Приложение 5
к Регламенту осуществления клиринговой деятельности
на рынке финансовых инструментов
НКО-ЦК «СПБ Клиринг» (АО)

**Формы клиринговых отчетов**

## ОГЛАВЛЕНИЕ

Перечень изменений ....174
Форматы документов ....186
Пролог XML документа ....187
Элементы XML документа ....187
Атрибуты элементов XML документа ....187
Условные обозначения ....187
Типы данных ....188
Документы Системы электронного документооборота в формате XML ....188
Спецификация форм отчетов ....189
MFB06(SD) Отчет об обязательствах, допущенных в клиринг, кроме обязательств по Договорам ПФИ (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг) ....189
MFB06C Отчет об обязательствах, допущенных в клиринг, кроме обязательств по Договорам ПФИ (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга) ....196
MFB07 Отчет об обязательствах по Договорам ПФИ (Опционы), допущенных в клиринг (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг) ....202
MFB07C Отчет об обязательствах по Договорам ПФИ (Опционы), допущенных в клиринг (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг, по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга) ....207
MFB08 Отчет об обязательствах по Договорам ПФИ (Фьючерсные контракты), допущенных в клиринг (Выписка из реестра договоров ПФИ, принятых в клиринг) ....212
MFB08C Отчет об обязательствах по Договорам ПФИ (Фьючерсные контракты), допущенных в клиринг (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг, по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга) ....217
MFB13 Отчет об итоговых нетто-обязательствах/нетто-требованиях ....222
MFB14 Отчет о Гарантийном обеспечении, Маржинальном требовании и Задолженности ....224
MFB15 Отчет по обязательствам Участника клиринга по комиссионному вознаграждению ....226
MFB17F Комиссия за учет позиций по фьючерсным контрактам и Вариационная маржа, связанная с отклонением цены фьючерсного контракта от цены базисного актива ....229
MFB18F Отчет о позиции по Фьючерсным контрактам ....232
MFB20 Уведомление о торгово-клиринговых счетах Участника клиринга ....234
MFB21 Уведомление о счетах для вывода денежных средств Участника клиринга ....237
MFB22 Отчет о требованиях по погашению задолженности по денежному регистру ....239
MFB23 Отчет об обязательствах по договорам, кроме обязательств по Договорам ПФИ ....241
MFB23C Уведомление об обязательствах по Договорам, кроме обязательств по Договорам ПФИ (по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга) ....243
MFB23D Уведомление об обязательствах по Договорам ПФИ (по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга) ....245

MFB24 Отчет об обязательствах по исполнению опционов ..... 249

MFB66(SD) Отчет по денежным средствам и ценным бумагам Участника клиринга, не включенным в Средства обеспечения и Гарантийный фонд ..... 251

MFB76 Отчет о взносах в Гарантийный фонд ..... 254

MFB82 Уведомление о присвоении Регистрационных кодов / регистрации Кратких кодов клиентов Участника клиринга и (или) Участника клиринга ..... 256

MFB98 Отчет о глобальных операциях и об обязательствах/требованиях по передаче Дохода ..... 259

MFB98A Уведомление о размере обязательств/требований по передаче Дохода ..... 262

MFB99(SD) Отчет об обеспечении ..... 264

Требования к формированию имени файлов отчетов, уведомлений, выписок, направляемых по Системе электронногодокументооборота ..... 269

**Перечень изменений**

| Дата изменений | Описание изменений |
|---|---|
| 21.07.2014 | • Изменен формат и набор возможных значений для атрибута BoardId элемента BOARD отчетов MFB06 и MFB06C<br>• В отчете MFB23 обязательства по Аналитическому ТКС (SUBACCOUNT) перенесены в элемент SUBRECORDS<br>• Атрибут PosExec для дочернего элемента SUBRECORDS элемента SUBACCOUNT отчета MFB023 заменен на два атрибута PosExecDebit и PosExecCredit<br>• Набор возможных значений для атрибута DebtsType отчета MFB22 дополнен значением BANK |
| 08.08.2014 | • Изменена структура отчета MFB23 в части отображения позиций по аналитическим ТКС<br>• Добавлен тип обязательств FEE для отчетов MFB13, MFB23 и MFB23C<br>• Добавлен тип комиссии 6 и признак Executed в отчет MFB15 |
| 19.08.2014 | • Добавлены примеры отчетов без данных |
| 12.09.2014 | • Добавлен элемент CURRENCY в отчет MFB15 |
| 17.09.2014 | • Изменен список типов инструментов для отчетов MFB06, MFB06C |
| 16.10.2014 | • Изменен формат отчета MFB76 для учета различных типов активов в ГФ<br>• Отчеты MFB06 и MFB06C. Добавлены новые типы сделок урегулирования<br>• Отчет MFB99. Добавлены новые типы штрафов<br>• Отчеты MFB06 и MFB06C. Добавлены поля FineDebit и FineCredit, поле VarMargin заменено на VarMarginDebit, VarMarginCredit<br>• Отчет MFB98. Добавлено поле TaxRate |
| 06.11.2014 | • Отчет MFB20. Добавлен атрибут ExtraDefaultClient |
| 11.11.2014 | • Отчет MFB06 и MFB06C. Добавлены атрибуты RepoRate и PriceType |
| 18.11.2014 | • Отчеты MFB06, MFB06C. Добавлены атрибуты BalanceSecurityId, FaceValue, SecurityType, SecCurrencyId<br>• Добавлен отчет-уведомление MFB98A |
| 09.03.2015 | • Отчеты MFB06, MFB06C, добавлен атрибут TradePeriod, добавлена формула расчета значения атрибута Price2<br>• Отчет MFB20, добавлен атрибут BrokerFeeAccount.<br>• Отчет MFB82, добавлены атрибуты CheckCrossMarket, IndividualIvestmentAccount.<br>• Отчет MFB99, добавлен атрибут Purpose |

| | |
|---|---|
| 20.06.2015 | Добавлена информация о действиях при проведении корпоративного события:<br>• Отчет MFB06, MFB06C: добавлен атрибут CorpEvent<br>• Отчет MFB23, MFB23C: добавлены атрибуты DebitCorpEvCorrection, CreditCorpEvCorrection,DebitIntraday, CreditIntraday<br>Отчет MFB98, MFB98A: добавлены атрибуты RecordDate, PaymentDate,<br><br>Отчет MFB06, MFB06C:<br>• Расширен список клиринговых сессий<br>• Расширен список режимов торгов<br>• Исключен атрибут TradeLegNo<br>• Добавлены атрибуты PaymentDetails, DeliveryDetails для сделок в режимах без ЦК<br><br>Отчет MFB13<br>• Исключен атрибут DataType<br>• Добавлен опциональный атрибут Shortage<br><br>Отчет MFB20<br>• добавлен атрибут SeparateAccounting<br>• добавлен атрибут ForNonCcpAccounting<br>• добавлен опциональный атрибут TrustClientIdentifier<br>• расширен список типов ТКС<br><br>Отчет MFB82<br>• добавлен атрибут IdentificationCode<br><br>Отчет MFB98<br>• расширен список типов дополнительных обязательств<br>• добавлен атрибут NewSecurityId<br>• добавлен атрибут NewSecShortName<br>• добавлен атрибут NewISIN<br><br>Отчет MFB99<br>• добавлен атрибут CustomerNo<br>• изменен список видов операций с обеспечением<br><br>Отчеты MFB23, MFB23C:<br>• Добавлен новый тип обязательств ADDITION в атрибут DataType |
| 25.04.2016 | Отчет MFB06 и MFB06<br>• Добавлен атрибут SpecialPeriod<br>• Добавлен режим торгов RFQ<br><br>Отчет MFB15<br>• Добавлен тип комиссии 8 – за списание с Торгового счета/Субсчета депо ценных бумаг иностранного эмитента, учитываемых в качестве Средств обеспечения Участника клиринга, наосновании поручения на списание ценных бумаг в количестве, превышающем совокупное количество ценных бумаг данного иностранного эмитента, внесенных в качестве Средств обеспечения данным Участником клиринга |

| | |
|---|---|
| 05.03.2018 | Отчет MFB06 и MFB06C<br>• Добавлены атрибут FirmINN в корневой элемент MFB06 и FirmTradeINN в элемент FIRM<br>• Расширен список значений для атрибута ClearingType элемента CLEARINGTYPE<br>• Для элемента SESSION добавлен опциональный атрибут ClearingTime , исключен атрибутSession<br>• Исключен атрибут BalanceSecurityId элемента SECURITY<br>• В отчет включены Поручения на клиринг внебиржевых договоров по заключеннымКонверсионным договорам и Договоры OTC/ Договоры репо OTC<br>• Добавлены новые группы инструментов в элемент BOARD<br>• Добавлены режимы торгов в атрибуты TradeModeID, TradeModeName<br>• Добавлены атрибуты PrimaryTradeNo и PrimaryOrderID, IsExtraLiquidity, ConversionRate,CPFirmDetails, RepositoryNumber<br>• Расширен список значений для атрибута SpecialPeriod<br>• Атрибут Amount может изменяться при пересчете обязательств, в случае если валюта договора несовпадает с валютой расчета, добавлен атрибут AmountOTC<br>• Исключен атрибут TradePart элемента RECORD<br>• Изменен комментарий с алгоритмом расчета цены второй части РЕПО с учетом договоров соблигациями<br>• Атрибут TradePeriod элемента RECORD сделан необязательным<br><br>Отчет MFB15<br>• Добавлено описание новых типов комиссии<br>o 9 – комиссия за прием Поручений на клиринг внебиржевых договоров по заключенным Конверсионным договорам с уплатой в день приема поручения<br>o 10 – комиссия за прием Поручений на клиринг внебиржевых договоров позаключенным Конверсионным договорам с уплатой в день исполнения Конверсионного договора<br>o 12 – комиссия за договора репо, заключённые в Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» на основании Заявок репо, в которых указаны Торгово-клиринговые счета, зарегистрированные на одного Участника торгов<br><br>Отчет MFB20<br>• Добавлены атрибуты DateCreated и DateDeleted, FeeClutch, OtcSettlementCurrency<br><br>Отчет MFB99<br>• Добавлены новые типы операций в атрибут OperationType элемента ENTRY<br>• Добавлены атрибут ClientCode элемента ENTRY<br>• Исключен атрибут TrdAccId<br>• Тип атрибута OperationTime изменен на Time<br><br>Отчет MFB13<br>Добавлен элемент SESSION с атрибутами, описывающими клиринговый пул |
| 28.03.2018 | Отчеты MFB06 и MFB06C<br>• Добавлено значение P в атрибут TradeType<br>• Добавлено значение M в атрибут CorpEvent |

| | |
|---|---|
| 20.06.2018 | Отчеты MFB06 и MFB06C<br>• Добавлена поддержка «пары договоров» Отчет MFB20<br>• Добавлен атрибут RepoUnavailable |
| 05.10.2018 | Отчеты MFB99 и MFB15<br>• Добавлены новые типы комиссионных сборов Отчет MFB99<br>• Добавлен атрибут OpeningDebtsSum для отображения входящей задолженности по денежному регистру Отчеты MFB06, MFB06C<br>• Исключен атрибут ISExtraLiquidity |
| 30.10.2018 | Отчеты MFB06, MFB06C<br>• Скорректировано описание атрибутов PrimaryOrderId, OrderId |
| 08.11.2018 | Отчеты MFB06, MFB06C<br>• Добавлено значение MORN для атрибута TradePeriod для отображения дополнительной утренней торговой сессии<br>• Добавлены атрибуты CCPCode, CCPName, CCPDetails, CPFirmDetails Отчет MFB82<br>• Изменено описание атрибута IdentificationCode<br>добавлен атрибут Principal для идентификации лица, для которого зарегистрированы коды (учетный регистр) – клиент Участника клиринга или Участник клиринга<br>Отчет MFB99<br>Добавлены два новых типа комиссий<br>• 34 - списание клиринговой комиссии за проведение расчетов по итогам клиринга договоров<br>• 35 - списание биржевой комиссии за торговлю в дополнительную утреннюю сессию |
| 28.02.2020 | Отчет MFB20<br>• Для атрибута DepositaryName изменен Код депозитария, в котором открыт субсчет с RDC –РДЦ на BEB – БЭБ |
| 06.04.2020 | Отчет MFB06, MFB06C<br>• Исключены атрибуты AmountOTC и ConvertionRate<br>• Исключены дублирующиеся и опциональные атрибуты, влияющие на размер файла отчета<br>o SpecialPeriod<br>o BoardName<br>o TradePlaceName<br>o TradeModeName<br>o LicComm<br>o SubClrAccCode<br>o CCPShortName<br>o CCPDetails<br>Отчет MFB99<br>Добавлен тип поручения в атрибут OperationCode<br>36 – списание клиринговой комиссии за обработку поручений на внесение, списание и переводценных бумаг на/с Субсчета депо. |
| 09.04.2020 | Добавлен Отчет MFB06T Отчет об обязательствах, допущенных в клиринг (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг) в формате CSV |

| | |
|---|---|
| 28.08.2020 | Изменения в рамках перехода на НКО<br>- Отчет MFB76<br>  - Элемент ENTRY переименован в ASSET<br>  - Исключен атрибут ContributionShareTotal<br>  - Изменена шапка отчета<br>- Отчет MFB20<br>  - Изменена шапка отчета<br>  - Добавлены новые типы ТКС (g, e и t)<br>  - Атрибут RealAccount переименован в AccountNumber<br>  - Атрибут GuarDepUnitId переименован в DepoAccountNumber<br>  - Исключен атрибут DeliveryOnly<br>  - Добавлен элемент CLIENT для ТКС с привязкой клиентов к субсчетам<br>- Отчет MFB14<br>  - Добавлен элемент ASSET с информацией об оценочной стоимостивнесенных средств ГО и их дисконтах<br>  - Изменена шапка отчета<br>  - Добавлены атрибуты SeparateAccount и AccountMarginCall<br>- Отчет MFB99<br>  - Изменена шапка отчета<br>  - Добавлен атрибут GuaranteeFund<br>  - Добавлены новые типы операции<br>- Отчет MFB15<br>  - Расширен список типов комиссионного вознаграждения |
| 01.12.2020 | • Добавлен Отчет MFB82T в формате csv<br>• Отчет MFB82<br>  - Добавлен комментарий к описанию отчета.<br>• Отчеты MFB98 и MFB98A<br>  - Внесено изменение в описание атрибута TaxRate |
| 01.01.2021 | • Отчеты MFB98 и MFB98A<br>  - В элемент RECORDS добавлен атрибут TradeNoOtc<br>  - В элемент RECORDS добавлен атрибут TradeSpecialType<br>• Отчеты MFB06, MFB06C и MFB06T<br>  - Внесено изменение в описание атрибута SecurityType элемента SECURITY |
| 15.03.2021 | • Отчеты MFB98 и MFB98A<br>  - В элементе RECORDS изменено описание атрибута TradeSpecialType |

| | |
|---|---|
| 01.05.2021 | Отчет MFB20<br>• В атрибуте DefaultClient изменена ссылка на пункт Правил клиринга |
| 01.06.2021 | В отчеты добавлена опция многотомности при формировании<br>Отчет MFB20.<br>• Изменен список типов ТКС<br>Отчет MFB99.<br>• Изменен список типов операций |
| 06.09.2021 | В Отчет MFB82:<br>• добавляется блок с признаками, устанавливаемыми в целях установления ПАО «СПБ Биржа» ограничений возможности подачи Заявок, по поручению Клиентов в зависимости от результатов их тестирования /с признаком, устанавливаемым в целях установления ограничений НКО-ЦК «СПБ Клиринг» (АО)» на заключение Внебиржевых договоров купли-продажи ОТС по поручению клиентов Участника клиринга.<br>• в элемент RTS_DOC (Корневой элемент (root element) XML документа) добавляются новые статусы клиентов и Участников клиринга |
| 01.01.2022 | В Отчете MFB13 удален блок SETTLEDATE |
| 01.02.2022 | Отчет MFB98, MFB98A<br>• Добавлен признак CORRECTION в описание атрибута TradeSpecialType<br>Отчет MFB20<br>• Добавлены атрибуты DepoAccountCastodianCode, DepoAccountOwnerName, DepoAccountType в элемент DEPO_ACC<br>Отчет MFB21<br>• Добавлен атрибут DefaultAccount в элемент BANK_ACC |
| 01.05.2022 | Отчеты MFB99<br>• В элемент ENTRY добавлены тип поручений в атрибут OperationCode |
| 04.07.2022 | Отчеты MFB06, MFB06C и MFB06T<br>• В элемент RECORDS добавлены:<br>• атрибуты StampDuty, StampDutyPrice<br>Отчет MFB99<br>• В элемент ENTRY добавлен тип поручения в атрибут OperationCode |
| 07.09.2022 | Отчеты MFB06, MFB06C<br>• В атрибут TradePlace добавлена Торговая площадка;<br>• Добавлен атрибут TradePlaceName;<br>• В атрибут CCPCode добавлен идентификатор.<br>Отчет MFB06T<br>• В поле TradePlace добавлена Торговая площадка;<br>• Добавлено поле TradePlaceName;<br>• В поле CCPCode добавлен идентификатор<br>Отчет MFB15<br>• Изменено описание атрибута ComType<br>Отчеты MFB06, MFB06C, MFB13, MFB14, MFB15, MFB20, MFB21, MFB22, MFB23, MFB23C, MFB76, MFB82, MFB98, MFB98A, MFB99:<br>• В атрибут SENDER_ID добавлен отправитель |

| | |
|---|---|
| 06.02.2023 | Отчеты MFB06, MFB06C, MFB13, MFB14, MFB15, MFB20, MFB21, MFB22, MFB23, MFB23C, MFB76, MFB82, MFB98, MFB98A, MFB99:<br>• Изменено описание и размер поля атрибута MainFirmINN;<br>Отчеты MFB06, MFB06C:<br>• Изменено описание атрибутов и размер полей FirmINN и FirmTradeINN;<br>• Изменено описание атрибута Decimals;<br>• Добавлен новый код Организатора торговли / Торговой площадки в атрибут TradePlace;<br>• Добавлен атрибут LicComm.<br>Отчет MFB06T:<br>• Добавлен новый код Организатора торговли / Торговой площадки в поле TradePlace;<br>• Изменено описание поля Decimals;<br>• Изменено описание и размер поля FirmINN;<br>• Добавлено поле LicComm.<br>Отчет MFB20<br>• Добавлен новый Код группы счетов в Расчетном депозитарии в атрибут DepositaryName;<br>Отчет MFB99<br>• Добавлен новый Код операции в атрибут OperationCode |
| 10.03.2023 | Изменены Требования к формированию имени файлов отчетов, уведомлений, выписок, направляемых по Системе электронного документооборота. |
| 25.07.2023 | Изменено название отчета MFB82 |
| 01.09.2023 | Отчеты MFB06, MFB06C, MFB06T:<br>• Внесено уточнение в описание отчетов касательно Stamp duty;<br>• Из атрибута TradeModeId удален Идентификатор Режима торгов/ заключения внебиржевых договоров «11- Заключение Конверсионных договоров с передачей на клиринг».<br>Отчет MFB06T:<br>• Изменено описание отчета;<br>• Из поля TradeModeId удален Идентификатор Режима торгов/ заключения внебиржевых договоров «11- Заключение Конверсионных договоров с передачей на клиринг».<br>Отчет MFB15:<br>• Из атрибута FeeType удалены Признаки вида комиссии/возвратной премии «9 - комиссия за прием Поручений на клиринг внебиржевых договоров по заключенным Конверсионным договорам с уплатой в день приема поручения и «10 – комиссия за прием Поручений на клиринг внебиржевых договоров по заключенным Конверсионным договорам с уплатой в день исполнения Конверсионного договора»<br>Отчет MFB99:<br>• Из атрибута OperationCode удален Код операции с Обеспечением «26 - списание комиссии за прием Поручений на клиринг внебиржевых договоров по заключенным Конверсионным договорам». |
| 02.10.2023 | Добавлен новый отчет MFB16 |
| 04.12.2023 | Добавлен новый отчет MFB66. |
| 28.06.2024 | Отчеты MFB06, MFB06C, MFB13, MFB14, MFB15, MFB16, MFB20, MFB21, MFB22, MFB23, MFB23C, MFB66, MFB76, MFB82, MFB98, MFB98A, MFB99:<br>• Из атрибута SENDER_ID удален «MFBIK».<br>Отчеты MFB06, MFB06C: |

| | |
|---|---|
| | • Из атрибутов TradePlace и TradePlaceName удален код «2000»;<br>• Из атрибута CCPCode удален идентификатор Центрального контрагента «MFBIK».<br>Отчет MFB20:<br>• Из атрибута DepositaryName удален код Расчетного депозитария «BEBSK».<br>Отчет MFB06T:<br>• Из полей TradePlace и TradePlaceName удален код «2000»;<br>• Из поля CCPCode удален идентификатор Центрального контрагента @MFBIK». |
| 18.09.2024 | Отчет MFB06C:<br>• В элемент RECORDS добавлен атрибут ClientCode.<br><br>Отчет MFB06, MFB06C, MFB20, MFB23C, MFB82, MFBR98, MFB99:<br>• Изменен размер атрибута ClientCode. |
| 04.11.2024 | Отчеты MFB06, MFB06C, MFB13, MFB14, MFB15, MFB20, MFB21, MFB22, MFB23, MFB23C, MFB76, MFB82, MFB98, MFB98A, MFB99:<br>• Название элементов MFB06, MFB06C, MFB13, MFB14, MFB15, MFB20, MFB21, MFB22, MFB23, MFB23C, MFB76, MFB82, MFB98, MFB98A, MFB99 изменено на REPORT;<br>• Значение атрибута DOC_TYPE_ID изменено на REPORT;<br>• из элемента REPORT удален атрибут MainFirmINN;<br>• В элемент REPORT добавлены атрибуты ReportLang, ReportCode, Volume, VolumeTotal, ReportNumber.<br><br>Отчеты MFB06, MFB06C:<br>• из элемента BOARD удален атрибут BoardType;<br>• из элемента REPORT удален атрибут FirmINN;<br>• из элемента RECORDS удалены атрибуты CPFirmDetails, PaymentDetails, DeliveryDetails, VarMarginDebit, VarMarginCredit, StampDuty, StampDutyPrice;<br>• из элемента FIRM удален атрибут FirmTradeINN;<br>• в элемент BOARD добавлен атрибут BoardName;<br><br>Отчет MFB06C:<br>• В элемент RECORDS добавлен атрибут ClientCode.<br><br>Отчеты MFB06, MFB06C, MFB13, MFB15, MFB20, MFB21, MFB22, MFB23, MFB23C, MFB98, MFB98A:<br>• из элемента REPORT удален атрибут FirmName.<br><br>Отчеты MFB14, MFB82, MFB99:<br>• в элемент FIRM добавлен атрибут FirmName.<br><br>Отчет MFB66:<br>• Название элемента MFB66 изменено на REPORT;<br>• Значение атрибута DOC_TYPE_ID изменено на REPORT;<br>• из элемента REPORT удален атрибут MainFirmINN;<br>• В элемент REPORT добавлены атрибуты ReportLang, ReportCode;<br>• в элемент FIRM добавлен атрибут FirmName.<br><br>Удалены отчеты MFB06T и MFB82T в формате csv, MFB16. |

| | |
|---|---|
| | Отчеты MFB06, MFB06C:<br>Изменены размеры атрибутов SENDER_NAME, ReportDesc, MainFirmName, CurrencyId, BaseSecurityCode, ISIN, SecShortName, FaceValue, SecCurrencyId, PriceCurrencyId, TradePlaceName, SettleCode, Price, Value, Amount, ExchComm, ClrComm, LicComm, ClientDetails, CPFirmShortName, AccInt, Price2, RepoRate, FineDebit, FineCredit,<br><br>Отчет MFB13:<br>Изменены размеры атрибутов SENDER_NAME, ReportDesc, MainFirmName, BankAccCode, GuarDepUnitId, CurrencyId, CurrencyName, SecurityId, SecShortName, Shortage.<br><br>Отчет MFB14:<br>Изменены размеры атрибутов SENDER_NAME, ReportDesc, MainFirmName, CollateralCurrencyId, CollateralSum, CollateralBlocked, ISIN, AssetCollateralTotal, AssetCollateralDiscounted, AssetDiscountRate, ObligationSum, ObligTypeName,<br>TotalSum,<br><br>Отчет MFB15:<br>Изменены размеры атрибутов SENDER_NAME, ReportDesc, MainFirmName, ClrAccCode, CurrencyId, TotComm, TotVAT,<br><br>Отчет MFB20:<br>Изменены размеры атрибутов SENDER_NAME, ReportDesc, MainFirmName, ClrAccStatus, ClrAccType, DepoAccountCastodianCode, DepoAccountOwnerName, DepoAccountType, ClientIdentification.<br><br>Отчет MFB21:<br>Изменены размеры атрибутов SENDER_NAME, ReportDesc, MainFirmName, CurrencyId, CurrencyName, RecvAccount<br><br>Отчет MFB22:<br>Изменены размеры атрибутов SENDER_NAME, ReportDesc, MainFirmName, ClrAccCode, BankAccCode, CurrencyId, CurrencyName, DebtsType, DebtsSum,<br><br>Отчет MFB23:<br>Изменены размеры атрибутов SENDER_NAME, ReportDesc, MainFirmName, ClrAccCode, BankAccCode, GuarDepUnitId, DataType, CurrencyId, SecurityId, SecShortName, BaseSecurityCode, VarMarginBeg, VarMargin, DebitCorpEvCorrection, CreditCorpEvCorrection.<br><br>Отчет MFB23C:<br>Изменены размеры атрибутов SENDER_NAME, ReportDesc, MainFirmName, ClientDetails, DataType, CurrencyId, SecurityId, SecShortName, BaseSecurityCode, DebitBeg, CreditBeg, VarMarginBeg, VarMargin, DebitIntraday, CreditIntraday, DebitCorpEvCorrection, CreditCorpEvCorrection, PosExecDebit, PosExecCredit, Debit, Credit<br><br>Отчет MFB66:<br>Изменены размеры атрибутов SENDER_NAME, ReportDesc, , MainFirmName, ClrAccCode, CurrencyId, SecurityId, ISIN, SecShortName, OpeningBalance, ClosingBalance, DebitSum, CreditSum, Debit, Credit, OperationCode, DocNo, CustomerNo, Purpose.<br><br>Отчет MFB76:<br>Изменены размеры атрибутов SENDER_NAME, ReportDesc, MainFirmName, GuaranteeCurrency, GFObligation, GFContribution, |

| | |
|---|---|
| | ContributionSharePart, CurrencyId SecurityId, ContributionValue.<br><br>Отчет MFB82:<br>Изменены размеры атрибутов SENDER_NAME, ReportDesc, MainFirmName, Details, CountryCode, IdentificationCode.<br><br>Отчет MFB98:<br>Изменены размеры атрибутов SENDER_NAME, ReportDesc, MainFirmId, MainFirmName, BankAccCode, GuarDepUnitId, SecurityId, SecShortName, ISIN, Quantity, Type, NewSecurityId, NewSecShortName, NewISIN, Price, TaxRate, Sum.<br><br>Отчет MFB98A:<br>Изменены размеры атрибутов SENDER_NAME, ReportDesc, MainFirmName, BankAccCode, GuarDepUnitId, SecurityId, SecShortName, ISIN, Quantity, Type, NewSecurityId, NewSecShortName, NewISIN, CurrencyId, CurrencyName, Price, TaxRate, Sum.<br><br>Отчет MFB99:<br>Изменены размеры атрибутов SENDER_NAME, ReportDesc, MainFirmName, ClrAccCode, BankAccCode, GuarDepUnitId, CurrencyId, CurrencyName, SecurityId, SecShortName,<br><br>Удален архив клиринговых отчетов с префиксом «MFB<YYYYMMDD>_3».<br>Добавлен архив клиринговых отчетов с префиксом «MFB_REPORT_<YYYYMMDD>». |
| 01.02.2025 | Отчет MFB22:<br>• В элемент DEBTS добавлены атрибуты: FineSum, FineRate, DebtsTotal;<br>• Из элемента DEBTS удален атрибут DebtsType. |
| 07.07.2025 | Добавлены отчеты MFB07, MFB07C, MFB08, MFB08C, MFB23D, MFB24.<br><br>ОтчетMFBR15:<br>• В атрибут FeeType добавлены новые виды комиссий:<br>29 - комиссия за исполнение опциона;<br>30 - Комиссия за расчетное исполнение опциона нулевого страйка;<br>31 - Комиссия за конвертацию опциона нулевого страйка.<br><br>Отчеты MFB23:<br>• В атрибут DataType добавлены типы обязательства: VARMARGIN, EXECUTION_RESULT, PREMIUM;<br>• Из элемента RECORDS удалены атрибуты VarMarginBeg, VarMargin;<br>• Изменен размер атрибута DataType.<br><br>Отчет MFB23C:<br>• Из элемента RECORDS удалены атрибуты VarMarginBeg, VarMargin;<br>• Изменен размер атрибута DataType.<br><br>Отчет MFB99<br>• В атрибут OperationCode добавлены новые коды операций:<br>67 - Комиссия за исполнение опциона;<br>68 - Комиссия за расчетное исполнение опциона нулевого страйка; |

| | |
|---|---|
| | 69 - Комиссия за конвертацию опциона нулевого страйка.<br>70 - Комиссия за отрицательную позицию по опционам нулевого страйка<br>71 - Комиссия за Договоры ПФИ<br>72 - Комиссия за Внебиржевые договоры ОТС, предметом которых является иностранная валюта |
| 01.10.2025 | Изменены наименования отчетов: MFB06, MFB06C, MFB23, MFB23C.<br>Добавлен отчет MFB17F<br><br>Отчеты MFB08, MFB08C:<br>• Изменена обязательность заполнения элемента SETTLEDATE;<br>• Изменены размеры атрибутов: Price, FeeCurrency, ClientDetails.<br><br>Отчет MFB15:<br>• В атрибут FeeType добавлены новые виды комиссий:<br>32 - Комиссия за заключение опционного контракта<br><br>Отчеты MFB23, 23C, 23D:<br>• Изменена обязательность заполнения элементов: PosExecDebit, PosExecCredit.<br><br>Отчет MFB23:<br>• Из атрибута DataType удалены следующие типы обязательств: PREMIUM, EXECUTION_RESULT, VARMARGIN<br><br>Отчет MFB23D:<br>• Удалены атрибуты: DebitCorpEvCorrection, CreditCorpEvCorrection<br><br>Отчет MFB24:<br>• Изменен тип атрибута ExecQty.<br><br>Отчет MFB99:<br>• В атрибут OperationCode добавлены новые коды операций:<br>55 - - Клиринговый сбор за обработку поручений на перевод ценных бумаг внутри субсчета депо;<br>58 - Предоставление заемных средств (Адресное размещение)<br>59 - Возврат заемных средств (Адресное размещение)<br>60 - Комиссия за предоставление заемных средств (Адресное размещение)<br>61 - Возмещение расходов за обработку депо-поручений на ввод, вывод и перевод по субсчетам и разделам субсчетов;<br>62 - Возмещение расходов за обработку поручений на перевод ценных бумаг внутри субсчета депо;<br>63 - Возмещение расходов за инвентарные операции по субсчетам депо.<br>71 – Комиссия за заключение опционного контракта<br>74 – Комиссия за учет позиций по фьючерсным контрактам |
| 01.11.2025 | Добавлен отчет MFB18F<br><br>Отчет MFB17F:<br>• Атрибут Code изменен на FuturesCode;<br>• Атрибут Name изменен на FuturesName. |

| | |
|---|---|
| | Отчеты MFB06, MFB06C:<br>• В атрибут SecurityType добавлена новая категория ценной бумаги «111 – Цифровое свидетельство».<br><br>Отчет MFB24<br>• Изменена обязательность заполнения элементов: SettleDate, CurrencyId, CurrencyName, OptionPosStart, OptionPosEnd. |
| 01.12.2025 | Отчет MFB08, MFB08C:<br>• В атрибут InfType добавлен новый тип информации «6 – Операции по изменению позиции по фьючерсному контракту в ходе исполнения данного контракта»;<br>• В элемент FUTURES добавлен атрибут ExecutionDate;<br>• В элемент RECORDS добавлены атрибуты ValueLocalCurrency;<br>• Добавлен элемент EXECUTION |
| 25.02.2026 | Добавлены новые отчеты:<br>MFB06SD;<br>MFB66SD;<br>MFB99SD |
| 27.03.2026 | Отчет MFB08, MFB08C:<br>• В элемент FUTURES добавлены атрибуты PointRate и PointCurrency.<br><br>Отчет MFB07, MFB07C, MFB08, MFB08C:<br>• В атрибуты TradeModeId и TradeModeName добавлен режим торгов «23 – Режим торгов RFQ ПФИ».<br><br>Отчет MFB17F:<br>• В элемент CURRENCY добавлен атрибут CurrencyFundingValue;<br>• В элемент ACCOUNT добавлен атрибут AccountFundingValue;<br>• В элемент CLIENT добавлен атрибут ClientFundingValue;<br>• В элемент POSITION добавлен атрибут FundingValue, PriceCurrency, PointCurrency.<br><br>Отчет MFB18F:<br>• В элемент POSITION добавлены атрибуты PointRate, PointCurrency;<br>• Элемент VMCurrencyId изменен на PriceCurrency.<br><br>Отчет MFB99 (SD):<br>• В атрибут OperationCode добавлен новый Код операции с Обеспечением «78 - Вариационная маржа, связанная с отклонением цены фьючерсного контракта от цены базисного актива».<br><br>Переименован отчет MFB17F «Начисленная комиссия за учет позиций по фьючерсным контрактам» в «Комиссия за учет позиций по фьючерсным контрактам и Вариационная маржа, связанная с отклонением цены фьючерсного контракта от цены базисного актива». |
| 04.07.2026 | Отчет MFB17F:<br>• В элемент ACCRUALDATE добавлен атрибут SessionDate;<br>• Из элемента CURRENCY удалены атрибуты CurrencyFeeValue, CurrencyFundingValue;<br>• Из элемента ACCOUNT удалены атрибуты AccountFeeValue, AccountFundingValue,;<br>• В элементе ACCOUNT атрибут ClrAccCode меняется на PositionClrAccCode;<br>• Из элемента CLIENT удалены атрибуты ClientFeeValue, ClientFundingValue; |

| | |
|---|---|
| | • Добавлен элемент ACCRUAL;<br>• Из элемента POSITION удалены атрибуты PositionClrAccCode, FeeValue, FundingValue, FeeRate;<br>• В элемент POSITION добавлены атрибуты FeeClrAccCode, PositionType, Debit, Credit,Rate.<br>• В элементе POSITION изменилась обязательность атрибутов PositionVolume, Rate, Price , PriceCurrency, PointRate, PointCurrency |

**Форматы документов**

Обмен информацией между клиентским и серверным приложениями происходит сообщениями в формате XML версии 1.0. Полная спецификация языка XML версии 1.0 приводится вдокументе 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.

**Описание полей отчетов и XSD- схемы отчетов расположены на сайте КЦ: https://spbclearing.ru/ru/ryn_cen_bum/docs/reglament_klir_cb/**

**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 “<”, “>”, “&”, “'”, “"” 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** – чтонеобязательным. 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 |
| Bigint | Целочисленное значение с большим диапазоном |
| Boolean | Логическое значение (True или False) |
| Numeric(M,N) | Вещественное значение с фиксированной точкой. Нули после десятичной точки могут отбрасываться |
| Char | Один символ (символы кириллицы не допускаются) |
| String(M-N) | Строковое значение (символы кириллицы не допускаются)<br>M-минимально допустимое число символов. Если не указано, то поле фиксированной длиныN-максимально допустимое число символов |
| WString(M-N) | Строковое значение, включая символы кириллицы<br>M-минимально допустимое число символов. Если не указано, то поле фиксированной длиныN-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 |
| Y_N_Type | Перечислимый тип, Значения Y (yes) и N (no) |

**Документы Системы электронного документооборота в формате XML**

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

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

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

**Спецификация форм отчетов**

**MFB06(SD) Отчет об обязательствах, допущенных в клиринг, кроме обязательств по Договорам ПФИ (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг)**

Отчет MFB06 формируется по итогам клиринга по Участнику клиринга.
Отчет MFB06SD формируется по итогам клиринга по заявлению Участника клиринга, содержит информацию по ТКС, с указанием субсчета депо, открытого для данного Депозитария.
Отчет включаются в себя Договоры, заключенные в соответствующий Расчетный день.
Формируется в дополнительной рассылке с промежуточными данными на момент формирования.

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | Корневой элемент (root element) XML документа | M | |
| DOC_REQUISITES | | Блок информации о документе | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | REPORT | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB06 | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата отчета | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | String(0-16) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-120) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CURRENCY | | Блок данных по валюте расчетов | M | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты расчётов<br>Для Внебиржевого договора ОТС/Внебиржевого договора репо ОТС указывается идентификатор Валюты расчетов по итогам клиринга | M | String(0-12) |
| | CurrencyName | Наименование валюты расчётов<br>Для Внебиржевого договора ОТС/Внебиржевого договора репо ОТС указывается наименование Валюты расчетов по итогам клиринга | M | WString(0-30) |
| INFTYPE | | Блок данных по типу информации | M | |
| | InfType | Тип информации:<br>**1** – Исполненные договоры предыдущих дней;<br>**2** - Исполненные договоры текущего дня;<br>**3** - Договоры, подлежащие исполнению. | M | Integer |
| CLEARINGTYPE | | Блок данных по типу клиринга | M | |
| | ClearingType | Тип клирингового пула<br>Возможное значение:<br>C – Расчетный клиринговый пул;<br>I – Клиринговый пул по Договорам размещения и выкупа;<br>A - Клиринговый пул по Внутриброкерским Договорам;<br>D – Клиринговый пул по Договорам с полным обеспечением с ЦК и клиринговыйпул по Договорам с полным обеспечением без ЦК;<br>N – Клиринговый пул по Договорам без ЦК. | O | Char |
| SESSION | | Блок данных по клиринговой сессии | M | |
| | ClearingTime | Время формирования клирингового пула (MSK)<br>Не указывается для InfType=3 (Договоры, подлежащие исполнению) | O | Time |
| SETTLEDATE | | Блок данных по дате расчётов | M | |
| | SettleDate | Фактическая дата расчётов | M | Date |
| BOARD | | Блок данных по группе инструментов | M | |
| | BoardID | Код Группы инструментов:<br>EQR – Российские ценные бумаги<br>EQF – Иностранные ценные бумаги<br>EBOND – Еврооблигации<br>CRCY_F – Иностранная валюта<br>EQCIS- Ценные бумаги иностранных эмитентов из стран СНГ<br>OTC – Инструменты ОТС<br>OTCBOND – Инструменты ОТС (облигации) | M | String(0-16) |
| | BoardName | Наименование Группы инструментов<br>• Российские ценные бумаги<br>• Иностранные ценные бумаги<br>• Еврооблигации<br>• Иностранная валюта<br>• Ценные бумаги иностранных эмитентов из стран СНГ<br>• Инструменты ОТС<br>• Инструменты ОТС (облигации) | O | WString(0-128) |

| SECURITY | | Блок данных по инструменту | M | |
|---|---|---|---|---|
| | SecurityId | Идентификатор поставляемого актива (инструмента) | M | String(0-32) |
| | BaseSecurityCode | Код базового актива (не указывается, если совпадает с SecurityId) | O | String(0-32) |
| | ISIN | Международный идентификатор поставляемого актива (инструмента) | O | String(0-32) |
| | SecShortName | Краткое наименование поставляемого актива (инструмента) | M | WString(0-256) |
| | FaceValue | Номинал ЦБ | O | String(0-28,8) |
| | SecCurrencyId | Валюта номинала ЦБ | O | String(0-12) |
| | PriceCurrencyId | Валюта цены (котирования). | M | String(0-12) |
| | SecurityType | Категория ЦБ:<br>101 - Акции обыкновенные или REIT<br>102 - Акции привилегированные<br>103 - Паи открытого ПИФ<br>104 - Паи закрытого ПИФ<br>105 – ETF<br>106 – RDR<br>107 – ADR<br>108 – GDR<br>109 - Паи интервального ПИФ<br>110 – Ипотечные Векселя (Mortgage Notes)<br>111 Цифровые свидетельства<br>201 - Государственные Облигации<br>202 - Муниципальные Облигации<br>203 – Облигации Центрального Банка<br>204 - Корпоративные Облигации<br>205 – Облигации Кредитной Организации<br>206 – Биржевые Облигации | O | Integer |
| | PriceType | Тип цены:<br>PERC - процент от номинальной стоимости<br>CASH – в валюте цены | M | String(0-4) |
| RECORDS | | Блок данных по договору | M | |
| | RecNo | Номер по порядку | M | Integer |
| | TradeNo | Номер договора | M | Integer |
| | TradeNoExtra | Дополнительный номер договора | O | Integer |
| | TradeDate | Дата заключения договора | M | Date |
| | TradeTime | Время регистрации договора в Системе торгов/Системе, время приема поручений на клиринг внебиржевых договоров (MSK) | M | Time |
| | PrimaryOrderID | Номер заявки/ номер Оферты OTC | O | Integer |
| | OrderID | Дополнительный идентификатор Системы/Системы проведения торгов | O | Integer |
| | Comment | Комментарий | O | WString(0-64) |
| | TradePlace | Код Организатора торговли, зарегистрировавшего договор<br>Возможные значения<br>• 1000 – ПАО «СПБ Биржа». | O | Integer |
| | TradePlaceName | Идентификатор Организатора торговли, зарегистрировавшего договор.<br>Возможные значения: | O | WString(0-256) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | • SPBXM - ПАО «СПБ Биржа». | | |
| | BuySell | Направленность заявки/ Оферты ОТС (покупка (**B**) / продажа (**S**)) | M | Char |
| | SettleCode | Код расчётов по договору | O | String(0-16) |
| | TradePeriod | Период заключения Биржевых договоров:<br>1 – Основная торговая сессия<br>2 – Дополнительная торговая сессия<br>3 – Дополнительная утренняя торговая сессия.<br>Не указывается для внебиржевых договоров | O | Integer |
| | TradeType | Тип договора:<br>**T** – заключен на основании безадресной заявки;<br>**N** – заключен на основании адресной заявки;<br>**D** – заключен без подачи заявки;<br>**O** – внебиржевой договор, заключенный на основании Оферты ОТС тип 1<br>**P** – внебиржевой договор, заключенный на основании Оферты ОТС тип 2 | O | Char |
| | TradeModeId | Идентификатор Режима торгов/ заключения внебиржевых договоров<br>1. - Режим основных торгов<br>2. - Режим переговорных сделок<br>3. - Режим торгов адресное репо<br>4. - Режим торгов Аукцион размещения<br>5. - Режим торгов Адресное размещение<br>6. - Режим торгов Аукцион по выкупу<br>7.- Режим торгов Адресный выкуп<br>8.- Режим торгов РПС без ЦК<br>9. - Режим торгов адресное репо без ЦК<br>10. -Режим торгов RFQ<br>12. - Режим торгов анонимное репо<br>13. – Заключение Внебиржевых договоров с передачей на клиринг<br>14. – Заключение Внебиржевых договоров ОТС/ Внебиржевых договоров репо ОТС | M | Integer |
| | TradeInstrumentType | Тип инструмента<br>1 – фьючерсные инструменты<br>2 – опционы<br>3 – инструменты с частичным обеспечением<br>4– репо<br>5– связанные сделки купли-продажи<br>6 – договор валютный своп (swap)<br>9 - инструменты с полным обеспечением | M | Integer |
| | Decimals | Число значимых знаков после запятой в ценах. Для сделок РЕПО данный показатель показывает точность ставки РЕПО. Число знаков в цене первой и второй частей РЕПО равно 8 знаков. | O | Integer |
| | Price | Цена за единицу инструмента | M | Numeric(28,8) |
| | Quantity | Объём договора, в лотах/инструментах | M | Numeric(28,8) |
| | Value | Объём договора, в валюте цены | M | Numeric(28,8) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | Amount | Обязательство по денежным средствам, в валюте расчетов.<br>Для Внебиржевых договоров OTC/ Внебиржевых договоров репо OTC указывается объем денежных средств в Валюте расчетов по итогам клиринга, подлежащий отражению во внутреннем учете Участника клиринга в качестве обязательства по договору, расчеты по которому будут производиться по итогам клиринга | M | Numeric(28,8) |
| | Balance | Обязательство по ценным бумагам | M | Numeric(28,8) |
| | CorpEvent | Проведение корпоративного события:<br>**S** – дробление<br>**RS** – консолидация<br>**D –** выплата дивидендов<br>**SO** – выделение<br>**N** – выплата купона<br>**M** – слияние и поглощение | O | Char |
| | ExchComm | Комиссионное вознаграждение за организацию торгов Торговый сбор в валюте расчетов<br>(заполняется только для договоров, заключенных в дату формирования отчета) | O | Numeric(28,8) |
| | ClrComm | Клиринговая комиссия в валюте расчетов (заполняется только для договоров, заключенных в дату формирования отчета) | O | Numeric(28,8) |
| | LicComm | Технологический сбор | O | Numeric(28,8) |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-12) |
| | ClientDetails | Идентификационные данные клиента | O | WString(0-256) |
| | CCPCode | Идентификатор Центрального контрагента<br>Если атрибут не указан, то договор заключен без Центрального Контрагента<br>Возможные значения<br>• MFBIM - **НКО-ЦК «СПБ Клиринг» (АО)**» | O | String(0-16) |
| | CPFirmId | Идентификатор контрагента (только для адресных договоров) | O | String(0-16) |
| | CPFirmShortName | Краткое наименование контрагента (только для адресных договоров) | O | WString(0-512) |
| | ClientCode | Краткий код клиента Участника клиринга или Субклиента | O | WString(0-12) |
| | DueDate | Дата исполнения | M | Date |
| | AccInt | Накопленный купонный доход, рассчитанный в соответствии с количеством актива данного договора, в валюте расчётов | O | Numeric(28,8) |
| | Price2 | Цена второй части РЕПО* | O | Numeric(28,8) |
| | RepoPart | Часть РЕПО<br>**1** – первая часть договора РЕПО<br>**2** – вторая часть договора РЕПО | O | Integer |
| | RepoPeriod | Срок РЕПО в календарных днях | O | Integer |
| | RepoRate | Ставка РЕПО в % | O | Numeric(28,8) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | Type | Тип договора, заключенной в целях урегулирования возможного неисполнения обязательств и в целях исполнения обязательств по договорам:<br>**1** – договор репо в случае неисполнения обязательств Участником клиринга;<br>**2** – договор купли-продажи в случае неисполнения обязательств Участникомклиринга;<br>**3** - договор репо в случае неисполнения обязательств КЦ;<br>**4** – договор купли-продажи в случае неисполнения обязательств КЦ;<br>**5** – договор репо, заключенный КЦ с целью привлечения активов для урегулирования неисполнения обязательств;<br>**6** – договор купли-продажи, заключенный КЦ с целью принудительного закрытия позиции Участника клиринга;<br>**7** – договор купли-продажи, заключенный в целях исполнения обязательств(договор, заключаемый в целях переноса позиции на другого организатора торгов);<br>**8** – договор, заключенный в целях закрытия позиции в результате исполнения поставочного/расчетного фьючерсного контракта;<br>**9** – договор, заключенный в результате исполнения опционного контракта | O | Integer |
| | FineDebit | Сумма штрафа удержанная, в валюте расчетов | O | Numeric(28,8) |
| | FineCredit | Сумма штрафа начисленная, в валюте расчетов | O | Numeric(28,8) |
| | RepositoryNumber | Номер, присвоенный Внебиржевому договору репо ОТС Репозитарием | O | String(0-64) |
| /RECORDS | | | M | |
| /SECURITY | | | M | |
| /BOARD | | | M | |
| /SETTLEDATE | | | M | |
| /SESSION | | | M | |
| /CLEARINGTYPE | | | M | |
| /INFTYPE | | | M | |
| /CURRENCY | | | M | |
| /FIRM | | | M | |
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

*Цена второй части Договора репо с ценными бумагами, за исключением Договора репо, предметом которого является облигация, рассчитывается по следующей формуле:Price2=Округл (Округл (Price * Balance * (1+ RepoRate * ( ) / 100); 2) / Balance; Decimals), где:

Price – цена первой части Договора репо;
Balance - объём обязательства по Договору репо, в штуках;
RepoRate – ставка репо в %;
T365 – количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо, приходящихся на календарный год,состоящий из 365 дней;
T366 - количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо, приходящихся на календарный год,состоящий из 366 дней;
Decimals - число значимых знаков после запятой в ценах. Для сделок РЕПО данный показатель показывает точность ставки РЕПО. Число знаков в цене первой и второй частей РЕПО равно 8 знаков.

Цена второй части Договора репо, предметом которого является облигация, рассчитывается по следующей формуле:
Price2= Округл (((BuybackVolume – ACY 2* Balance)/ Balance)/FaceValue * 100; Decimals), где:
BuybackVolume =Округл (Округл ((Price/100) * FaceValue * Balance + ACY1* Balance) * (1+ RepoRate * ( ) / 100); 2) / Balance;Decimals)

Price – цена первой части Договора репо, в % от номинала;
Balance - объём обязательства по Договору репо, в
штуках;RepoRate – ставка репо, в %;
T365 – количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо, приходящихся на календарный год,состоящий из 365 дней;
T366 - количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо, приходящихся на календарный год,состоящий из 366 дней;
ACY1 – накопленный купонный доход по ЦБ на дату исполнения первой части Договора репо;
ACY 2 – накопленный купонный доход по ЦБ на дату исполнения второй части Договора репо;FaceValue – номинальная стоимость облигации;
Decimals - число значимых знаков после запятой в ценах. Для сделок РЕПО данный показатель показывает точность ставки РЕПО. Число знаков в цене первой и второй частей РЕПО равно 8 знаков.

**MFB06C Отчет об обязательствах, допущенных в клиринг, кроме обязательств по Договорам ПФИ (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга)**

Отчет формируется в разрезе клиентов Участника клиринга.
Отчет формируется по итогам клиринга.
Отчет включаются в себя Договоры, заключенные в соответствующий Расчетный день.
Формируется в дополнительной рассылке с промежуточными данными на момент формирования.

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | Корневой элемент (root element) XML документа | M | |
| DOC_REQUISITES | | Блок информации о документе | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного Документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | REPORT | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB06C | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата отчета | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | String(0-16) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| CLIENT | | | M | |
| | ClientCode | Краткий код клиента  Участника клиринга или Субклиента | M | WString(0-12) |
| | ClientDetails | Идентификационные данные клиента | M | WString(0-256) |
| CURRENCY | | Блок данных по валюте расчетов | M | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | CurrencyId | Идентификатор валюты расчётов<br>Для Внебиржевого договора ОТС/Внебиржевого договора репо ОТС указывается идентификатор Валюты расчетов по итогам клиринга | M | String(0-12) |
| | CurrencyName | Наименование валюты расчётов<br>Для Внебиржевого договора ОТС/Внебиржевого договора репо ОТС указывается наименование Валюты расчетов по итогам клиринга | M | WString(0-30) |
| INFTYPE | | Блок данных по типу информации | M | |
| | InfType | Тип информации:<br>**1** Исполненные договоры предыдущих дней;<br>**2** Исполненные договоры текущего дня;<br>**3** Договоры, подлежащие исполнению | M | Integer |
| CLEARINGTYPE | | Блок данных по типу клиринга | M | |
| | ClearingType | Тип клирингового пула<br>Возможное значение:<br>C - Расчетно-клиринговый пул;<br>I – Клиринговый пул по договорам размещения/выкупа;<br>A - Клиринговый пул по Внутриброкерским договорам;<br>D – Клиринговый пул по договорам с полным обеспечением;<br>N – Клиринговый пул по договорам без ЦК. | O | Char |
| SESSION | | Блок данных по клиринговой сессии | M | |
| | ClearingTime | Время формирования клирингового пула (MSK)<br>Не указывается для InfType=3 (договоры, подлежащие исполнению) | O | Time |
| SETTLEDATE | | Блок данных по дате расчётов | M | |
| | SettleDate | Фактическая дата расчётов | M | Date |
| BOARD | | Блок данных по группе инструментов | M | |
| | BoardID | Код Группы инструментов:<br>EQR – Российские ценные бумаги<br>EQF – Иностранные ценные бумаги<br>EBOND – Еврооблигации<br>CRCY_F – Иностранная валюта<br>EQCIS- Ценные бумаги иностранных эмитентов из стран СНГ<br>OTC – Инструменты ОТС<br>OTCBOND – Инструменты ОТС (облигации) | M | String(0-16) |
| | BoardName | Наименование Группы инструментов:<br>• Российские ценные бумаги<br>• Иностранные ценные бумаги<br>• Еврооблигации<br>• Иностранная валюта<br>• Ценные бумаги иностранных эмитентов из стран СНГ<br>• Инструменты ОТС<br>• Инструменты ОТС (облигации) | O | WString(0-128) |
| SECURITY | | Блок данных по инструменту | M | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | SecurityId | Идентификатор поставляемого актива (инструмента) | M | String(0-32) |
| | BaseSecurityCode | Код базового актива (не указывается, если совпадает с SecurityId) | O | String(0-32) |
| | ISIN | Международный идентификатор поставляемого актива (инструмента) | O | String(0-32) |
| | SecShortName | Краткое наименование поставляемого актива (инструмента) | M | WString(0-256) |
| | FaceValue | Номинал ЦБ | O | Numeric(28,8) |
| | SecCurrencyId | Валюта номинала ЦБ | O | String(0-12) |
| | PriceCurrencyId | Валюта цены (котирования). Не указывается для облигаций; не указывается, если валюта цены и валюта расчетов совпадают | O | String(0-12) |
| | SecurityType | Категория ЦБ:<br>101 - Акции обыкновенные или REIT<br>102 - Акции привилегированные<br>103 – Паи открытого ПИФ<br>104 – Паи закрытого ПИФ<br>105 – ETF<br>106 – RDR<br>107 – ADR<br>108 – GDR<br>109 – Паи интервального ПИФ<br>110 – Ипотечные векселя (Mortgage Notes)<br>111 – Цифровые свидетельства<br>201 - Государственные Облигации<br>202 - Муниципальные Облигации<br>203 – Облигации Центрального Банка<br>204 - Корпоративные Облигации<br>205 – Облигации Кредитной Организации<br>206 – Биржевые Облигации | O | Integer |
| | PriceType | Тип цены:<br>PERC - процент от номинала<br>CASH – в валюте | M | String(0-4) |
| RECORDS | | Блок данных по договору | M | |
| | RecNo | Номер по порядку | M | Integer |
| | TradeNo | Номер договора | M | Integer |
| | TradeNoExtra | Дополнительный номер договора | O | Integer |
| | TradeDate | Дата заключения договора | M | Date |
| | TradeTime | Время регистрации договора в Системе торгов/Системе, время приема поручения на клиринг внебиржевых договоров (MSK) | M | Time |
| | PrimaryOrderID | Номер заявки/ номер Оферты OTC | O | Integer |
| | OrderID | Дополнительный идентификатор Системы/Системы проведения торгов | O | Integer |
| | Comment | Комментарий | O | WString(0-64) |
| | TradePlace | Код Организатора торгов, зарегистрировавшего договор<br>Возможные значения<br>• 1000 – ПАО «СПБ Биржа» | O | Integer |
| | TradePlaceName | Идентификатор Организатора торговли, зарегистрировавшего договор.<br>Возможные значения: | O | WString(0-256) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | • SPBXM - ПАО «СПБ Биржа» | | |
| | BuySell | Направленность заявки/ Оферты ОТС (покупка (**B**) / продажа (**S**)) | M | Char |
| | SettleCode | Код расчётов по договору | O | String(0-16) |
| | TradePeriod | Период заключения биржевых договоров:<br>1 - Основная торговая сессия<br>2 - Дополнительная вечерняя торговая сессия<br>3 - Дополнительная утренняя торговая сессия. Не указывается для внебиржевых договоров | O | Integer |
| | TradeType | Тип договора:<br>**T** – заключен на основании безадресной заявки;<br>**N** – заключен на основании адресной заявки;<br>**D** – заключен без подачи заявки;<br>**O** – внебиржевой договор, заключенный на основании Оферты ОТС тип 1<br>**P** – внебиржевой договор, заключенный на основании Оферты ОТС тип 2 | O | Char |
| | TradeModeId | Идентификатор Режима торгов/ заключения внебиржевых договоров<br>1 - Режим основных торгов<br>2 - Режим переговорных сделок<br>3 - Режим торгов адресное репо<br>4 - Режим торгов Аукцион размещения<br>5 - Режим торгов Адресное размещение<br>6 - Режим торгов Аукцион по выкупу<br>7 - Режим торгов Адресный выкуп<br>8 - Режим торгов РПС без ЦК<br>9 - Режим торгов адресное репо без ЦК<br>10 -Режим торгов RFQ<br>12 - Режим торгов анонимное репо<br>13 – Заключение Внебиржевых договоров с передачей на клиринг<br>14 – Заключение Внебиржевых договоров ОТС/ Внебиржевых договоров репо ОТС | M | Integer |
| | TradeInstrumentType | Тип торгового инструмента<br>1 – фьючерсные инструменты<br>2 – опционы<br>3 - инструменты с частичным обеспечением<br>4 – репо<br>5 – связанные сделки купли-продажи<br>6 – договор валютный своп (swap)<br>9 - инструменты с полным обеспечением | M | Integer |
| | Decimals | Число значимых знаков после запятой в ценах. Для сделок РЕПО данный показатель показывает точность ставки РЕПО. Число знаков в цене первой и второй частей РЕПО равно 8 знаков. | O | Integer |
| | Price | Цена за единицу инструмента | M | Numeric(28,8) |
| | Quantity | Объём договора, в инструментах | M | Numeric(28,8) |
| | Value | Объём договора, в валюте расчётов | M | Numeric(28,8) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | Amount | Обязательство по денежным средствам, в валюте расчетов.<br>Для неисполненных Внебиржевых договоров ОТС/ Внебиржевых договоров репо ОТС представлена предварительная оценка обязательства по текущему Курсу | M | Numeric(28,8) |
| | Balance | Обязательство по ценным бумагам | M | Numeric(28,8) |
| | CorpEvent | Проведение корпоративного события:<br>**S** – дробление<br>**RS** – консолидация<br>**SO** – выделение<br>**D –** выплата дивидендов<br>**N** – выплата купона<br>**M** – слияние и поглощение | O | Char |
| | ExchComm | Комиссионное вознаграждение за организацию торгов Торговый сбор валюте расчетов<br>(заполняется только для договоров, заключенных в дату формирования отчета) | O | Numeric(28,8) |
| | ClrComm | Клиринговая комиссия в валюте расчетов (заполняется только для договоров, заключенных в дату формирования отчета) | O | Numeric(28,8) |
| | LicComm | Лицензионное вознаграждение в валюте расчетов (заполняется только для договоров, заключенных в дату формирования отчета). | O | Numeric(28,8) |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-12) |
| | SubClrAccCode | Код Аналитического ТКС | O | String(0-16) |
| | CCPCode | Идентификатор Центрального контрагента<br>Если атрибут не указан, то договор заключен без Центрального Контрагента<br>Возможные значения<br>MFBIM – НКО-ЦК «СПБ Клиринг » (АО) ИНН 7713387530 | O | String(0-16) |
| | CPFirmId | Идентификатор контрагента | O | String(0-16) |
| | CPFirmShortName | Краткое наименование контрагента | O | WString(0-512) |
| | ClientCode | Краткий код клиента Участника клиринга или Субклиента | M | WString(0-12) |
| | DueDate | Дата исполнения | M | Date |
| | AccInt | Накопленный купонный доход, рассчитанный в соответствии с количеством актива данного договора, в валюте расчётов | O | Numeric(28,8) |
| | Price2 | Цена второй части РЕПО | O | Numeric(28,8) |
| | RepoPart | Часть РЕПО<br>**1** – первая часть договора РЕПО<br>**2** – вторая часть договора РЕПО | O | Integer |
| | RepoPeriod | Срок РЕПО в календарных днях | O | Integer |
| | RepoRate | Ставка РЕПО в % | O | Numeric(28,8) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | Type | Тип договора, заключенного в целях урегулирования возможного неисполнения обязательств по договорам с частичным обеспечением:<br>**1** – договор репо в случае неисполнения обязательств Участником клиринга;<br>**2** – договор купли-продажи в случае неисполнения обязательств Участником клиринга;<br>**3** - договор репо в случае неисполнения обязательств КЦ;<br>**4** – договор купли-продажи в случае неисполнения обязательств КЦ;<br>**5** – договор репо, заключенный КЦ с целью привлечения активов для урегулирования неисполнения обязательств;<br>**6** – договор купли-продажи, заключенный КЦ с целью принудительного закрытия позиции Участника клиринга;<br>**7** – договор купли-продажи, заключенный в целях исполнения обязательств (договор, заключаемый в целях переноса позиции на другого организатора торгов);<br>**8** – договор, заключенный в целях закрытия позиции в результате исполнения поставочного/расчетного фьючерсного контракта;<br>**9** – договор, заключенный в результате исполнения опционного контракта | O | Integer |
| | FineDebit | Сумма штрафа удержанная, в валюте расчетов | O | Numeric(28,8) |
| | FineCredit | Сумма штрафа начисленная, в валюте расчетов | O | Numeric(28,8) |
| | RepositoryNumber | Номер, присвоенный Внебиржевому договору репо ОТС Репозитарием | O | String(0-64) |
| /RECORDS | | | M | |
| /SECURITY | | | M | |
| /BOARD | | | M | |
| /SETTLEDATE | | | M | |
| /SESSION | | | M | |
| /CLEARINGTYPE | | | M | |
| /INFTYPE | | | M | |
| /CURRENCY | | | M | |
| /CLIENT | | | M | |
| /FIRM | | | M | |
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

**MFB07 Отчет об обязательствах по Договорам ПФИ (Опционы), допущенных в клиринг (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг)**
Отчет по Участнику клиринга.
Формируется по итогам клиринга.
Формируется в дополнительной рассылке с промежуточными данными на момент формирования.

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | Корневой элемент (root element) XML документа | M | |
| DOC_REQUISITES | | Блок информации о документе | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | REPORT | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB07 | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата отчета | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | String(0-16) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-512) |
| CURRENCY | | Блок данных по валюте премии | M | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты премии | M | String(0-12) |
| | CurrencyName | Наименование валюты премии | M | WString(0-30) |
| INFTYPE | | Блок данных по типу информации | M | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | InfType | Тип информации:<br>1 – Исполненные договоры предыдущих дней;<br>2 – Исполненные договоры текущего дня;<br>3 -Договоры, подлежащие исполнению. | M | Integer |
| CLEARINGTYPE | | Блок данных по клиринговому пулу | M | |
| | ClearingType | Тип клирингового пула:<br>C – Расчетный клиринговый пул. | M | Char |
| SESSION | | Блок данных по клиринговой сессии | M | |
| | ClearingTime | Время формирования клирингового пула (MSK)<br>Не указывается для InfType=3 (Договоры, подлежащие исполнению) | O | Time |
| SETTLEDATE | | Блок данных по дате расчётов по премии | M | |
| | SettleDate | Фактическая дата расчётов по премии | M | Date |
| BOARD | | Блок данных по группе инструментов | M | |
| | BoardId | Код Группы инструментов:<br>OPTION – опционы | M | String(0-16) |
| | BoardName | Наименование Группы инструментов<br>• Опционы | O | WString(0-128) |
| BASEASSETTYPE | | Блок данных по типу (категории) базисного актива | | |
| | BaseAssetType | Тип базисного актива<br>• CURRENCY - валюта<br>• SHARES - акции и депозитарные расписки<br>• FUTURES - фьючерс<br>• BOND - облигации | M | WString(0-32) |
| BASEASSET | | Блок данных по базисному активу | | |
| | BaseAssetDetailsType | Тип идентификатора базисного актива:<br>ISIN – для ценных бумаг;<br>SYMBOL – для всех остальных типов базисного актива. | O | WString(0-32) |
| | BaseAssetDetails | Идентификатор базисного актива | O | WString(0-64) |
| | BaseAssetCode | Код базисного актива | M | WString(0-20) |
| | BaseAssetName | Наименование базисного актива | O | WString(0-120) |
| | BaseAssetSection | Группа инструментов, к которым относится базисный актив | O | WString(0-20) |
| CONTRACT | | Блок данных по Договору ПФИ | M | |
| | ExecutionType | Стиль исполнения опциона (американский / европейский):<br><br>«E» – европейский опцион<br>«A» – американский опцион | O | Char |
| | MarginType | Признак способа учета премии по опциону: | O | Char |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | P - премиальный;<br>M - маржируемый. | | |
| | DeliveryType | Тип исполнения договора ПФИ:<br><br>S – расчетный<br>D - поставочный | M | Char |
| | Lot | Количество единиц базисного актива | M | Numeric(28,8) |
| OPTIONSERIES | | Блок данных по опционной серии | | |
| | TradeDateStart | Дата начала обращения опциона | O | Date |
| | TradeDateEnd | Последний торговый день, в который может быть заключен опционный контракт (день, месяц, год) | O | Date |
| | ExpirationDate | Дата экспирации опциона | O | Date |
| OPTION | | Блок данных по опциону | M | |
| | OptionCode | Код опциона | M | String(0-12) |
| | OptionName | Наименование опциона | M | WString(0-120) |
| | OptionType | Тип опциона (call / put):<br><br>P – PUT<br>C – CALL | M | Char |
| | Strike | Цена страйк опциона, в Валюте цены Опциона | O | Numeric(28,8) |
| | IsCentralStrike | Признак центрального страйка:<br><br>N – не центральный страйк<br>Y – центральный страйк | M | Char |
| RECORDS | | Блок данных по договору ПФИ | M | |
| | RecNo | Номер по порядку | M | Integer |
| | TradeNo | Номер договора | M | Integer |
| | TradeDate | Дата заключения договора | M | Date |
| | TradeTime | Время регистрации договора в Системе торгов (MSK) | M | Time |
| | TradePlace | Код Организатора торговли, зарегистрировавшего договор<br>Возможные значения<br>• 1000 – ПАО «СПБ Биржа». | O | Integer |
| | TradePlaceName | Идентификатор Организатора торговли, зарегистрировавшего договор.<br>Возможные значения:<br>• SPBXM - ПАО «СПБ Биржа». | O | WString(0-64) |
| | BuySell | Направленность заявки (покупка (**B**) / продажа (**S**)) | M | Char |
| | SettleCode | Код расчётов по премии | O | String(0-12) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | TradeType | Тип договора:<br>**T** – заключен на основании безадресной заявки;<br>**N** – заключен на основании адресной заявки;<br>**D** – заключен без подачи заявки; | O | Char |
| | TradeModeId | Идентификатор Режима торгов:<br><br>21 – Режим основных торгов ПФИ<br>22 – Режим переговорных сделок ПФИ<br>23 – Режим торгов RFQ ПФИ | O | Integer |
| | TradeModeName | Наименование Режима торгов:<br><br>• Режим основных торгов ПФИ<br>• Режим переговорных сделок ПФИ<br>• Режим торгов RFQ ПФИ | M | WString(0-64) |
| | Decimals | Число значимых знаков после запятой в ценах. | O | Integer |
| | Price | Цена опциона / Премия по опциону ( в пунктах / в Валюте цены опциона) | M | Numeric(20,6) |
| | Quantity | Объём договора, в лотах | M | Numeric(28,8) |
| | Value | Объём договора, в Валюте расчета | M | Numeric(20,2) |
| | Amount | Обязательство / Требование по премии, в Валюте расчета | O | Numeric(20,2) |
| | Balance | Обязательство по опционам, в штуках | M | Numeric(28,8) |
| | ExchComm | Биржевая комиссия за договор, в Валюте расчета | O | Numeric(20,2) |
| | ClrComm | Клиринговая комиссия за договор, в Валюте расчета | O | Numeric(20,2) |
| | LicComm | Техническая комиссия, в Валюте расчета | O | Numeric(20,2) |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-12) |
| | ClientDetails | Идентификационные данные клиента | O | WString(0-256) |
| | CCPCode | Идентификатор Центрального контрагента<br><br>• **MFBIM -** НКО-ЦК «СПБ Клиринг» (АО)» | O | String(0-16) |
| | CPFirmId | Идентификатор контрагента (только для адресных договоров) | O | String(0-16) |
| | CPFirmShortName | Краткое наименование контрагента (только для адресных договоров) | O | WString(0-32) |
| | ClientCode | Краткий код клиента Участника клиринга или Субклиента | O | WString(0-12) |
| | DueDate | Дата расчета по премии | M | Date |
| | VarMarginDebit | Вариационная маржа списанная | O | Numeric(20,2) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | VarMarginCredit | Вариационная маржа зачисленная | O | Numeric(20,2) |
| /RECORDS | | | M | |
| /OPTION | | | M | |
| /OPTIONSERIES | | | M | |
| /CONTRACT | | | M | |
| /BASEASSET | | | M | |
| /BASEASSETTYPE | | | M | |
| /BOARD | | | M | |
| /SETTLEDATE | | | M | |
| /SESSION | | | M | |
| /CLEARINGTYPE | | | M | |
| /INFTYPE | | | M | |
| /CURRENCY | | | M | |
| /FIRM | | | M | |
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

**MFB07C Отчет об обязательствах по Договорам ПФИ (Опционы), допущенных в клиринг (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг, по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга)**
Формируется по итогам клиринга.
Формируется в дополнительной рассылке с промежуточными данными на момент формирования.

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | Корневой элемент (root element) XML документа | M | |
| DOC_REQUISITES | | Блок информации о документе | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | REPORT | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB07 | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата отчета | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | String(0-16) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-512) |
| CLIENT | | Блок данных по клиенту | | |
| | ClientCode | Краткий код клиента  Участника клиринга или Субклиента | M | String(0-16) |
| | ClientDetails | Идентификационные данные клиента | M | WString(0-512) |
| CURRENCY | | Блок данных по валюте премии | M | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты премии | M | String(0-12) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | CurrencyName | Наименование валюты премии | M | WString(0-30) |
| INFTYPE | | Блок данных по типу информации | M | |
| | InfType | Тип информации:<br>1 – Исполненные договоры предыдущих дней;<br>2 – Исполненные договоры текущего дня;<br>3 -Договоры, подлежащие исполнению. | M | Integer |
| CLEARINGTYPE | | Блок данных по клиринговому пулу | M | |
| | ClearingType | Тип клирингового пула:<br><br>C – Расчетный клиринговый пул; | M | Char |
| SESSION | | Блок данных по клиринговой сессии | M | |
| | ClearingTime | Время формирования клирингового пула (MSK)<br>Не указывается для InfType=3 (Договоры, подлежащие исполнению) | O | Time |
| SETTLEDATE | | Блок данных по дате расчётов по премии | M | |
| | SettleDate | Фактическая дата расчётов по премии | M | Date |
| BOARD | | Блок данных по группе инструментов | M | |
| | BoardId | Код Группы инструментов:<br>OPTION – опционы | M | String(0-16) |
| | BoardName | Наименование Группы инструментов<br>• Опционы | O | WString(0-128) |
| BASEASSETTYPE | | Блок данных по типу (категории) базисного актива | | |
| | BaseAssetType | Тип базисного актива<br>• CURRENCY - валюта<br>• SHARES - акции и депозитарные расписки<br>• FUTURES - фьючерс<br>• BOND - облигации | M | WString(0-32) |
| BASEASSET | | Блок данных по базисному активу | | |
| | BaseAssetDetailsType | Тип идентификатора базисного актива:<br>ISIN – для ценных бумаг;<br>SYMBOL – для всех остальных типов базисного актива. | O | WString(0-32) |
| | BaseAssetDetails | Идентификатор базисного актива | O | WString(0-64) |
| | BaseAssetCode | Код базисного актива | M | WString(0-20) |
| | BaseAssetName | Наименование базисного актива | O | WString(0-120) |
| | BaseAssetSection | Группа инструментов, к которым относится базисный актив | O | WString(0-20) |
| CONTRACT | | Блок данных по Договору ПФИ | M | |
| | ExecutionType | Стиль исполнения опциона (американский / европейский): | O | Char |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | «E» – европейский опцион<br>«A» – американский опцион | | |
| | MarginType | Признак способа учета премии по опциону:<br><br>P - премиальный;<br>M - маржируемый. | O | Char |
| | DeliveryType | Тип исполнения договора ПФИ:<br><br>S – расчетный<br>D - поставочный | M | Char |
| | Lot | Количество единиц базисного актива | M | Numeric(28,8) |
| OPTIONSERIES | | Блок данных по опционной серии | | |
| | TradeDateStart | Дата начала обращения опциона | O | Date |
| | TradeDateEnd | Последний торговый день, в который может быть заключен опционный контракт (день, месяц, год) | O | Date |
| | ExpirationDate | Дата экспирации опциона | O | Date |
| OPTION | | Блок данных по опциону | M | |
| | OptionCode | Код опциона | M | String(0-12) |
| | OptionName | Наименование опциона | M | WString(0-120) |
| | OptionType | Тип опциона (call / put):<br><br>P – PUT<br>C – CALL | M | Char |
| | Strike | Цена страйк опциона, в Валюте цены Опциона | O | Numeric(28,8) |
| | IsCentralStrike | Признак центрального страйка:<br><br>N – не центральный страйк<br>Y – центральный страйк | M | Char |
| RECORDS | | Блок данных по договору ПФИ | M | |
| | RecNo | Номер по порядку | M | Integer |
| | TradeNo | Номер договора | M | Integer |
| | TradeDate | Дата заключения договора | M | Date |
| | TradeTime | Время регистрации договора в Системе торгов (MSK) | M | Time |
| | TradePlace | Код Организатора торговли, зарегистрировавшего договор<br>Возможные значения<br>• 1000 – ПАО «СПБ Биржа». | O | Integer |
| | TradePlaceName | Идентификатор Организатора торговли, зарегистрировавшего договор. | O | WString(0-64) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | Возможные значения:<br>• SPBXM - ПАО «СПБ Биржа». | | |
| | BuySell | Направленность заявки (покупка (**B**) / продажа (**S**)) | M | Char |
| | SettleCode | Код расчётов по премии | O | String(0-12) |
| | TradeType | Тип договора:<br>**T** – заключен на основании безадресной заявки;<br>**N** – заключен на основании адресной заявки;<br>**D** – заключен без подачи заявки; | O | Char |
| | TradeModeId | Идентификатор Режима торгов:<br><br>21 – Режим основных торгов ПФИ<br>22 – Режим переговорных сделок ПФИ<br>23 – Режим торгов RFQ ПФИ | O | Integer |
| | TradeModeName | Наименование Режима торгов:<br><br>• Режим основных торгов ПФИ<br>• Режим переговорных сделок ПФИ<br>• Режим торгов RFQ ПФИ | M | WString(0-64) |
| | Decimals | Число значимых знаков после запятой в ценах. | O | Integer |
| | Price | Цена опциона / Премия по опциону (в пунктах / в Валюте цены опциона) | M | Numeric(20,6) |
| | Quantity | Объём договора, в лотах | M | Numeric(28,8) |
| | Value | Объём договора, в Валюте расчета | M | Numeric(20,2) |
| | Amount | Обязательство / Требование по премии, в Валюте расчета | O | Numeric(20,2) |
| | Balance | Обязательство по опционам, в штуках | M | Numeric(28,8) |
| | ExchComm | Биржевая комиссия за договор, в Валюте расчета | O | Numeric(20,2) |
| | ClrComm | Клиринговая комиссия за договор, в Валюте расчета | O | Numeric(20,2) |
| | LicComm | Техническая комиссия, в Валюте расчета | O | Numeric(20,2) |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-12) |
| | ClientDetails | Идентификационные данные клиента | O | WString(0-256) |
| | CCPCode | Идентификатор Центрального контрагента<br><br>• **MFBIM -** НКО-ЦК «СПБ Клиринг» (АО)» | O | String(0-16) |
| | CPFirmId | Идентификатор контрагента (только для адресных договоров) | O | String(0-16) |
| | CPFirmShortName | Краткое наименование контрагента (только для адресных договоров) | O | WString(0-32) |
| | ClientCode | Краткий код клиента Участника клиринга или Субклиента | O | WString(0-12) |
| | DueDate | Дата расчета по премии | M | Date |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | VarMarginDebit | Вариационная маржа списанная | O | Numeric(20,2) |
| | VarMarginCredit | Вариационная маржа зачисленная | O | Numeric(20,2) |
| /RECORDS | | | M | |
| /OPTION | | | M | |
| /OPTIONSERIES | | | M | |
| /CONTRACT | | | M | |
| /BASEASSET | | | M | |
| /BASEASSETTYPE | | | M | |
| /BOARD | | | M | |
| /SETTLEDATE | | | M | |
| /SESSION | | | M | |
| /CLEARINGTYPE | | | M | |
| /INFTYPE | | | M | |
| /CURRENCY | | | M | |
| /CLIENT | | | M | |
| /FIRM | | | M | |
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

**MFB08 Отчет об обязательствах по Договорам ПФИ (Фьючерсные контракты), допущенных в клиринг (Выписка из реестра договоров ПФИ, принятых в клиринг)**

Отчет по Участнику клиринга.
Формируется по итогам клиринга.
Отчет содержит Договоры ПФИ, по которым произведен расчет вариационной маржи, и Договоры ПФИ, по которым не произведен расчет вариационной маржи.

| Названиеэлемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | Корневой элемент (root element) XML документа | M | |
| DOC_REQUISITES | | Блок информации о документе | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | REPORT | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB08 | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата отчета | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | String(0-16) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-512) |
| CURRENCY | | Блок данных по валюте расчетов | M | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты расчетов | M | String(0-12) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | CurrencyName | Наименование валюты расчетов | M | WString(0-30) |
| INFTYPE | | Блок данных по типу информации | M | |
| | InfType | Тип информации:<br>4 –Договоры ПФИ, по которым произведен расчет вариационной маржи<br>5 – Договоры ПФИ, по которым не произведен расчет вариационной маржи<br>6 – Операции по изменению позиции по фьючерсному контракту в ходе исполнения данного контракта | M | Integer |
| CLEARINGTYPE | | Блок данных по клиринговому пулу | M | |
| | ClearingType | Тип клирингового пула:<br>C – Расчетный клиринговый пул;<br>F – Клиринговый пул ПФИ | M | Char |
| BATCH | | Блок данных об определении объема Вариационной маржи | | |
| | BatchDate | Дата определения объема Вариационной маржи | O | Date |
| | BatchTime | Время определения объема Вариационной маржи | O | Time |
| | VarMarginRateDate | Дата фиксации курса Валюты расчета | O | Date |
| | VarMarginRateTime | Время фиксации курса Валюты расчета | O | Time |
| SETTLEDATE | | Блок данных по дате расчётов по вариационной марже | O | |
| | SettleDate | Дата расчётов по вариационной марже | O | Date |
| BOARD | | Блок данных по группе инструментов | M | |
| | BoardId | Код Группы инструментов:<br>FUTURES – фьючерсные контракты | M | String(0-16) |
| | BoardName | Наименование Группы инструментов<br>• Фьючерсные контракты | O | WString(0-128) |
| BASEASSETTYPE | | Блок данных по типу (категории) базисного актива | | |
| | BaseAssetType | Тип базисного актива<br>• CURRENCY - валюта<br>• SHARES - акции и депозитарные расписки<br>• BOND – облигации<br>• INDEX – индекс | M | WString(0-32) |
| BASEASSET | | Блок данных по базисному активу | | |
| | BaseAssetDet ailsType | Тип идентификатора базисного актива:<br>ISIN – для ценных бумаг;<br>SYMBOL – для всех остальных типов базисного актива. | O | WString(0-32) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | BaseAssetDetails | Идентификатор базисного актива | O | WString(0-64) |
| | BaseAssetCode | Код базисного актива | M | WString(0-20) |
| | BaseAssetName | Наименование базисного актива | O | WString(0-120) |
| | BaseAssetSection | Группа инструментов, к которым относится базисный актив | O | WString(0-20) |
| FUTURES | | Блок данных по фьючерсному контракту | | |
| | FuturesCode | Идентификационный код фьючерсного контракта | M | String(0-32) |
| | FuturesName | Наименование фьючерсного контракта | M | WString(0-256) |
| | DeliveryType | Тип фьючерсного контракта:<br>• S – расчетный;<br>• D – поставочный | M | Integer |
| | TradeDateStart | Дата начала обращение фьючерсного контракта | O | Date |
| | TradeDateEnd | Последний торговый день, в который может быть заключен фьючерсный контракт | O | Date |
| | ExpirationDate | Дата экспирации | O | Date |
| | ExecutionDate | Дата исполнения | O | Date |
| | TradeLot | Торговый лот | O | Numeric(28,8) |
| | PointRate | Стоимость пункта | O | Numeric(28,8) |
| | PointCurrency | Валюта стоимости пункта | O | String(0-12) |
| RECORDS | | Блок данных по Договору ПФИ | M | |
| | RecNo | Номер по порядку | M | Integer |
| | TradeNo | Номер Договора ПФИ | M | Integer |
| | TradeDate | Дата заключения Договора ПФИ | M | Date |
| | TradeTime | Время регистрации Договора ПФИ в Системе торгов (MSK) | M | Time |
| | TradePlace | Код Организатора торговли, зарегистрировавшего Договор ПФИ<br>Возможные значения<br>• 1000 – ПАО «СПБ Биржа» | O | Integer |
| | TradePlaceName | Идентификатор Организатора торговли, зарегистрировавшего Договор ПФИ.<br>Возможные значения:<br>• SPBXM - ПАО «СПБ Биржа». | O | WString(0-64) |
| | BuySell | Направленность заявки (покупка (**B**) / продажа (**S**)) | M | Char |
| | TradeType | Тип договора:<br>**T** – заключен на основании безадресной заявки;<br>**N** – заключен на основании адресной заявки. | O | Char |
| | TradeModeId | Идентификатор Режима торгов:<br>21 – Режим основных торгов ПФИ<br>22 – Режим переговорных сделок ПФИ<br>23 – Режим торгов RFQ ПФИ | O | Integer |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | TradeModeName | Наименование Режима торгов:<br>• Режим основных торгов ПФИ<br>• Режим переговорных сделок ПФИ<br>• Режим торгов RFQ ПФИ | M | WString(0-64) |
| | Decimals | Число значимых знаков после запятой в ценах. | O | Integer |
| | Price | Цена фьючерсного контракта | M | Numeric(28,8) |
| | PriceCurrency | Валюта цены | O | Text |
| | Quantity | Объём договора, в лотах | M | Numeric(28,8) |
| | Balance | Обязательство по фьючерсным контрактам, в штуках | M | Numeric(28,8) |
| | ValueLocalCurrency | Объем договора, в рублях по курсу ЦБ на дату заключения Договора ПФИ | O | Numeric(20,2) |
| | ExchComm | Биржевая комиссия за Договор ПФИ | O | Numeric(20,2) |
| | ClrComm | Клиринговая комиссия за Договор ПФИ | O | Numeric(20,2) |
| | FeeCurrency | Валюта комиссии | O | WString(0-12) |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-12) |
| | ClientDetails | Идентификационные данные Клиента | O | WString(0-41) |
| | CCPCode | Идентификатор Центрального контрагента<br>• **MFBIM -** НКО-ЦК «СПБ Клиринг» (АО)» | O | String(0-16) |
| | CPFirmId | Идентификатор контрагента (только для адресных договоров) | O | String(0-16) |
| | CPFirmShortName | Краткое наименование контрагента (только для адресных договоров) | O | WString(0-32) |
| | ClientCode | Краткий код клиента Участника клиринга или Субклиента | O | WString(0-12) |
| | VarMarginDebit | Вариационная маржа списанная, в валюте вариационной маржи | O | Numeric(20,2) |
| | VarMarginCredit | Вариационная маржа зачисленная, в валюте вариационной маржи | O | Numeric(20,2) |
| | VarMarginCourseRate | Курс расчета обязательства по уплате вариационной маржи | O | Numeric(28,8) |
| /RECORDS | | | M | |
| EXECUTION | | Блок данных по исполнению фьючерсного контракта | O | |
| | RecNo | Номер по порядку | M | Integer |
| | ExecNo | Номер операции по закрытию позиии по фьючерсному контракту [1] | M | Integer |
| | ExecDate | Дата совершения операции по закрытию позиции по фьючерсному контракту | M | Date |
| | ExecTime | Време совершения операции по закрытию позиции по фьючерсному контракту | M | Time |
| | BuySell | Направленность операции (закрытие короткой позиции (B) / закрытие длинной позиции (S)) | M | Char |

[1] операция по закрытию позиции (не является сделкой) по фьючерсному контракту в дату исполнения в количестве и по направлению, соответствующему количеству и направленности Открытых Фьючерсных контрактов на момент окончания Торгов Фьючерсным контрактом в Дату экспирации

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | Decimals | Число значимых знаков после запятой в ценах | O | Integer |
| | FixingPrice | Цена фьючерсного контракта | M | Numeric(28,8) |
| | FixingPriceCurrency | Валюта цены | O | Text |
| | ClosedPosition | Объем закрытой позиции по фьючерсному контракту, в штуках | M | Numeric(28,8) |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-12) |
| | ClientDetails | Идентификационные данные клиента | O | WString(0-41) |
| | ClientCode | Краткий код клиента  Участника клиринга или Субклиента | O | WString(0-12) |
| | VarMarginDebit | Вариационная маржа списанная, в валюте вариационной маржи | O | Numeric(20,2) |
| | VarMarginCredit | Вариационная маржа зачисленная, в валюте вариационной маржи | O | Numeric(20,2) |
| | VarMarginCourseRate | Курс расчета обязательства по уплате вариационной маржи | O | Numeric(28,8) |
| /EXECUTION | | | | |
| /FUTURES | | | M | |
| /BASEASSET | | | M | |
| /BASEASSETTYPE | | | M | |
| /BOARD | | | M | |
| /SETTLEDATE | | | O | |
| /BATCH | | | M | |
| /CLEARINGTYPE | | | M | |
| /INFTYPE | | | M | |
| /CURRENCY | | | M | |
| /FIRM | | | M | |
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

**MFB08C Отчет об обязательствах по Договорам ПФИ (Фьючерсные контракты), допущенных в клиринг (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг, по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга)**

Отчет по Участнику клиринга.

Формируется по итогам клиринга.

Отчет содержит договоры ПФИ, по которым произведен расчет вариационной маржи, и договоры ПФИ, по которым не произведен расчет вариационной маржи.

| Названиеэлемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | Корневой элемент (root element) XML документа | M | |
| DOC_REQUISITES | | Блок информации о документе | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | REPORT | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB08C | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата отчета | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | String(0-16) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-512) |
| CLIENT | | | | |
| | ClientCode | Краткий код клиента Участника клиринга или Субклиента | M | WString(0-12) |
| | ClientDetails | Идентификационные данные Клиента | M | WString(0-256) |
| CURRENCY | | Блок данных по валюте расчетов | M | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | CurrencyId | Идентификатор валюты расчетов | M | String(0-12) |
| | CurrencyName | Наименование валюты расчетов | M | WString(0-30) |
| INFTYPE | | Блок данных по типу информации | M | |
| | InfType | Тип информации:<br>4 –Договоры ПФИ, по которым произведен расчет вариационной маржи<br>5 – Договоры ПФИ, по которым не произведен расчет вариационной маржи<br>6 – Операции по изменению позиции по фьючерсному контракту в ходе исполнения данного контракта | M | Integer |
| CLEARINGTYPE | | Блок данных по клиринговому пулу | M | |
| | ClearingType | Тип клирингового пула:<br>C – Расчетный клиринговый пул;<br>F – Клиринговый пул ПФИ | M | Char |
| BATCH | | Блок данных об определении объема Вариационной маржи | | |
| | BatchDate | Дата определения объема Вариационной маржи | O | Date |
| | BatchTime | Время определения объема Вариационной маржи | O | Time |
| | VarMarginRateDate | Дата фиксации курса Валюты расчета | O | Date |
| | VarMarginRateTime | Время фиксации курса Валюты расчета | O | Time |
| SETTLEDATE | | Блок данных по дате расчётов по вариационной марже | M | |
| | SettleDate | Дата расчётов по вариационной марже | O | Date |
| BOARD | | Блок данных по группе инструментов | O | |
| | BoardId | Код Группы инструментов:<br>FUTURES – фьючерсные контракты | M | String(0-16) |
| | BoardName | Наименование Группы инструментов<br>• Фьючерсные контракты | O | WString(0-128) |
| BASEASSETTYPE | | Блок данных по типу (категории) базисного актива | | |
| | BaseAssetType | Тип базисного актива<br>• CURRENCY - валюта<br>• SHARES - акции и депозитарные расписки<br>• BOND – облигации<br>• INDEX – индекс | M | WString(0-32) |
| BASEASSET | | Блок данных по базисному активу | | |
| | BaseAssetDetailsType | Тип идентификатора базисного актива: | O | WString(0-32) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | ISIN – для ценных бумаг;<br>SYMBOL – для всех остальных типов базисного актива. | | |
| | BaseAssetDetails | Идентификатор базисного актива | O | WString(0-64) |
| | BaseAssetCode | Код базисного актива | M | WString(0-20) |
| | BaseAssetName | Наименование базисного актива | O | WString(0-120) |
| | BaseAssetSection | Группа инструментов, к которым относится базисный актив | O | WString(0-20) |
| FUTURES | | Блок данных по фьючерсному контракту | | |
| | FuturesCode | Идентификационный код фьючерсного контракта | M | String(0-32) |
| | FuturesName | Наименование фьючерсного контракта | M | WString(0-256) |
| | DeliveryType | Тип фьючерсного контракта:<br>• S – расчетный;<br>• D – поставочный | M | Integer |
| | TradeDateStart | Дата начала обращение фьючерсного контракта | O | Date |
| | TradeDateEnd | Последний торговый день, в который может быть заключен фьючерсный контракт | O | Date |
| | ExpirationDate | Дата экспирации | O | Date |
| | ExecutionDate | Дата исполнения | O | Date |
| | TradeLot | Торговый лот | O | Numeric(28,8) |
| | PointRate | Стоимость пункта | O | Numeric(28,8) |
| | PointCurrency | Валюта стоимости пункта | O | String(0-12) |
| RECORDS | | Блок данных по Договору ПФИ | M | |
| | RecNo | Номер по порядку | M | Integer |
| | TradeNo | Номер Договора ПФИ | M | Integer |
| | TradeDate | Дата заключения Договора ПФИ | M | Date |
| | TradeTime | Время регистрации Договора ПФИ в Системе торгов (MSK) | M | Time |
| | TradePlace | Код Организатора торговли, зарегистрировавшего Договор ПФИ<br>Возможные значения<br>• 1000 – ПАО «СПБ Биржа» | O | Integer |
| | TradePlaceName | Идентификатор Организатора торговли, зарегистрировавшего Договор ПФИ.<br>Возможные значения:<br>• SPBXM - ПАО «СПБ Биржа». | O | WString(0-64) |
| | BuySell | Направленность заявки (покупка (**B**) / продажа (**S**)) | M | Char |
| | TradeType | Тип договора:<br>**T** – заключен на основании безадресной заявки;<br>**N** – заключен на основании адресной заявки. | O | Char |
| | TradeModeId | Идентификатор Режима торгов:<br>21 – Режим основных торгов ПФИ<br>22 – Режим переговорных сделок ПФИ<br>23 – Режим торгов RFQ ПФИ | O | Integer |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | TradeModeName | Наименование Режима торгов:<br>• Режим основных торгов ПФИ<br>• Режим переговорных сделок ПФИ<br>• Режим торгов RFQ ПФИ | M | WString(0-64) |
| | Decimals | Число значимых знаков после запятой в ценах. | O | Integer |
| | Price | Цена фьючерсного контракта | M | Numeric(28,8) |
| | PriceCurrency | Валюта цены | O | Text |
| | Quantity | Объём договора, в лотах | M | Numeric(28,8) |
| | Balance | Обязательство по фьючерсным контрактам, в штуках | M | Numeric(28,8) |
| | ValueLocalCurrency | Объем договора, в рублях по курсу ЦБ на дату заключения Договора ПФИ | O | Numeric(20,2) |
| | ExchComm | Биржевая комиссия за Договор ПФИ | O | Numeric(20,2) |
| | ClrComm | Клиринговая комиссия за Договор ПФИ | O | Numeric(20,2) |
| | FeeCurrency | Валюта комиссии | O | WString(0-12) |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-12) |
| | ClientDetails | Идентификационные данные клиента | O | WString(0-41) |
| | CCPCode | Идентификатор Центрального контрагента<br>• **MFBIM -** НКО-ЦК «СПБ Клиринг» (АО)» | O | String(0-16) |
| | CPFirmId | Идентификатор контрагента (только для адресных договоров) | O | String(0-16) |
| | CPFirmShortName | Краткое наименование контрагента (только для адресных договоров) | O | WString(0-32) |
| | ClientCode | Краткий код клиента Участника клиринга или Субклиента | O | WString(0-12) |
| | VarMarginDebit | Вариационная маржа списанная, в валюте вариационной маржи | O | Numeric(20,2) |
| | VarMarginCredit | Вариационная маржа зачисленная, в валюте вариационной маржи | O | Numeric(20,2) |
| | VarMarginCourseRate | Курс расчета обязательства по уплате вариационной маржи | O | Numeric(28,8) |
| /RECORDS | | | M | |
| EXECUTION | | Блок данных по исполнению фьючерсного контракта | O | |
| | RecNo | Номер по порядку | M | Integer |
| | ExecNo | Номер операции по закрытию позиии по фьючерсному контракту [1] | M | Integer |
| | ExecDate | Дата совершения операции по закрытию позиции по фьючерсному контракту | M | Date |
| | ExecTime | Време совершения операции по закрытию позиции по фьючерсному контракту | M | Time |

[1] операция по закрытию позиции (не является сделкой) по фьючерсному контракту в дату исполнения в количестве и по направлению, соответствующему количеству и направленности Открытых Фьючерсных контрактов на момент окончания Торгов Фьючерсным контрактом в Дату экспирации

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | BuySell | Направленность операции (закрытие короткой позиции (B) / закрытие длинной позиции (S)) | M | Char |
| | Decimals | Число значимых знаков после запятой в ценах | O | Integer |
| | FixingPrice | Цена фьючерсного контракта | M | Numeric(28,8) |
| | FixingPriceCurrency | Валюта цены | O | Text |
| | ClosedPosition | Объем закрытой позиции по фьючерсному контракту, в штуках | M | Numeric(28,8) |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-12) |
| | ClientDetails | Идентификационные данные клиента | O | WString(0-41) |
| | ClientCode | Краткий код клиента Участника клиринга или Субклиента | O | WString(0-12) |
| | VarMarginDebit | Вариационная маржа списанная, в валюте вариационной маржи | O | Numeric(20,2) |
| | VarMarginCredit | Вариационная маржа зачисленная, в валюте вариационной маржи | O | Numeric(20,2) |
| | VarMarginCourseRate | Курс расчета обязательства по уплате вариационной маржи | O | Numeric(28,8) |
| /EXECUTION | | | | |
| /FUTURES | | | M | |
| /BASEASSET | | | M | |
| /BASEASSETTYPE | | | M | |
| /BOARD | | | M | |
| /SETTLEDATE | | | O | |
| /BATCH | | | M | |
| /CLEARINGTYPE | | | M | |
| /INFTYPE | | | M | |
| /CURRENCY | | | M | |
| /FIRM | | | M | |
| /CLIENT | | | M | |
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

**MFB13 Отчет об итоговых нетто-обязательствах/нетто-требованиях**

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | | M | |
| DOC_REQUISITES | | | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | REPORT | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB13 | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата отчета | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | String(0-16) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-512) |
| CLEARINGTYPE | | | M | |
| | ClearingType | Тип клирингового пула:<br>A - Клиринговый пул по Внутриброкерским договорам;<br>C - Расчетно-клиринговый пул;<br>D – Клиринговый пул по договорам с полным обеспечением;<br>I – Клиринговый пул по договорам размещения/выкупа;<br>N – Клиринговый пул по договорам без ЦК. | M | Integer |
| SESSION | | | M | |
| | ClearingTime | Дата и время формирования клирингового пула (MSK) | O | String(0-19) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | FinalObligations | Признак нетто-обязательств, определенных до процедуры урегулирования нехватки активов для поставки:<br>N - итоговые нетто-обязательства до процедуры урегулирования нехватки активов для поставки<br>Y –итоговые нетто-обязательства | O | Y_N_Type |
| SETTLE | | Блок данных по ТКС | M | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-16) |
| POSTYPES | | Блок информации по типам обязательств | M | |
| | PosType | **C -** информация о нетто обязательствах/требованиях по денежной позиции<br>**S -** информация о нетто обязательствах/требованиях поценным бумагам | M | Char |
| GROUP | | Блок данных по обязательствам в разрезе регистра | M | |
| | BankAccCode | Код денежного регистра | O | String(0-64) |
| | GuarDepUnitId | Счет (субсчет) депо для учета ценных бумаг | O | String(0-64) |
| RECORDS | | Блок данных по обязательствам | M | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты обязательства | O | String(0-12) |
| | CurrencyName | Наименование валюты обязательства | O | WString(0-30) |
| | SecurityId | Идентификатор ценной бумаги | O | String(0-32) |
| | SecShortName | Краткое наименование ценной бумаги /эмитента ценной бумаги | O | WString(0-256) |
| | Debit | Нетто-обязательство / обязательство | M | Numeric(28,8) |
| | Credit | Нетто-требование / требование | M | Numeric(28,8) |
| | Shortage | Размер нехватки активов для поставки | O | Numeric(28,8) |
| /RECORDS | | | M | |
| /GROUP | | | M | |
| /POSTYPES | | | M | |
| /SETTLEDATE | | | M | |
| /SETTLE | | | M | |
| /SESSION | | | M | |
| /CLEARINGTYPE | | | M | |
| /FIRM | | | M | |
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

**MFB14 Отчет о Гарантийном обеспечении, Маржинальном требовании и Задолженности**
Формируется по итогам утреннего клиринга

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | | M | |
| DOC_REQUISITES | | | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | **REPORT** | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB14 | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Краткое наименование Участника клиринга | M | WString(0-512) |
| | Volume | Том отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов отчета | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | M | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | String(0-16) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-512) |
| SETTLE | | Блок данных по ТКС | M | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-16) |
| | SeparateAccount | Тип учета средств ГО для ТКС<br>• 0 – стандартный учет<br>• 1 - обособленный учет | M | Integer |
| COLLATERAL | | Блок информации о средствах обеспечения | M | |
| | CollateralCurrencyId | Идентификатор валюты обеспечения | M | String(0-12) |
| | CollateralCurrencyName | Наименование валюты обеспечения | O | WString(0-30) |
| | CollateralSum | Внесенные средства обеспечения | O | Numeric(28,8) |
| | CollateralBlocked | Заблокированное обеспечение | O | Numeric(28,8) |
| ASSET | | Блок информации о внесённых средствах обеспечения | O | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | AssetType | Тип внесенных средств обеспечения<br>• C - денежные средства<br>• S - ценные бумаги | M | Char |
| | AssetCode | Биржевой код внесенного актива | M | String(1-16) |
| | AssetName | Наименование внесенного актива | O | WString(1-256) |
| | ISIN | Код ISIN ценной бумаги | O | String(32) |
| | AssetCollateralTotal | Общий объем внесенных средств обеспечения, в валюте обеспечения | M | Numeric(28,8) |
| | AssetCollateralDiscounted | Объем внесенных средств обеспечения с учетом дисконта, в валюте обеспечения | M | Numeric(28,8) |
| | AssetDiscountRate | Ставка дисконта, в % | M | Numeric(28,8) |
| /ASSET | | | | |
| /COLLATERAL | | | M | |
| OBLIGATION | | Блок данных по требованию к ТКС | M | |
| | ObligationSum | Сумма маржинального требования по ТКС в валюте обеспечения | M | Numeric(28,8) |
| | AccountMarginCall | Признак возникновения частного маржинального требования по ТКС с выделенным учетом | O | Y_N_Type |
| /OBLIGATION | | | M | |
| /SETTLE | | | M | |
| /FIRM | | | M | |
| OBLIGATION_TYPE | | Блок данных по маржинальному требованию к Участнику клиринга | M | |
| | ObligTypeId | Тип требования<br>Возможные значения:<br>**N** – Маржинальное требование отсутствует<br>**MC** – Маржинальное требование<br>**UMC** – Непогашенное маржинальное требование | M | String(3) |
| | ObligTypeName | Наименование требования | M | WString(0-64) |
| | TotalSum | Итоговое требование к Участнику клиринга в валюте обеспечения | M | Numeric(28,8) |
| /OBLIGATION_TYPE | | | M | |
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

**MFB15 Отчет по обязательствам Участника клиринга по комиссионному вознаграждению**

Формируется по итогам вечернего клиринга для расчетов по итогам торгов

Формируется в дополнительной рассылке с промежуточными данными на момент формирования

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | | M | |
| DOC_REQUISITES | | | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | REPORT | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB15 | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | String(0-16) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-512) |
| SETTLE | | Блок данных по ТКС | | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-12) |
| TYPE | | Блок данных по получателям комиссии | M | |
| | ComType | **1** – Биржевой сбор,<br>**2** - Клиринговая комиссия,<br>**3** - Лицензионное вознаграждение | M | Char |
| CURRENCY | | | M | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты комиссии | M | String(0-12) |
| | CurrencyName | Наименование валюты комиссии | M | WString(0-30) |

| FEE | | Блок данных по видам комиссии | M | |
|---|---|---|---|---|
| | FeeType | Признак вида комиссии/возвратной премии:<br>**0** - всего по денежной позиции<br>**1** - оборотная часть с уплатой в день заключения договора<br>**2** - фиксированная комиссия за ведение клиринговых регистров<br>**3** - возвратная премия по данному типу комиссии<br>**5** - комиссия за принудительное закрытие позиции<br>**6** - оборотная часть с уплатой в день исполнения договора<br>**7 –** комиссия за проведение процедуры замены валюты денежных средств обеспечения<br>**8 –** комиссия за списание с Торгового счета/Субсчета депо ценных бумаг иностранного эмитента, учитываемых в качестве Средств обеспечения Участника клиринга, на основании поручения на списание ценных бумаг в количестве, превышающем совокупное количество ценных бумаг данного иностранного эмитента, внесенных в качестве Средств обеспечения данным Участником клиринга<br>**12** – комиссия за<br>1) договоры репо, заключённые в Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» на основании Заявок, в которых указаны торгово-клиринговые счета,зарегистрированные на одного Участника торгов,<br>2) внебиржевые договоры репо ОТС (Пары внебиржевых договоров ОТС), заключённые на основании Оферты ОТС типа 2, и связанные Внебиржевые договоры репо ОТС (связанные Пары внебиржевых договоров ОТС), заключенные на основании связанной Оферты ОТС, приусловии направления Оферты ОТС типа 2, в которых указаны торгово-клиринговые счета, зарегистрированные на одного Участника клиринга, предметом которых являются ценные бумаги, относящиеся к Группе инструментов<br>«иностранные ценные бумаги», и из Внебиржевых договоров ОТС, за исключением Внебиржевых договоров ОТС, предметом которых являются ценные бумаги российскихэмитентов и иностранные финансовые инструменты, квалифицированные в качестве облигаций иноминированные в валюте, отличной от российского рубля<br>**13** - комиссии за:<br>1) договоры репо, заключённые в Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» на основании Заявок, в которых указаны торгово-клиринговые счета,зарегистрированные на одного Участника торгов,<br>2) внебиржевые договоры репо ОТС (Пары внебиржевых договоров ОТС), заключённые на основании Оферты ОТС типа 2, и связанные Внебиржевые договоры репо ОТС (связанные Пары внебиржевых договоров ОТС), заключенные на основании связанной Оферты ОТС, приусловии направления Оферты ОТС типа 2, в которых указаны торгово-клиринговые счета, зарегистрированные на одного Участника клиринга, предметом которых являются ценные бумаги, относящиеся к Группе инструментов «еврооблигации», и из Внебиржевых договоров ОТС, предметом которых являются финансовые инструменты, квалифицированные в качестве облигаций и номинированные ввалюте, отличной от российского рубля<br>**14** - ежемесячный биржевой сбор | M | String(0-3) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | **15** - клиринговый сбор за возврат Средств обеспечения УК в иностранной валюте<br>**16** - клиринговый сбор за ведение клиринговых регистров УК в целях ведения отдельного учетав рамках ТКС, зарегистрированного для отдельного клиента УК<br>**17** - клиринговый сбор за проведение расчетов по итогам клиринга договоров<br>**18** - биржевой сбор за торговлю в дополнительную утреннюю сессию<br>**19** - клиринговый сбор за обработку поручений на зачисление, списание и перевод ценныхбумаг на/с субсчета депо<br>**20** - иные сборы<br>**21** - списание клиринговой комиссии за учет индивидуального клирингового обеспечения в Евро<br>**22** - списание клиринговой комиссии за учет коллективного клирингового обеспечения в Евро<br>**23** - списание клиринговой комиссии за обработку форм идентификации W8-BEN<br>**24** - списание клиринговой комиссии за обработку форм при выплате доходов и раскрытие бенефициаров<br>**25** возмещение расходов КЦ, связанных с выплатой дохода по ценным бумагам<br>**26** - возмещение иных расходов КЦ<br>**29** Комиссия за исполнение опциона<br>**30** Комиссия за расчетное исполнение опциона нулевого страйка<br>**31** Комиссия за конвертацию опциона нулевого страйка<br>**32** Комиссия за заключение опционного контракта | | |
| | TotComm | Обязательство по уплате Комиссионных вознаграждений | M | Numeric(28,8) |
| | TotVAT | в т.ч. НДС | O | Numeric(28,8) |
| | Executed | Признак удержания в отчетную дату:<br>Y – удержано<br>N – не удержано | O | Char |
| | DateFrom | Дата начала периода, за который начислена комиссия | O | Date |
| | DateTo | Дата окончания периода, за который начислена комиссия/Дата уплаты комиссии (с уплатой в день исполнения договора) | O | Date |
| /FEE | | | M | |
| /CURRENCY | | | M | |
| /TYPE | | | M | |
| /SETTLE | | | M | |
| /FIRM | | | M | |
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

**MFB17F Комиссия за учет позиций по фьючерсным контрактам и Вариационная маржа, связанная с отклонением цены фьючерсного контракта от цены базисного актива**

Отчет формируется каждый календарный день, кроме дней, в которые не проводятся торги.
Отчет формируется в новом календарном дне, по итогу предыдущего дня.
В случае если данные по комиссии за учет позиций по фьючерсным контрактам и (или) вариационной марже, связанной с отклонением цены фьючерсного контракта от цены базисного актива, не отразились в отчете, то эти данные будут отражены в отчете за следующий календарный день.

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | | M | |
| DOC_REQUISITES | | | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | **REPORT** | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB17F | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| ACCRUALDATE | | Блок данных по дате начисления комиссии | M | |
| | AccrualDate | Дата начисления комиссии | M | Date |
| | SessionDate | Дата фактического списания комиссии за учет позиций по фьючерсным контрактам и вариационной маржи, связанной с отклонением цены фьючерсного контракта от цены базисного актива | M | Date |
| FIRM | | Блок данных по участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор участника торгов | M | String(0-16) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-512) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| POSITIONDATE | | Блок данных по дате позиции по фьючерсным контрактам | M | |
| | PositionDate | Дата позиции по фьючерсным контрактам | M | Date |
| CURRENCY | | Блок данных по валюте расчетов | M | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты расчётов | M | String(0-12) |
| | CurrencyName | Наименование валюты расчётов | O | WString(0-30) |
| ACCOUNT | | Блок данных по ТКС | | |
| | PositionClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-12) |
| CLIENT | | Блок данных по комиссии | | |
| | ClientCode | Краткий код клиента  Участника клиринга или Субклиента | M | String(0-12) |
| | ClientDetails | Идентификационные данные клиента / Субклиента | O | String(0-256) |
| ACCRUAL | | | M | |
| | AccrualType | POSITION_FEE - клиринговый сбор за учет позиций по фьючерсным контрактам<br>FUNDING - вариационная маржа, связанная с отклонением цены фьючерсного контракта от цены базисного актива | M | String(1-32) |
| POSITION | | Блок данных по расчету комиссии | M | |
| | FuturesCode | Идентификационный код фьючерсного контракта | M | String(0-32) |
| | FuturesName | Наименование фьючерсного контракта | O | WString(0-256) |
| | FeeClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-12) |
| | PositionType | Позиция по фьючерсному контракту.<br>LONG – длинная позиция<br>SHORT – короткая позиция | M | String(0-32) |
| | PositionQty | Размер позиции по фьючерсному контракту в штуках | M | Numeric(20,0) |
| | PositionVolume | Оценка позиции по фьючерсному контракту, в валюте расчета<br>Заполняется только для типа POSITION_FEE | O | Numeric(28,2) |
| | Debit | Размер списания | M | Numeric(28,2) |
| | Credit | Размер зачисления | M | Numeric(28,2) |
| | Rate | Ставка комиссии, в процентах годовых.<br>Заполняется только для типа POSITION_FEE | O | Numeric(28,8) |
| | Price | Текущая цена (расчетная цена) фьючерсного контракта для оценки.<br>Заполняется только для типа POSITION_FEE | O | Numeric(28,8) |
| | PriceCurrency | Валюта цены.<br>Заполняется только для типа POSITION_FEE | O | String(0-12) |
| | Course | Курс ЦБ | M | Numeric(28,8) |
| | PointRate | Стоимость пункта.<br>Заполняется только для типа POSITION_FEE. | O | Numeric(28,8) |
| | PointCurrency | Валюта стоимости пункта.<br>Заполняется только для типа POSITION_FEE | O | String(0-12) |
| /POSITION | | | M | |
| /ACCRUAL | | | M | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| /CLIENT | | | M | |
| /ACCOUNT | | | M | |
| /CURRENCY | | | M | |
| /POSITIONDATE | | | M | |
| /FIRM | | | M | |
| /ACCRUALDATE | | | M | |
| /REPOR | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

**MFB18F Отчет о позиции по Фьючерсным контрактам**

Формируется  за каждый календарный день, кроме дней, в которые не проводились торги.

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | | M | |
| DOC_REQUISITES | | | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | **REPORT** | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB18F | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| OPERATIONDATE | | Блок данных по дате торгового дня | M | |
| | OperationDate | Дата торгового дня | M | Date |
| FIRM | | Блок данных по участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор участника торгов | M | String(0-16) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-512) |
| CLIENT | | Блок данных по клиенту | M | |
| | ClientCode | Краткий код клиента  Участника клиринга или Субклиента | M | String(0-12) |
| | ClientDetails | Идентификационные данные клиента | O | WString(0-256) |
| POSITION | | Блок данных по средневзвешеной цене фьючерсного контракта и промежуточной вариационной марже | M | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-12) |
| | FuturesCode | Идентификационный код Фьючерсного контракта | M | String(0-32) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | FuturesName | Наименование Фьючерсного контракта | O | WString(0-256) |
| | PriceCurrency | Валюта цены | M | String(0-10) |
| | Position | Размер позиции на конец дня (в штуках) | M | Numeric(20,0) |
| | RealizedVM | Промежуточное значение Вариационной маржи, определенное с начала Периода учета Вариационной маржи до окончания Торгового дня, за который формируется отчет | M | Numeric(28,16) |
| | AccountPricePoint | Средневзвешенная цена Фьючерсного контракта на конец Торгового дня | M | Numeric(28,8) |
| | PointRate | Стоимость пункта | M | Numeric(28,8) |
| | PointCurrency | Валюта стоимости пункта | M | String(0-12) |
| /POSITION | | | M | |
| /CLIENT | | | M | |
| /FIRM | | | M | |
| /OPERATIONDATE | | | M | |
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

**MFB20 Уведомление о торгово-клиринговых счетах Участника клиринга**

Формируется по итогам вечернего клиринга для расчетов по итогам торгов

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | | M | |
| DOC_REQUISITES | | | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | REPORT | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB20 | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Краткое наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Том отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов отчета | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| FIRM | | Блок данных по участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор участника торгов | M | String(0-16) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-512) |
| CLEARING_ACC | | Блок данных по ТКС | M | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-16) |
| | ClrAccStatus | Состояние ТКС:<br>A – активный;<br>N - не активный;<br>D – удален. | M | String(1) |
| | ClrAccType | Тип ТКС<br>**p** – собственный некредитной организации<br>**b** – собственный кредитной организации<br>**c** – клиентский | M | String(1) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | **m** –раздел ДУ<br>**i** – для учета обязательств Участника клиринга-продавца (для размещения ценных бумаг)<br>**g** - для учета средств коллективного клирингового обеспечения<br>**e** - для учета требований дополнительного обеспечения<br>**t** - ТКС с группой субсчетов, привязанных к клиентам<br>**x** –клиентский ТКС для клиента (ов) ДУ | | |
| | DataChanged | Индикатор изменений:<br>**Y** – сегодня произошли изменения<br>**N** – сегодня изменений не происходило | M | Y_N_Type |
| | DateCreated | Дата создания ТКС | M | Date |
| | DateDeleted | Дата удаления ТКС (если есть) | O | Date |
| | DefaultClient | Код клиента, использующегося согласно п.30.9 Правил клиринга | O | String(0-16) |
| | CommPaymentAcc | Признак раздела для уплаты возмещения и фиксированной части комиссии:<br>**Y** - является<br>**N** - не является | O | Y_N_Type |
| | 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 | String(0-16) |
| | SeparateAccounting | Признак выделенного учета Средств обеспечения<br>**Y**- производится выделенный учет Средств обеспечения, учитываемых на данном ТКС, в соответствии с Правилами клиринга<br>**N**-выделенный учет не производится | M | Y_N_Type |
| | TrustClientIdentifier | Регистрационный код клиента, имущество которого учитывается обособленно на ТКС | O | String(0-64) |
| | FeeClutch | Признак списания комиссии в дату исполнения договора<br>**Y** - оборотная часть комиссии списывается в дату исполнения договора<br>**N** или отсутствие атрибута - оборотная часть комиссии списывается в дату заключения договора | O | Y_N_Type |
| | RepoUnavailable | Признак заключения договоров купли-продажи при урегулировании случаев неисполнения<br>обязательств<br>**Y** – заключаются договоры купли-продажи<br>**N** – заключаются договоры репо | O | Y_N_Type |
| BANK_ACC | | Блок данных по денежному регистру | | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты денежного регистра | M | String(0-4) |
| | CurrencyName | Наименование валюты денежного регистра | O | WString(0-32) |
| | AccountNumber | Идентификатор денежного регистра | O | String(0-64) |
| | | | | |
| /BANK_ACC | | | M | |
| DEPO_ACC | | Блок данных о депозитарном субсчете | O | |
| | DepositaryName | Код группы счетов в Расчетном депозитарии, в котором открыт субсчет:<br>**BEBSD** | O | String(0-16) |
| | DepoAccountNumber | Субсчет депо для учета ценных бумаг | O | String(0-64) |
| | DepoAccountCastodianCode | Код кастодиана субсчета | O | String(0-16) |
| | DepoAccountOwnerNa | Наименование владельца субсчета / кастодиана по счету | O | WString(0-256) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | me | | | |
| | DepoAccountType | Тип депо субсчета | O | WString(0-128) |
| CLIENT | | Блок данных о клиентах, привязанных к данному субсчету | O | |
| | ClientCode | Краткий код клиента  Участника клиринга или Субклиента | O | String(0-12) |
| | ClientIdentification | Идентификационный код клиента | O | String(0-256) |
| /CLIENT | | | O | |
| /DEPO_ACC | | | M | |
| /CLEARING_ACC | | | M | |
| /FIRM | | | M | |
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

**MFB21 Уведомление о счетах для вывода денежных средств Участника клиринга**

Формируется по итогам вечернего клиринга для расчетов по итогам торгов

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | | M | |
| DOC_REQUISITES | | | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | REPORT | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB21 | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | String(0-16) |
| | FirmType | Тип Участника клиринга:<br>**Некредитная**<br>**Кредитная** | M | WString(0-20) |
| | MainFirmName | Краткое наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| CURRENCY | | Блок данных по валюте счета | M | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты счета | M | String(0-12) |
| | CurrencyName | Наименование валюты счета | O | WString(0-30) |
| BANK_ACC | | Блок данных по счету | M | |
| | AccCode | Код счета, присвоенный КЦ при регистрации | M | String(0-64) |
| | RecvAccount | Номер счета получателя | M | String(0-64) |
| | RecvBankName | Наименование банка получателя | M | WString(0-200) |
| | RecvBankCorrAcc | Номер корреспондентского счета/номер счета для рублевых счетов | O | String(0-32) |
| | RecvBankBIC | БИК | O | String(0-12) |
| | CorBankBIC | SWIFT-BIC банка - корреспондента (для вывода валюты) | O | String(0-12) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | RecipientName | Наименование получателя | M | WString(0-128) |
| | RecipientAddress | Адрес получателя | O | String(0-128) |
| | RecipientBIC | SWIFT BIC получателя | O | String(0-12) |
| | DefaultAccount | Признак дефолтного счета | M | Y_N_Type |
| SETTLE | | Блок данных по ТКС, с которых можно выводить средства на данный счет | O | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | O | String(0-16) |
| | FirmId | Идентификатор участника торгов | O | String(0-16) |
| /SETTLE | | | O | |
| /BANK_ACC | | | M | |
| /CURRENCY | | | M | |
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

**MFB22 Отчет о требованиях по погашению задолженности по денежному регистру**

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

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | | M | |
| DOC_REQUISITES | | | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | REPORT | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB22 | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Краткое наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | String(0-16) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-512) |
| SETTLE | | Блок данных по ТКС | M | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-12) |
| GROUP | | Блок данных по денежному регистру | M | |
| | BankAccCode | Код денежного регистра | M | String(0-64) |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты, в которой учитывается задолженность | M | String(0-12) |
| | CurrencyName | Наименование валюты, в которой учитывается задолженность | O | WString(0-30) |
| DEBTS | | Блок данных по задолженности по денежному регистру | M | |
| | DebtsSum | Сумма задолженности в валюте счета | M | Numeric(28,8) |
| | FineSum | Сумма штрафа | O | Numeric(28,8) |
| | FineRate | Ставка для расчета штрафа (в процентах) | O | Numeric(28,8) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| /DEBTS | | | M | |
| /GROUP | | | M | |
| /SETTLE | | | M | |
| /FIRM | | | M | |
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |
| | DebtsTotal | Сумма задолженности с учетом штрафа, в валюте расчетов | M | Numeric(28,8) |

**MFB23 Отчет об обязательствах по договорам, кроме обязательств по Договорам ПФИ**
Формируется по итогам вечернего клиринга для расчетов по итогам торгов.
Формируется в дополнительной рассылке с промежуточными данными на момент формирования

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | | M | |
| DOC_REQUISITES | | | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронногоДокументооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | REPORT | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB23 | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | String(0-16) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-512) |
| SETTLE | | Блок данных по ТКС | | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-12) |
| SETTLEDATE | | Блок данных по дате исполнения | | |
| | SettleDate | Дата исполнения | M | Date |
| POSTYPES | | Блок информации по типам обязательств | | |
| | PosType | **C -** информация о нетто обязательствах/требованиях по денежной позиции<br>**S** - информация о нетто обязательствах/требованиях по ценным бумагам | M | Char |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| GROUP | | Блок данных по обязательствам | | |
| | BankAccCode | Код денежного регистра | O | String(0-64) |
| | GuarDepUnitId | Счет (субсчет) депо для учета ценных бумаг | O | String(0-64) |
| RECORDS | | Блок данных по обязательствам | | |
| | DataType | Тип обязательств:<br>**TRADE** – по договорам<br>**FEE** – по оборотной части комиссионного вознаграждения с уплатой вдень исполнения Договора<br>**DIVIDEND** – по возврату дивидендов по сделкам РЕПО<br>**ADDITIONAL** – дополнительные обязательства, возникшие в связи скорпоративными событиями | M | String(0-32) |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты расчётов. Для Внебиржевого договора ОТС / Внебиржевого договора репо ОТСуказывается идентификатор Валюты расчетов по итогам клиринга | O | String(0-12) |
| | CurrencyName | Наименование валюты расчётов. Для Внебиржевого договора ОТС / Внебиржевого договора репо ОТСуказывается наименование Валюты расчетов по итогам клиринга | O | String(0-30) |
| | SecurityId | Идентификатор инструмента | O | String(0-32) |
| | SecShortName | Краткое наименование инструмента | O | WString(0-256) |
| | BaseSecurityCode | Код базового актива (не указывается, если совпадает с SecurityId) | O | String(0-32) |
| | DebitBeg | Входящее нетто-обязательство / обязательство | O | Numeric(28,8) |
| | CreditBeg | Входящее нетто-требование / требование | O | Numeric(28,8) |
| | DebitIntraday | Изменение обязательств в связи с заключением договоров в текущий День | O | Numeric(28,8) |
| | CreditIntraday | Изменение требований в связи с заключением договоров в текущий день | O | Numeric(28,8) |
| | DebitCorpEvCorrection | Изменение обязательств в связи с проведением корпоративного события | O | Numeric(28,8) |
| | CreditCorpEvCorrection | Изменение требований в связи с проведением корпоративного события | O | Numeric(28,8) |
| | PosExecDebit | Количество исполненных обязательств | M | Numeric(28,8) |
| | PosExecCredit | Количество исполненных требований | M | Numeric(28,8) |
| | Debit | Итоговое нетто-обязательство / обязательство | M | Numeric(28,8) |
| | Credit | Итоговое нетто-требование / требование | M | Numeric(28,8) |
| /RECORDS | | | M | |
| /GROUP | | | M | |
| /POSTYPES | | | M | |
| /SETTLEDATE | | | M | |
| /SETTLE | | | M | |
| /FIRM | | | M | |
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

**MFB23C Уведомление об обязательствах по Договорам, кроме обязательств по Договорам ПФИ (по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга)**

Формируется по итогам вечернего клиринга для расчетов по итогам торгов

Формируется в дополнительной рассылке с промежуточными данными на момент формирования

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | | M | |
| DOC_REQUISITES | | | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | **REPORT** | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB23C | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| FIRM | | Блок данных по участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор участника торгов | M | String(0-16) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-512) |
| CLIENT | | Блок данных по клиенту | | |
| | ClientCode | Краткий код клиента  Участника клиринга или Субклиента | M | String(0-12) |
| | ClientDetails | Идентификационные данные клиента | M | String(0-256) |
| SETTLEDATE | | Блок данных по дате исполнения | | |
| | SettleDate | Дата исполнения / дата расчетов по премии | M | Date |
| POSTYPES | | Блок информации по типам обязательств | | |
| | PosType | **C** - информация о нетто обязательствах/требованиях по денежной позиции<br>**S** - информация о нетто обязательствах/требованиях по ценным бумагам | M | Char |
| RECORDS | | Блок данных по обязательствам | M | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | DataType | Тип обязательств:<br>**TRADE** – по договорам<br>**FEE** – по оборотной части комиссионного вознаграждения с уплатой в день исполнения Договора<br>**DIVIDEND** – по возврату дивидендов<br>**ADDITIONAL** – дополнительные обязательства, возникшие в связи с корпоративными событиями | M | String(0-32) |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты расчётов<br>Для Внебиржевого договора OTC/Внебиржевого договора репо OTC указывается идентификатор Валюты расчетов по итогам клиринга | O | String(0-12) |
| | CurrencyName | Наименование валюты расчётов<br>Для Внебиржевого договора OTC/Внебиржевого договора репо OTC указывается наименование Валюты расчетов по итогам клиринга | O | WString(0-30) |
| | SecurityId | Идентификатор инструмента | O | String(0-32) |
| | SecShortName | Краткое наименование инструмента | O | String(0-256) |
| | BaseSecurityCode | Код базового актива (не указывается если совпадает с SecurityId) | O | String(0-32) |
| | DebitBeg | Входящее нетто-обязательство / обязательство | O | Numeric(28,8) |
| | CreditBeg | Входящее нетто-требование / требование | O | Numeric(28,8) |
| | DebitIntraday | Изменение обязательств в связи с заключением договоров в текущий день | O | Numeric(28,8) |
| | CreditIntraday | Изменение требований в связи с заключением договоров в текущий день | O | Numeric(28,8) |
| | DebitCorpEvCorrection | Изменение обязательств в связи с проведением корпоративного события | O | Numeric(28,8) |
| | CreditCorpEvCorrection | Изменение требований в связи с проведением корпоративного события | O | Numeric(28,8) |
| | PosExecDebit | Количество исполненных обязательств | M | Numeric(28,8) |
| | PosExecCredit | Количество исполненных требований | M | Numeric(28,8) |
| | Debit | Итоговое нетто-обязательство / обязательство | M | Numeric(28,8) |
| | Credit | Итоговое нетто-требование / требование | M | Numeric(28,8) |
| /RECORDS | | | M | |
| /POSTYPES | | | M | |
| /SETTLEDATE | | | M | |
| /CLIENT | | | M | |
| /FIRM | | | M | |
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

**MFB23D Уведомление об обязательствах по Договорам ПФИ (по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга)**
Формируется по итогам вечернего клиринга для расчетов по итогам торгов
Формируется в дополнительной рассылке с промежуточными данными на момент формирования

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | | M | |
| DOC_REQUISITES | | | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | **REPORT** | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB23D | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| FIRM | | Блок данных по участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор участника торгов | M | String(0-16) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-512) |
| CLIENT | | Блок данных по клиенту | | |
| | ClientCode | Краткий код клиента  Участника клиринга или Субклиента | M | String(0-12) |
| | ClientDetails | Идентификационные данные клиента | M | String(0-256) |
| SETTLE | | Блок данных по ТКС | | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-12) |
| SETTLEDATE | | Блок данных по дате исполнения | | |
| | SettleDate | Дата исполнения / дата расчетов по премии | M | Date |
| POSTYPES | | Блок информации по типам обязательств | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | PosType | **C** - информация о нетто обязательствах/требованиях по денежной позиции<br>**O** – информация о нетто-обязательствах / требованиях по опционам<br>**F** – информация о нетто обязательствах/требованиях по фьючерсным контрактам | M | Char |
| RECORDS | | Блок данных по обязательствам | M | |
| | DataType | Тип обязательств:<br>**TRADE** – по договорам ПФИ<br>**PREMIUM** – по договорам ПФИ (премии по опционам нулевого страйка)<br>**EXECUTION_RESULT** – обязательства, возникшие в результате исполнения опциона<br>**VARMARGIN –** обязательства по вариационной марже | M | String(0-32) |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты расчётов | O | String(0-12) |
| | CurrencyName | Наименование валюты расчётов | O | String(0-30) |
| | SecurityId | Идентификатор инструмента | O | String(0-32) |
| | SecShortName | Краткое наименование инструмента | O | String(0-256) |
| | BaseSecurityCode | Код базового актива (не указывается, если совпадает с SecurityId) | O | String(0-32) |
| | DebitBeg | **Для типа обязательств TRADE:**<br>Размер входящей короткой позиции по фьючерсному контракту / опциону<br><br>**Для типа обязательств PREMIUM:**<br>Входящее нетто-обязательство по уплате премии<br><br>**Для типа обязательств EXECUTION_RESULT:**<br>Входящее нетто-обязательство по уплате по Основному обязательству в результате исполнения опциона<br><br>**Для типа обязательств VARMARGIN:**<br>Входящее нетто-обязательство по уплате вариационной маржи | O | Numeric(28,8) |
| | CreditBeg | **Для типа обязательств TRADE:**<br>Размер входящей длинной позиции по фьючерсному контракту / опциону<br><br>**Для типа обязательств PREMIUM:**<br>Входящее нетто-требование по уплате премии<br><br>**Для типа обязательств EXECUTION_RESULT:**<br>Входящее нетто-требование по уплате по Основному обязательству в результате исполнения опциона<br><br>**Для типа обязательств VARMARGIN:**<br>Входящее нетто-требование по уплате вариационной маржи | O | Numeric(28,8) |
| | DebitIntraday | **Для типа обязательств TRADE:**<br>Изменение размера позиции по фьючерсному контракту / опциону в связи с заключением Договоров ПФИ в отчетную дату,<br><br>**Для типа обязательств PREMIUM:** | O | Numeric(28,8) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | Изменение нетто-обязательства по уплате премии в связи с заключением Договора ПФИ в отчетную дату<br><br>**Для типа обязательств EXECUTION_RESULT:**<br>Изменение нетто-обязательства по уплате по Основному обязательству в результате исполнения опциона в отчетную дату<br><br>**Для типа обязательств VARMARGIN:**<br>Изменение нетто-обязательства по уплате вариационной маржи в отчетную дату | | |
| | CreditIntraday | **Для типа обязательств TRADE:**<br>Изменение размера позиции по фьючерсному контракту / опциону в связи с заключением Договоров ПФИ в отчетную дату,<br><br>**Для типа обязательств PREMIUM:**<br>Изменение нетто-требования по уплате премии в связи с заключением Договора ПФИ в отчетную дату<br><br>**Для типа обязательств EXECUTION_RESULT :**<br>Изменение нетто- требования по уплате по Основному обязательству в результате исполнения опциона в отчетную дату<br><br>**Для типа обязательств VARMARGIN:**<br>Изменение нетто-требования по уплате вариационной маржи в отчетную дату | O | Numeric(28,8) |
| | PosExecDebit | **Для типа обязательств TRADE:**<br>Изменение размера позиции по фьючерсному контракту / опциону в связи с исполнением Договоров ПФИ,<br><br>**Для типа обязательств PREMIUM:**<br>Размер исполненного нетто-обязательства по уплате премии в связи с заключением Договора ПФИ<br><br>**Для типа обязательств EXECUTION_RESULT :**<br>Размер исполненного нетто- обязательства по уплате по Основному обязательству в результате исполнения опциона<br><br>**Для типа обязательств VARMARGIN:**<br>Размер исполненного нетто-обязательства по уплате вариационной маржи | M | Numeric(28,8) |
| | PosExecCredit | **Для типа обязательств TRADE:**<br>Изменение размера позиции по фьючерсному контракту / опциону в связи с исполнением Договоров ПФИ,<br><br>**Для типа обязательств PREMIUM:**<br>Размер исполненного нетто-обязательства по уплате премии в связи с заключением Договора ПФИ<br><br>**Для типа обязательств EXECUTION_RESULT :**<br>Размер исполненного нетто- требования по уплате по Основному обязательству в результате исполнения опциона | M | Numeric(28,8) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | **Для типа обязательств VARMARGIN:**<br>Размер исполненного нетто-требования по уплате вариационной маржи | | |
| | PosExecPrice | Цена исполнения фьючерсного контракта | O | Numeric(28,8) |
| | PosExecPriceCurrency | Валюта цены исполнения фьючерсного контракта | O | String(0-12) |
| | ShortPosComm | Размер комиссии за короткую позицию по опционам нулевого страйка | O | Numeric(28,8) |
| | Debit | **Для типа обязательств TRADE:**<br>Размер исходящей короткой позиции по фьючерсному контракту / опциону<br><br>**Для типа обязательств PREMIUM:**<br>Итоговое нетто-обязательство по уплате премии<br><br>**Для типа обязательств EXECUTION_RESULT:**<br>Итоговое нетто-обязательство по уплате по Основному обязательству в результате исполнения опциона<br><br>**Для типа обязательств VARMARGIN:**<br>Итоговое нетто-обязательство по уплате вариационной маржи | M | Numeric(28,8) |
| | Credit | **Для типа обязательств TRADE:**<br>Размер исходящей длинной позиции по фьючерсному контракту / опциону<br><br>**Для типа обязательств PREMIUM:**<br>Итоговое нетто-требование по уплате премии<br><br>**Для типа обязательств EXECUTION_RESULT:**<br>Итоговое нетто-требование по уплате по Основному обязательству в результате исполнения опциона<br><br>**Для типа обязательств VARMARGIN:**<br>Итоговое нетто-требование по уплате вариационной маржи | M | Numeric(28,8) |
| /RECORDS | | | M | |
| /POSTYPES | | | M | |
| /SETTLEDATE | | | M | |
| /SETTLE | | | M | |
| /CLIENT | | | M | |
| /FIRM | | | M | |
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

**MFB24 Отчет об обязательствах по исполнению опционов**

Формируется по итогам вечернего клиринга для расчетов по итогам торгов.

Формируется в дополнительной рассылке с промежуточными данными на момент формирования

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | | M | |
| DOC_REQUISITES | | | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронногоДокументооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | REPORT | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB24 | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | String(0-16) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-512) |
| CLRACC | | Блок данных по ТКС | | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-12) |
| SETTLEDATE | | Блок данных по дате исполнения | | |
| | SettleDate | Дата расчетов по премии | O | Date |
| CURRENCY | | Блок данных по  валюте расчетов | | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты премии | O | String(0-4) |
| | CurrencyName | Наименование валюты премии | O | String(0-30) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| OPTIONPOSITION | | Блок данных по позициям по опционам | | |
| | OptionCode | Код опциона | M | String(0-12) |
| | OptionName | Наименование опциона | M | WString(0-120) |
| | BaseAssetCode | Код базисного актива | M | WString(0-20) |
| | IsDeliveryType | Тип исполнения опциона:<br>0 – Расчетный;<br>1 – Поставочный. | M | Integer |
| | OptionPosStart | Позиция на начало дня | O | Numeric(20,6) |
| | OptionPosEnd | Позиция  на конец дня | O | Numeric(20,6) |
| EXECUTION | | Блок данных по договору ПФИ | | |
| | ClientCode | Краткий код клиента Участника клиринга или Субклиента | M | String(0-12) |
| | ExecQty | Количество исполненных опционов | M | Integer |
| | ExecType | Способ исполнения опциона:<br>1 - Исполнение  досрочно – «в деньгах»<br>2 - Исполнение  досрочно – «вне денег»<br>3 - Исполнение  в дату экспирации – «в деньгах»<br>4 - Исполнение в дату экспирации – «вне денег»<br>5 - Отказ от исполнения (только для поставочных опционов) | M | Integer |
| | DealId | Идентификатор сделки | O | BigInt |
| | Cash | Размер денежной выплаты для расчетного опциона | O | Numeric(20,6) |
| | ExecComm | Комиссия за исполнение опциона | O | Numeric(20.6) |
| /EXECUTION | | | M | |
| /OPTIONPOSITION | | | M | |
| /CURRENCY | | | | |
| /SETTLEDATE | | | M | |
| /CLRACC | | | M | |
| /FIRM | | | M | |
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

**MFB66(SD) Отчет по денежным средствам и ценным бумагам Участника клиринга, не включенным в Средства обеспечения и Гарантийный фонд**

Отчет MFB66 формируется по итогам клиринга по Участнику клиринга.
Отчет MFB66SD формируется по итогам клиринга по заявлению Участника клиринга, содержит информацию по ТКС, с указанием субсчета депо, открытого для данного Депозитария.

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | | M | |
| DOC_REQUISITES | | | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | REPORT | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB66 | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Наименование Участника клиринга | M | WString(0-512) |
| | Volume | Том отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов отчета | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | M | String(0-20) |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | String(0-16) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-512) |
| SETTLE | | Блок данных по ТКС | M | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-12) |
| | GuaranteeFund | Признак ТКС для учета взносов в ККО | M | Y_N_Type |
| POSTYPES | | Блок информации по типам активов | M | |
| | PosType | **C** – денежные средства<br>**S** – ценные бумаги | M | Char |
| GROUP | | Блок данных по обязательствам | | |
| | DepoAccount | Номер субсчета депо (для ценных бумаг) | O | String(0-32) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | DepoSection | Номер раздела субсчета депо (для ценных бумаг) | O | String(0-32) |
| | GroupType | Тип учета<br><br>WDRAW – заблокировано для вывода;<br>MOVED – заблокировано для перевода;<br>BLOCKED – заблокировано по решению КЦ;<br>ARREST – арест. | M | String(0-32) |
| RECORDS | | Блок данных по обязательствам | M | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты расчётов (для денежных средств) | M | String(0-12) |
| | CurrencyName | Наименование валюты расчётов (для денежных средств) | M | WString(0-30) |
| | SecurityId | Идентификатор инструмента | M | String(0-32) |
| | ISIN | Международный идентификатор ценной бумаги | M | String(0-32) |
| | SecShortName | Краткое наименование инструмента | M | WString(0-256) |
| | OpeningBalance | Входящий остаток | M | Numeric(28,8) |
| | ClosingBalance | Исходящий остаток | M | Numeric(28,8) |
| | DebitSum | Итого по дебету | M | Numeric(28,8) |
| | CreditSum | Итого по кредиту | M | Numeric(28,8) |
| ENTRY | | Данные по операциям с сессией создания или исполнения | | |
| | OperationCode | Код операции с Обеспечением:<br><br>1- внесение/возврат Средств обеспечения по поручению Участника клиринга<br>2- внесение/возврат Средств обеспечения на основании перевода между регистрами по поручению Участника клиринга<br>5- исполнение обязательств/требований по Договорам с наступившей Датой исполнения<br>18- внесение/возврат средств в/из Гарантийный (ого) Фонд (а);<br>28 – внесение/возврат Средств обеспечения в результате корпоративных действий<br>45 – внесение / возврат Средств обеспечения при аресте и снятии ареста<br>48 - блокировка / разблокировка Средств обеспечения по распоряжению КЦ | M | String(0-3) |
| | OperationDate | Дата операции | M | Date |
| | OperationTime | Время операции | M | Time |
| | DocNo | Номер документа | M | String(0-32) |
| | CustomerNo | Номер документа, присвоенный Участником клиринга (при наличии) | O | String(0-32) |
| | Purpose | Пояснения к операции (при наличии) | O | WString(0-512) |
| | Debit | Дебет | M | Numeric(28,8) |
| | Credit | Кредит | M | Numeric(28,8) |
| /ENTRY | | | | |
| WAITING_ENTRY | | Данные по операциям, ожидающим исполнения | | |
| | OperationCode | Код операции с Обеспечением:<br><br>1- внесение/возврат Средств обеспечения по поручению Участника клиринга<br>2- внесение/возврат Средств обеспечения на основании перевода между регистрами по поручению Участника клиринга<br>5- исполнение обязательств/требований по Договорам с наступившей Датой исполнения<br>18- внесение/возврат средств в/из Гарантийный (ого) Фонд (а);<br>28 – внесение/возврат Средств обеспечения в результате корпоративных действий | M | String(0-3) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 45 – внесение / возврат Средств обеспечения при аресте и снятии ареста<br>48 - блокировка / разблокировка Средств обеспечения по распоряжению КЦ | | |
| | OperationDate | Дата операции | M | Date |
| | OperationTime | Время операции | M | Time |
| | DocNo | Номер документа | M | String(0-32) |
| | CustomerNo | Номер документа, присвоенный Участником клиринга (при наличии) | O | String(0-32) |
| | Purpose | Пояснения к операции (при наличии) | O | WString(0-512) |
| | Debit | Дебет | M | Numeric(28,8) |
| | Credit | Кредит | M | Numeric(28,8) |
| /WAITING_ENTRY | | | | |
| /RECORDS | | | | |
| /GROUP | | | | |
| /POSTYPES | | | | |
| /SETTLE | | | | |
| /FIRM | | | | |
| /REPORT | | | | |
| /RTS_DOC | | | | |

**MFB76 Отчет о взносах в Гарантийный фонд**

Формируется по итогам основного клиринга

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | | M | |
| DOC_REQUISITES | | | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | REPORT | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB76 | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Краткое наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Том отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов отчета | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| GUARANTEE | | Блок данных о взносах в ККО | M | |
| | GuaranteeCurrency | Идентификатор валюты ККО | O | String(0-12) |
| | GuaranteeCurrencyName | Наименование валюты ККО | O | WString(0-30) |
| | GFObligation | Обязательство по взносу в ККО | M | Numeric(28,8) |
| | GFContribution | Величина взноса Участника клиринга в ККО | M | Numeric(28,8) |
| | ContributionSharePart | Доля взноса Участника клиринга в ККО | M | Numeric(28,8) |
| ASSET | | Блок данных по взносу в Гарантийный фонд | O | |
| | AssetType | Тип актива:<br>**R** - российские рубли<br>**S** - ценные бумаги<br>**C** - иностранная валюта | M | Char |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты взноса | O | String(0-12) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | CurrencyName | Наименование валюты взноса | O | WString(0-30) |
| | SecurityId | Идентификатор ценной бумаги | O | String(0-32) |
| | ISIN | Международный идентификатор ценной бумаги | O | String(0-32) |
| | ContributionValue | Оценка размера внесенного обеспечения в валюте ККО с учетом дисконта | M | Numeric(28,8) |
| /ASSET | | | O | |
| /GUARANTEE | | | M | |
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

**MFB82 Уведомление о присвоении Регистрационных кодов / регистрации Кратких кодов клиентов Участника клиринга и (или) Участника клиринга**
Формируется по итогам вечернего клиринга.
Удаленные клиенты отображаются в отчете только в день удаления.
В отчете отражаются все зарегистрированные клиенты за весь период.

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | | M | |
| DOC_REQUISITES | | | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | REPORT | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB82 | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата, за которую формируется отчет | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Краткое наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | String(0-16) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-512) |
| RECORDS | | Блок данных о клиентах | M | |
| | ClientCode | Краткий код клиента Участника клиринга или Субклиента | M | String(0-12) |
| | Principal | Идентификация лица, для которого зарегистрированы коды (учетный регистр) – клиент Участника клиринга или Участник клиринга<br>**Y** –Участник клиринга<br>**N** – клиент (клиент клиента) Участника клиринга | M | Char |
| | Type | Тип клиента/ Участника клиринга | M | String(0-3) |
| | Details | ИНН / TIN или № паспорта клиента или иной код клиента/ Участника клиринга | M | WString(0-256) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | CountryCode | Код страны | O | String(0-3) |
| | Q_Investor | Признак квалифицированного инвестора:<br>**Y** –да<br>**N** – нет. | O | Char |
| | IdentificationCode | Регистрационный код клиента/ Участника клиринга | M | WString(0-256) |
| | CheckCrossMarket | Признак совершения кросс-маркетных сделок | O | Y_N_type |
| | IndividualInvestmentAccount | Признак ИИС:<br>**Y** –да<br>**N** – нет. | O | Char |
| | ForeignSecurityClientProhibition | Признак наличия ограничения на операции с иностранными акциями, требующими проведения тестирования | O | Y_N_type |
| | UnquotRuSecurityClientProhibition | Признак наличия ограничения на операции с российскими акциями, не включенными в котировальные списки | O | Y_N_type |
| | UnratedRuBondClientProhibition | Признак наличия ограничения на операции с облигациями российских эмитентов, которым не присвоен кредитный рейтинг либо кредитный рейтинг которых ниже уровня, установленного Советом директоров ЦБ РФ | O | Y_N_type |
| | ForeignBondClientProhibition | Признак наличия ограничения на операции с облигациями иностранных эмитентов, исполнение обязательств по которым обеспечивается за счет юридического лица РФ, не имеющего кредитного рейтинга или кредитный рейтинг которого ниже уровня, установленного Советом директоров ЦБ РФ | O | Y_N_type |
| | StructuredBondClientProhibition | Признак наличия ограничения на операции со структурными облигациями | O | Y_N_type |
| | StructuredIncomeBondClientProhibition | Признак наличия ограничения на операции с облигациями со структурным доходом | O | Y_N_type |
| | ClosedFundClientProhibition | Признак наличия ограничения на операции с ЗПИФ | O | Y_N_type |
| | DelistedClientProhibition | Признак наличия ограничения на операции с ценными бумагами, являющимися предметами Внебиржевых договоров купли-продажи ОТС, возникшими в результате корпоративных событий с ценными бумагами, допущенными к организованным торгам, проводимыми ПАО «СПБ Биржа» | O | Y_N_type |
| | Status | Статус Участника клиринга<br>A – допущен или возобновлен<br>N – приостановление действия допуска<br>D – допуск прекращен<br><br>Статус клиентов (клиентов клиентов) Участника клиринга<br>a – зарегистрирован или возобновлен<br>n – приостановление действия регистрации<br>d – регистрация прекращена | M | Chan |
| | DateOpen | Дата регистрации клиента | M | Date |
| | DateClose | Дата удаления клиента | O | Date |
| | DataChanged | Индикатор изменений<br>**Y** – сегодня произошли изменения<br>**N** – сегодня изменений не происходило | M | Char |
| /RECORDS | | | M | |
| /FIRM | | | M | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

**MFB98 Отчет о глобальных операциях и об обязательствах/требованиях по передаче Дохода**

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

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | Корневой элемент (root element) XML документа | M | |
| DOC_REQUISITES | | Блок информации о документе | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | REPORT | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/ EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB98 | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата отчета | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Краткое наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | String(0-12) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-512) |
| SETTLE | | Блок данных по ТКС | M | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-12) |
| GROUP | | Блок данных по обязательствам | O | |
| | BankAccCode | Код денежного регистра | O | String(0-64) |
| | GuarDepUnitId | Счет (субсчет) депо для учета ценных бумаг | O | String(0-64) |
| RECORDS | | Блок данных по обязательствам | M | |
| | TradeNo | Номер договора в Системе торгов | M | Integer |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | TradeNoOtc | Номер договора OTC | O | String(0-64) |
| | OperationNo | Номер операции по передаче Дохода/ ценных бумаг | O | Integer |
| | ClientCode | Краткий код клиента Участника клиринга или Субклиента | O | String(0-12) |
| | TradeDate | Дата заключения договора | M | Date |
| | SettleDate1 | Дата исполнения 1-ой части | M | Date |
| | SettleDate2 | Дата исполнения 2-ой части (если есть) | O | Date |
| | DebitCredit | Направленность обязательства по передаче Дохода/по передаче ценных бумаг<br>**D** – Обязательство<br>**C**- Требование | M | Char |
| | TradeSpecialType | Признаки сделки в рамках функционала QDD<br>SHORT_DONOR - Исходный продавец покрытия для непокрытой продажи (шорта)<br>SHORT_SELLER - Конечный покупатель покрытия для своей непокрытой продажи (шорта)<br>SHORT_TRANSIT - Транзитная сделка репо для передачи покрытия для непокрытой продажи (шорта)<br>LONG_BENE - Исходный продавец по первой сделке репо<br>LONG_TRANSIT - Транзитная сделка репо<br>LONG_LAST - Конечный покупатель по сделке репо<br>CORRECTION – корректирующие обязательства к ранее исполненным обязательствам | O | Char(32) |
| | SecurityId | Идентификатор инструмента | M | String(0-32) |
| | SecShortName | Краткое наименование инструмента | O | WString(0-256) |
| | ISIN | ISIN ценной бумаги по договору | O | String(32) |
| | Quantity | Объём договора, в ценных бумагах | M | Numeric(28,8) |
| | Type | Вид дохода/операции:<br>**DIVIDEND_PAYMENT** - дивиденды<br>**COUPON_PAYMENT** – купонный доход<br>**STOCK_SPLIT** – начисление ценных бумаг в связи с проведением дробления<br>**REVERSE_SPLIT** – списание ценных бумаг в связи с проведением консолидации<br>**SPIN_OFF** – выделение компании | M | String(0-32) |
| | RecordDate | Дата закрытия реестра по корпоративному событию | M | Date |
| | PaymentDate | Дата проведения корпоративного события эмитентом | M | Date |
| | ObligationDate | Дата передачи Дохода/ ценных бумаг/корректировка обязательств КЦ | M | Date |
| | FullNetto | Способ исполнения обязательств по передаче Дохода:<br>атрибут не указывается, если Дата исполнения не наступила<br>**Y** - исполнение обязательств зачетом (атрибут OperationNo не заполняется)<br>**N** - перевод активов при исполнении нетто-обязательств (атрибут OperationNo заполняется) | O | Char |
| | NewSecurityId | Идентификатор ценной бумаги, начисляемой как дополнительное обязательство или дивиденды в натуральной форме | O | String(0-32) |
| | NewSecShortName | Краткое наименование ценной бумаги, начисляемой как дополнительное обязательство или дивиденды в натуральной форме | O | WString(0-256) |
| | NewISIN | ISIN ценной бумаги, начисляемой как дополнительное обязательство или дивиденды в натуральной форме | O | String(32) |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты Доходов (указывается при выплате доходов в денежной форме) | O | String(0-4) |
| | CurrencyName | Наименование валюты Доходов (указывается при выплате доходов в денежной форме) | O | WString(0-32) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | Price | Доход на одну ценную бумагу (купон или амортизация)/ количество ценных бумаг, начисляемое / списываемое на одну ценную бумагу | M | Numeric(28,8) |
| | TaxRate | Ставка налога на дивиденды (в долях единицы) | O | Numeric(28,8) |
| | Sum | Сумма обязательства / требования по передаче Дохода/ ценных бумаг | M | Numeric(28,8) |
| /RECORDS | | | M | |
| /GROUP | | | M | |
| /SETTLE | | | M | |
| /FIRM | | | M | |
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

**MFB98A Уведомление о размере обязательств/требований по передаче Дохода**

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

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | Корневой элемент (root element) XML документа | M | |
| DOC_REQUISITES | | Блок информации о документе | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в системе ЭДО | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | REPORT | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код ЭДО получателя | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB98A | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата отчета | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Краткое наименование Участника клиринга | O | WString(0-512) |
| | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC_INFO | | | | |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | String(0-12) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-512) |
| SETTLE | | Блок данных по ТКС | M | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-12) |
| GROUP | | Блок данных по обязательствам | O | |
| | BankAccCode | Код денежного регистра | O | String(0-64) |
| | GuarDepUnitId | Счет (субсчет) депо для учета ценных бумаг | O | String(0-64) |
| RECORDS | | Блок данных по обязательствам | M | |
| | TradeNo | Номер договора в Системе торгов | M | Integer |
| | TradeNoOtc | Номер договора ОТС | O | String(0-64) |
| | ClientCode | Краткий код клиента  Участника клиринга или Субклиента | O | String(0-12) |
| | TradeDate | Дата заключения договора | O | Date |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | SettleDate1 | Дата исполнения 1-ой части | O | Date |
| | SettleDate2 | Дата исполнения 2-ой части | O | Date |
| | DebitCredit | Направленность обязательства по передаче Дохода<br>**D** – Обязательство<br>**C**- Требование | M | Char |
| | TradeSpecialType | Признаки сделки в рамках функционала QDD<br>SHORT_DONOR- Исходный продавец покрытия для непокрытой продажи (шорта)<br>SHORT_SELLER- Конечный покупатель покрытия для своей непокрытой продажи (шорта)<br>SHORT_TRANSIT- Транзитная сделка репо для передачи покрытия для непокрытой продажи (шорта)<br>LONG_BENE - Исходный продавец по первой сделке репо<br>LONG_TRANSIT - Транзитная сделка репо<br>LONG_LAST - Конечный покупатель по сделке репо<br>CORRECTION – корректирующие обязательства к ранее исполненным обязательствам | O | Char(32) |
| | SecurityId | Идентификатор ценной бумаги | M | String(0-32) |
| | SecShortName | Краткое наименование ценной бумаги | O | WString(0-256) |
| | ISIN | ISIN ценной бумаги | O | String(32) |
| | Quantity | Объём договора, в ценных бумагах | M | Numeric(28,8) |
| | Type | Вид дохода:<br>**DIVIDEND_PAYMENT** – дивиденды<br>**COUPON_PAYMENT** – купонный доход | M | String(0-32) |
| | RecordDate | Дата закрытия реестра по корпоративному событию | M | Date |
| | PaymentDate | Дата проведения корпоративного события эмитентом | M | Date |
| | ObligationDate | Дата передачи Дохода (дивидендов) КЦ | M | Date |
| | NewSecurityId | Идентификатор ценной бумаги, начисляемой как дивиденды акциями | O | String(0-16) |
| | NewSecShortName | Краткое наименование ценной бумаги, начисляемой как дивиденды акциями | O | WString(0-30) |
| | NewISIN | ISIN ценной бумаги, начисляемой как дивиденды акциями | O | String(32) |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты Доходов (указывается при выплате доходов в денежной форме) | O | String(0-12) |
| | CurrencyName | Наименование валюты Доходов (указывается при выплате доходов в денежной форме) | O | WString(0-30) |
| | Price | Доход на одну ценную бумагу (размер дивиденда, купон или амортизация) | M | Numeric(28,8) |
| | TaxRate | Ставка налога на денежный Доход ( в долях единицы) | O | Numeric(28,8) |
| | Sum | Сумма обязательства/требования по передаче Дохода | M | Numeric(28,8) |
| /RECORDS | | | M | |
| /GROUP | | | M | |
| /SETTLE | | | M | |
| /FIRM | | | M | |
| /REPORT | | | M | |
| /RTS_DOC | | | M | |

**MFB99(SD) Отчет об обеспечении**

Отчет MFB99 формируется по итогам клиринга по Участнику клиринга.
Отчет MFB99SD формируется по итогам клиринга по заявлению Участника клиринга, содержит информацию по ТКС, с указанием субсчета депо, открытого для данного Депозитария.

| Название элемента | Название атрибута | Описание | M/O | Тип |
|---|---|---|---|---|
| RTS_DOC | | Корневой элемент (root element) XML документа | M | |
| DOC_REQUISITES | | Блок информации о документе | M | |
| | DOC_DATE | Дата формирования документа | M | Date |
| | DOC_TIME | Время формирования документа (MSK) | M | Time |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в Системе электронного документооборота | M | String(0-20) |
| | DOC_TYPE_ID | REPORT | M | String(0-20) |
| | SENDER_ID | **MFBIM** | M | String(3-7) |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | O | WString(0-512) |
| | RECEIVER_ID | Код получателя в Системе электронного документооборота | M | String(3-7) |
| | REMARKS | Текст примечания к документу | O | WString(0-120) |
| /DOC_REQUISITES | | | M | |
| REPORT | | Блок данных отчета | M | |
| DOC_INFO | | | | |
| | ReportLang | RU/EN | M | String(0-2) |
| | ReportCode | MFB99 | M | String(0-20) |
| | ReportDate | Дата отчета | M | Date |
| | ReportDesc | Описание отчета | O | WString(0-512) |
| | ReportVersion | Версия формата отчета | O | String(1-3) |
| | Weekday | День недели для даты отчета | O | WString(0-20) |
| | MainFirmId | Идентификатор Участника клиринга | M | String(0-16) |
| | MainFirmName | Краткое наименование Участника клиринга | M | WString(0-512) |
| | Volume | Том отчета | O | Integer |
| | VolumeTotal | Всего томов отчета | O | Integer |
| | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | M | String(0-16) |
| /DOC_INFO | | | | |
| FIRM | | Блок данных по Участнику торгов | M | |
| | FirmID | Идентификатор Участника торгов | M | String(0-16) |
| | FirmName | Краткое наименование Участника торгов | O | WString(0-512) |
| SETTLE | | Блок данных по ТКС | M | |
| | ClrAccCode | Код ТКС | M | String(0-12) |
| | GuaranteeFund | Признак ТКС для учета взносов в ККО | O | Y_N_Type |
| POSTYPES | | Блок информации по типам обязательств | M | |
| | PosType | **C** - информация о средствах, учитываемых на денежном регистре<br>**S** - информация позициях, учитываемых на депо регистре | M | Char |
| GROUP | | Блок данных по обязательствам | M | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | BankAccCode | Код денежного регистра | O | String(0-64) |
| | GuarDepUnitId | Счет (субсчет) депо для учета ценных бумаг | O | String(0-64) |
| RECORDS | | Блок данных по обязательствам | M | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты средств обеспечения | O | String(0-12) |
| | CurrencyName | Наименование валюты средств обеспечения | O | WString(0-30) |
| | SecurityId | Идентификатор инструмента | O | String(0-32) |
| | ISIN | Международный идентификатор ценной бумаги | O | String(0-32) |
| | SecShortName | Краткое наименование инструмента | O | WString(0-256) |
| | OpeningBalance | Входящий остаток | M | Numeric(28,8) |
| | ClosingBalance | Исходящий остаток | M | Numeric(28,8) |
| | OpeningDebtsSum | Задолженность по денежному регистру на начало отчетного периода | O | Numeric(28,8) |
| | DebtsSum | Задолженность по денежному регистру на конец отчетного периода | O | Numeric(28,8) |
| | DebitSum | Итого по дебету | M | Numeric(28,8) |
| | CreditSum | Итого по кредиту | M | Numeric(28,8) |
| ENTRY | | Блок данных по операции | M | |
| | OperationCode | Код операции с Обеспечением:<br>1- внесение/возврат средств обеспечения/<br>2- внесение/возврат средств обеспечения на основании перевода между регистрами, осуществленного Участником;<br>5- исполнение обязательств / требований по договорам с наступившей Датой исполнения;<br>8 – обязательства по передаче дохода/ценных бумаг;<br>9- списание/ зачисление вариационной маржи;<br>10- списание оборотной части/начисление возвратной премии по комиссионному вознаграждению за организацию торгов;<br>11- списание оборотной части/начисление возвратной премии по клиринговой комиссии;<br>12- списание оборотной части/начисление возвратной премии по лицензионному вознаграждению;<br>13- списание ежемесячного торгового сбора;<br>14- списание ежемесячной клиринговой комиссии;<br>15- списание ежемесячного лицензионного вознаграждения;<br>16- списание штрафа за возникновение задолженности по денежному регистру;<br>17- списание комиссии за принудительное закрытие позиции;<br>18- внесение/возврат средств в Гарантийный Фонд;<br>19- списание штрафа за невыполнение донорских обязательств;<br>20- списание/начисление штрафа в связи с заключением с КЦ договоров репо (двух договоров купли-продажи) с целью урегулирования возможного неисполнения обязательств и с целью исполнения обязательств по договорам<br>21- списание штрафа за неисполнение обязательств перед другим участником клиринга (по внебиржевым договорам)<br>22- списание/начисление компенсации при принудительном закрытии Участника клиринга при наличии возможного неисполнения обязательств | M | String(1-3) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 23- списание/зачисление денежных средств при проведении процедуры замены валюты денежных средств обеспечения<br>24- списание клиринговой комиссии за списание с Торгового счета/Субсчета депо ценных бумаг иностранного эмитента, учитываемых в качестве Средств обеспечения Участника клиринга, на основании поручения на списание ценных бумаг или на основании поручения на перевод ценных бумаг, если в качестве счета депо зачисления указывается не Торговый счет/Субсчет депо, в количестве, превышающем совокупное количество ценных бумаг данного иностранного эмитента, внесенных в качестве Средств обеспечения данным Участником клиринга, а также полученных на Торговый счет депо/Субсчет депо в результате осуществления глобальной операции с ценными бумагами<br>25- списание клиринговой комиссии за проведение процедуры замены валюты денежных средств обеспечения<br>28. ввод-вывод активов в результате корпоративных действий<br>29. списание клиринговой комиссии за:<br>1) договоры репо, заключённые в Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» на основании Заявок, в которых указаны торгово-клиринговые счета, зарегистрированные на одного Участника торгов,<br>2) внебиржевые договоры репо ОТС (Пары внебиржевых договоров ОТС), заключённые на основании Оферты ОТС типа 2, и связанные Внебиржевые договоры репо ОТС (связанные Пары внебиржевых договоров ОТС), заключенные на основании связанной Оферты ОТС, при условии направления Оферты ОТС типа 2, в которых указаны торгово-клиринговые счета, зарегистрированные на одного Участника клиринга,<br>предметом которых являются ценные бумаги, относящиеся к Группе инструментов «иностранные ценные бумаги», и из Внебиржевых договоров ОТС, за исключением Внебиржевых договоров ОТС, предметом которых являются ценные бумаги российских эмитентов и иностранные финансовые инструменты, квалифицированные в качестве облигаций и номинированные в валюте, отличной от российского рубля<br>30. списание клиринговой комиссии за:<br>1) договоры репо, заключённые в Режиме торгов «Адресное репо с Центральным контрагентом» на основании Заявок, в которых указаны торгово-клиринговые счета, зарегистрированные на одного Участника торгов,<br>2) внебиржевые договоры репо ОТС (Пары внебиржевых договоров ОТС), заключённые на основании Оферты ОТС типа 2, и связанные Внебиржевые договоры репо ОТС (связанные Пары внебиржевых договоров ОТС), заключенные на основании связанной Оферты ОТС, при условии направления Оферты ОТС типа 2, в которых указаны торгово-клиринговые счета, зарегистрированные на одного Участника клиринга, предметом которых являются ценные бумаги, относящиеся к Группе инструментов «еврооблигации», и из Внебиржевых договоров ОТС, предметом которых являются финансовые инструменты, квалифицированные в качестве облигаций и номинированные в валюте, отличной от российского рубля<br>31 - списание клиринговой комиссии за ведение клиринговых регистров УК в целях ведения отдельного учета в рамках ТКС, зарегистрированного для отдельного клиента УК<br>32 - списание клиринговой комиссии за возврат Средств обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 33- списание клиринговой комиссии за ведение клиринговых регистров Участника клиринга, допущенного к клиринговому обслуживанию<br>34- списание клиринговой комиссии за проведение расчетов по итогам клиринга договоров<br>35 - списание биржевой комиссии за торговлю в дополнительную утреннюю сессию<br>36– иные сборы<br>37 - списание клиринговой комиссии за обработку депо-поручений на ввод, вывод и перевод по субсчетам<br>38 - списание клиринговой комиссии за учет индивидуального клирингового обеспечения в Евро<br>39 - списание клиринговой комиссии за учет коллективного клирингового обеспечения в Евро<br>40 - списание клиринговой комиссии за обработку форм W8-BEN<br>41 - списание клиринговой комиссии за обработку форм при выплате доходов и раскрытие бенефициаров<br>42 - возмещение расходов КЦ, связанных с выплатой дохода по ценным бумагам<br>43 - возмещение иных расходов КЦ<br>44 - Процентный доход<br>45 - Ввод-вывод средств ГО при аресте и снятии ареста<br>46 - Возмещение расходов на обслуживание Субсчета депо<br>47 - Биржевая комиссия за сделки клиентов категории А<br>48 - Блокировка и разблокировка активов по распоряжению Клирингового Центра<br>49 - Выплата дивидендного и иного дохода<br>50 - Возмещение расходов за обслуживание депозитарных расписок<br>51 - Возмещение расходов, связанных с проведением корпоративных событий<br>52 - Эквивалент транзакционного налога<br>53 – Возмещение расходов КЦ за хранение ценных бумаг<br>55 - - Клиринговый сбор за обработку поручений на перевод ценных бумаг внутри субсчета депо<br>58 - Предоставление заемных средств (Адресное размещение)<br>59 - Возврат заемных средств (Адресное размещение)<br>60 - Комиссия за предоставление заемных средств (Адресное размещение)<br>61 - Возмещение расходов за обработку депо-поручений на ввод, вывод и перевод по субсчетам и разделам субсчетов<br>62 - Возмещение расходов за обработку поручений на перевод ценных бумаг внутри субсчета депо<br>63 - Возмещение расходов за инвентарные операции по субсчетам депо<br>67 - Комиссия за исполнение опциона<br>68 - Комиссия за расчетное исполнение опциона нулевого страйка<br>69 - Комиссия за конвертацию опциона нулевого страйка<br>70 - Комиссия за отрицательную позицию по опционам нулевого страйка<br>71 Комиссия за Договоры ПФИ<br>74 – Комиссия за учет позиций по фьючерсным контрактам<br>78 – Вариационная маржа, связанная с отклонением цены фьючерсного контракта от цены базисного актива | | |
| | Purpose | Пояснения к операции (если есть) | O | WString(512) |
| | OperationTime | Время проведения операции в учете КЦ (MSK) | O | Time |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | DocNo | Номер документа, присвоенный КЦ | O | String(0-32) |
| | CustomerNo | Номер документа, присвоенный участником (если есть) | O | String(0-32) |
| | Debit | Дебет | M | Numeric(28,8) |
| | Credit | Кредит | M | Numeric(28,8) |
| | ClientCode | Краткий код клиента Участника клиринга или Субклиента, указанный в заявлении на операцию с активами (при наличии) | O | String(0-12) |
| /ENTRY | | | | |
| /RECORDS | | | | |
| /GROUP | | | | |
| /POSTYPES | | | | |
| /SETTLE | | | | |
| /FIRM | | | | |
| /REPORT | | | | |
| /RTS_DOC | | | | |

**Требования к формированию имени файлов отчетов, уведомлений, выписок, направляемых по Системе электронногодокументооборота**

Архив с отчетами предоставляется в формате многотомного ZIP-пакета, с указанием порядкового номера архива. Для предоставления отчетов используется адрес ЭДО FIRMM@REPORT или Сервис API.

| Вид документа | Тип сообщения в Сервисе API | Префикс имени файла для архива с отчетами | Пояснения |
|---|---|---|---|
| 1. Архив клиринговых отчетов, содержащий:<br>MFB98A Уведомление о размере обязательств / требований по передаче Дохода | MFB_0<br><br>MFB_0_CORRECTION | MFB<YYYYMMDD>_0;<br><br>MFB<YYYYMMDD>_0_ CORRECTION | Архив с отчетами;<br><br>Скорректированный архив с отчетами |
| 2. Архив клиринговых отчетов, содержащий:<br>MFB14 Отчет о Гарантийном обеспечении,Маржинальном требовании и Задолженности | MFB_1<br><br>MFB_1_CORRECTION | MFB<YYYYMMDD>_1;<br><br>MFB<YYYYMMDD>_1_ CORRECTION | Архив с отчетами по итогам основного клиринга;<br><br>Скорректированный архив с отчетами |
| 3. **Основная рассылка (окончательных отчетов**)<br>Архив клиринговых отчетов, содержащий:<br>MFB06 Отчет об обязательствах, допущенных в клиринг, кроме обязательств по Договорам ПФИ (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг)<br>MFB06C Отчет об обязательствах, допущенных в клиринг, кроме обязательств по Договорам ПФИ (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга)<br>MFB07 Отчет об обязательствах по Договорам ПФИ (Опционы), допущенных в клиринг (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг)<br>MFB07C Отчет об обязательствах по Договорам ПФИ (Опционы), допущенных в клиринг (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг, по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга)<br>MFB08 Отчет об обязательствах по Договорам ПФИ (Фьючерсные контракты), допущенных в клиринг (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг)<br>MFB08C Отчет об обязательствах по Договорам ПФИ (Фьючерсные контракты), допущенных в клиринг (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг, по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга)<br>MFB13 Отчет об итоговых нетто - обязательствах/нетто-требованиях<br>MFB15 Отчет по обязательствам Участникаклиринга по | MFB_2<br><br>MFB_2_CORRECTION | MFB<YYYYMMDD>_2;<br><br>MFB<YYYYMMDD>_2_CORRECTION | Архив с отчетами по итогам вечернегоклиринга;<br><br>Скорректированный архив с отчетами |

| | | | |
|---|---|---|---|
| комиссионному вознаграждению<br>MFB20 Уведомление о торгово-клиринговых счетах Участника клиринга<br>MFB21 Уведомление о счетах для вывода денежных средств Участника клиринга<br>MFB22 Отчет о требованиях по погашениюзадолженности по денежному регистру<br>MFB23 Отчет об обязательствах по договорам, кроме обязательств по Договорам ПФИ<br>MFB23C Уведомление об обязательствах по Договорам, кроме обязательств по Договорам ПФИ (по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга)<br>MFB23D Уведомление об обязательствах по Договорам ПФИ (по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга)<br>MFB24 Отчет об обязательствах по исполнению опционов<br>MFB66 Отчет по денежным средствам и ценным бумагам Участника клиринга, не включенным в Средства обеспечения и Гарантийный фонд<br>MFB76 Отчет о взносах в Гарантийный фонд<br>MFB82 Уведомление о присвоении Регистрационных кодов / регистрации Кратких кодов клиентов Участника клиринга и (или) Участника клиринга<br>MFB98 Отчет о глобальных операциях и об обязательствах/требованиях по передаче дохода<br>MFB98A Уведомление о размереобязательств/требований по передаче Дохода<br>MFB99 Отчет об обеспечении | | | |
| 4. Архив клиринговых отчетов, содержащий:<br>MFB18F Отчет о позиции по Фьючерсным контрактам | MFB_3<br><br>MFB_3_CORRECTION | MFB<YYYYMMDD>_3;<br><br>MFB<YYYYMMDD>_3_CORRECTION | Архив с отчетами по итогам вечернегоклиринга;<br><br>Скорректированный архив с отчетами |
| 5. Архив клиринговых отчетов, содержащий:<br>MFB17F Комиссия за учет позиций по фьючерсным контрактам и Вариационная маржа, связанная с отклонением цены фьючерсного контракта от цены базисного актива | MFB_0F<br><br>MFB_0F_CORRECTION | MFB<YYYYMMDD>_0F;<br><br>MFB<YYYYMMDD>_0F_ CORRECTION | Архив с отчетами;<br><br>Скорректированный архив с отчетами |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 6. Архив клиринговых отчетов, направляемый Депозитарию по заявлению от Участника клиринга, содержащий [3]:<br>MFB06SD Отчет об обязательствах, допущенных в клиринг, кроме обязательств по Договорам ПФИ (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг)<br>MFB66SD Отчет по денежным средствам и ценным бумагам Участника клиринга, не включенным в Средства обеспечения и Гарантийный фонд<br>MFB99SD Отчет об обеспечении | MFB_SD<br><br>MFB_SD_CORRECTION | Идентификатор Депозитария__MFB<YYYYMMDD>;<br><br>Идентификатор Депозитария _MFB<YYYYMMDD>_CORRECTION | Архив с отчетами;<br><br>Скорректированный архив с отчетами |
| 7. **Дополнительная рассылка (при необходимости)** | MFB_REPORT | MFB_REPORT_<YYYYMMDD> | Архив с отчетами; |

**Имя файлов для многотомных отчетов (кроме п.6) формируется следующим образом**:

Идентификатор_Код отчета_Дата отчета_Количество томов в отчете _Порядковый номер тома[4]
где

Идентификатор - идентификатор Участника клиринга;
Дата отчета в формате ГГГГ-ММ-ДД.

**Имя файлов для многотомных отчетов, указанных в п. 6, формируется следующим образом:**

Идентификатор 1_Идентификатор 2__Код отчета_Дата отчета_Количество томов в отчете[5] _Порядковый номер тома [6]
где

Идентификатор 1 - идентификатор Депозитария;
Идентификатор 2 - идентификатор Участника клиринга;
Дата отчета в формате ГГГГ-ММ-ДД.

[3] содержит отчеты по всем Участникам клиринга, зарегистрировавшим ТКС с указанием субсчета депо, открытого для данного Депозитария.
[4] Количество знаков в порядковом номере тома равно количеству знаков в количестве томов отчета
[5] количество томов в разрезе Депозитария
[6] нумерация томов в отчете в разрезе Депозитария