocNo | Номер документа | O | 1 | String(0-32) |
|  | Debit | Дебет | M | 1 | Numeric(20,2) |
|  | Credit | Кредит | M | 1 | Numeric(20,2) |
| /ENTRY |  |  |  | 1 |  |
| /RECORDS |  |  |  | 1 |  |
| /GROUP |  |  |  | 1 |  |
| /POSTYPES |  |  |  | 1 |  |
| /SETTLE |  |  |  | 1 |  |
| /FIRM |  |  |  | 1 |  |
| /MFB99 |  |  |  | 1 |  |
| /RTS\_DOC |  |  |  | 1 |  |

Пример отчета

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<RTS\_DOC>

<DOC\_REQUISITES DOC\_DATE="2013-04-15" DOC\_NO="RPT7654378" DOC\_TYPE\_ID="MFB99" SENDER\_ID="MFBIM" RECEIVER\_ID="FIRM"/>

<MFB99 ReportDate="2013-04-15" MainFirmId="FIRM" FirmName="FirmName">

<FIRM FirmID="FIRM">

<SETTLE ClrAccCode="MyClearingAcc">

<POSTYPES PosType="C">

<GROUP BankAccCode="BankAccId">

<RECORDS CurrencyId="RUB" CurrencyName="Российские рубли" OpeningBalance="1000000.00" ClosingBalance="1350000.00" DebitSum="0.00" CreditSum="350000.00">

<ENTRY OperationCode="1" Purpose="Внесение средств обеспечения по договору №ZZZ от 01.01.2015. Код ТКС MyAccount" OperationTime="11:38:31" Debit="0.00" Credit="660000.00" DocNo="745378"/>

<ENTRY OperationCode="5" OperationTime="19:01:01" Debit="160000.00" Credit="0.00"/>

<ENTRY OperationCode="10" Purpose="Корректирующий платеж" OperationTime="19:01:01" Debit="91545.23" Credit="0.00"/>

<ENTRY OperationCode="12" OperationTime="19:01:01" Debit="58454.77" Credit="0.00"/>

</RECORDS>

</GROUP>

</POSTYPES>

<POSTYPES PosType="S">

<GROUP GuarDepUnitID="53485/46">

<RECORDS SecurityId="LKOH" SecutityName="ЛУКОЙЛ" OpeningBalance="10000.00" ClosingBalance="16000.00" DebitSum="0.00" CreditSum="6000.00">

<ENTRY OperationCode="1" OperationTime="14:38:31" Debit="0.00" Credit="6000.00" DocNo="57378"/>

</RECORDS>

</GROUP>

</POSTYPES>

</SETTLE>

</FIRM>

</MFB99>

</RTS\_DOC>