

# ЕТС. Изменения отчетов Срочного рынка.

Описание изменений к релизу Spectra-9.3.

# Оглавление

1	ВСТУПЛЕНИЕ.....	3
2	Цикл обработки сделок/обязательств за сессию .....	4
2.1	Торги .....	4
2.2	Клиринг.....	4
2.3	Расчеты .....	4
3	Описание изменений в отчетах.....	5
3.1	Сравнение отчетов до ЕТС и в ЕТС .....	5
3.2	Информация по сделкам .....	6
3.3	Информация по позициям.....	6
3.4	Информация по обеспечению, движение обеспечения за сессию и плановые обязательства/требования по итогам Клиринга .....	6
3.4.1	До ЕТС .....	6
3.4.2	В ЕТС информация по обеспечению .....	6
3.4.3	В ЕТС Плановые обязательства по итогам Клиринга.....	9
3.4.4	В ЕТС движение обеспечения за сессию.....	10
3.4.5	В ЕТС monsettl - Отчет по деньгам БФ/РФ по итогам Расчетной сессии.....	11
3.5	В ЕТС контрольные суммы и проверки для некоторых полей некоторых отчетов .....	11
3.6	Маржинальные требования .....	12
4	Список изменений в отчетах СР в рамках проекта Единая Торговая сессия.....	13
5	ПРИЛОЖЕНИЕ 1.....	22
5.1	Отчет MONXXYY.csv/MONCLXXYYZZZ.csv (Клиринговая сессия), MONSETTLE/MONSETTLCLXXYYZZZ.csv (Расчетная Сессия). Структура полей одинаковая. ....	22

6	ПРИЛОЖЕНИЕ 2.....	39
6.1	Отчет CHARGESXXYY.csv/CHARGESCLXXYYZZZ.csv. ....	39
6.1.1	Описание логики построения отчета .....	39
6.1.2	Формат отчета.....	39
7	ПРИЛОЖЕНИЕ 3.....	41
7.1	PayXXYY.csv, PayclXXYYZZZ.csv.....	41
7.1.1	Описание логики работы отчета .....	41
7.1.2	Формат отчета.....	41
8	ПРИЛОЖЕНИЕ 4.....	43
8.1	fposXXYY.csv, fposclXXYYZZZ.csv.....	43
8.2	oposXXYY.csv, oposclXXYYZZZ.csv.....	50
9	ПРИЛОЖЕНИЕ 5.....	56
9.1	Отчет F14.xlsx .....	56
10	Приложение 6. Отчет о маржинальных требованиях mtXX00.csv .....	65

## 1 ВСТУПЛЕНИЕ

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

### До ЕТС

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

### В ЕТС

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

### Отмена ПК

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

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

## 2 Цикл обработки сделок/обязательств за сессию

### 2.1 Торги

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

### 2.2 Клиринг

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

### 2.3 Расчеты

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

### 3 Описание изменений в отчетах

#### 3.1 Сравнение отчетов до ETC и в ETC

##### До ETC: что изменится в отчетах

Сейчас Расчеты Т+0	Информация по сделкам	Информация по позициям	Информация по обеспечению	Движение обеспечения за сессию
Отчет	f04, o04	fpos, opos	mon	Pay, paycb
Описание	<ul style="list-style-type: none"> <li>указана ВМ, премия и комиссия по сделкам</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>определенна ВМ по сделкам и ВМ по позициям на начало дня</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Итоги по РК, БФ, 7КК в RUR</li> <li>Значение <code>mon.pay</code> расшифровано в отчете <code>pay</code></li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Детализация платежей, кроме ВМ, премии и комиссии по безадресными сделкам</li> </ul>

В ETC Расчеты Т+1, появляется плановая и фактическая позиции в RUR

В ETC Расчеты Т+1	Информация по сделкам	Информация по позициям	Информация по обеспечению	Движение обеспечения за сессию, плановые обязательства
Отчет	f04, o04	fpos, opos	mon, monsettl	Pay, paycb, charges
Описание	<ul style="list-style-type: none"> <li>Расчеты на Т+1. ВМ, премия и комиссия по сделкам – это <b>начисленные</b> значения.</li> <li>Названия полей не изменились.</li> <li>Изменилось правило обработки указанной суммы.</li> <li>Добавлено поле <code>settle_date</code> – дата Расчетной сессии</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Расчеты на Т+1. ВМ по сделкам и ВМ по позициям на начало дня – это <b>начисленные</b> значения.</li> <li>Названия полей не изменились.</li> <li>Изменилось правило обработки указанной суммы.</li> <li>Добавлено поле <code>settle_date</code> – дата Расчетной сессии</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Итоги по РК, БФ, 7КК в RUR</li> <li>В отчет <b>добавлены поля</b> для начисленных сумм ВМ, премии и комиссии.</li> <li>Вместо поля <code>pay</code> появились поля <code>in_out_netto</code> и <code>charges</code></li> <li>Значение <code>mon.charges_mtm</code> расшифровано в новом отчете <code>charges</code></li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Pay – Детализация платежей, кроме ВМ, премии</li> <li><b>В Pay добавлены операции комиссии по безадресными сделкам</b></li> <li>Отчет Pay детализирует суммы <code>mon.in_out_netto</code> + <code>mon.charges</code></li> <li><b>Charges – детализация начисленных обязательств / требований</b></li> </ul>

### 3.2 Информация по сделкам

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

### 3.3 Информация по позициям

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

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

#### 3.4.1 До ЕТС

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

- Значение поля mon.rau расшифровано в отчете rau
- Отчет rau не включают комиссию за безадресные сделки. (Комиссия за безадресные сделки указана в полях mon.fut\_sbor, mon.opt\_sbor).

#### 3.4.2 В ЕТС информация по обеспечению:

Отчет mon:

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

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

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

- $mon.amount\_end\_mtm = mon.amount\_end + mtm = mon.amount\_end + var\_marg\_mtm + prem\_mtm + charges\_mtm$

### 3.4.3 В ЕТС Плановые обязательства по итогам Клиринга:

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

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

#### 3.4.4 В ЕТС движение обеспечения за сессию:

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

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

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

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

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

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

N	Отчет	Поле	Правила проверки
4.	Mon	var_marg_mtm	начисленная вармаржа по 7КК/БФ/РК <ul style="list-style-type: none"> <li>• Или сумма f04.var_marg_b / f04.var_marg_s + o04.var_marg_b / f04.var_marg_s</li> <li>• Или сумма fpos.var_marg_p + opos.var_marg_p</li> </ul>
5.	Mon	var_marg	расчеты по вармарже в Расчетную сессию Mon.var_marg_mtm в отчете mon за предыдущую Клиринговую сессию
6.	Mon	prem_mtm	начисленная премия по 7КК/БФ/РК <ul style="list-style-type: none"> <li>• Или сумма o04.prem_buy / f04.prem_sell</li> <li>• Или сумма opos.prem</li> </ul>
7.	Mon	prem	расчеты по премии в Расчетную сессию Mon.prem_mtm в отчете mon за предыдущую Клиринговую сессию
8.	Mon	Charges_mtm	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Значение расшифровано в новом отчете charges</li> <li>• Сумма всех комиссий по сделкам; ежемесячных/ежеквартальных комиссий; обязательных платежей; ручных списаний и корректировок с датой расчетов T+1</li> </ul>
9.	Mon	Charges + in_out_netto	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Значение расшифровано в отчете pay. Отчет pay в ЕТС включает платежи за безадресные сделки. До ЕТС была другая логика проверки и платежей за безадресные сделки не было в отчете pay</li> </ul>
10.	Mon	Charges	Mon.charges_mtm в отчете mon за предыдущую Клиринговую сессию + ручные корректировки с датой расчетов T, включая корректировки вармаржи

### 3.6 Маржинальные требования:

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

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

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

Наименование пакета	Наименование отчета	Описание изменений
		vat_ex vat_cc ext_rez
	persinvestXXYY.csv - Отчет об инвестиционных счетах	не меняется
	toeqXXYY.csv - Информация о привязке счетов на срочном и фондовом рынках	не меняется
	multileg_deal.csv - Отчет о связанных сделках	не меняется
	multileg_dict.csv - Отчет о связанных инструментах	не меняется
	multilegf04_XXYY.csv/multilegf04clXXYYZZZ.csv - Отчет о связанных сделках по РФ/БФ/клиента	Удаляются поля vat_ex_b vat_cc_b vat_ex_s vat_cc_s price_rur2
	f04_XXYY.csv/f04clXXYYZZZ.csv - Отчет о торгах фьючерсными контрактами по РФ/БФ/клиенту	Удаляются поля profit_usd vat_ex_b vat_cc_b vat_ex_s vat_cc_s
	o04_XXYY.csv/o04clXXYYZZZ.csv - Отчет о торгах опционными контрактами по РФ/БФ/клиенту	Удаляются поля profit_usd vat_ex_b vat_cc_b

Наименование пакета	Наименование отчета	Описание изменений
		vat_ex_s vat_cc_s
	f07.csv - Отчет о торгах фьючерсами	Удаляются поля: limit pr_setl - Расчетная цена в дневном клиринге (пункты) pr_settl_r - Расчетная цена в дневном клиринге в руб. spot- Признак инструментов «спот» - не используется base- Базовый контракт для инструментов «спот» - не используется
	007.csv/Отчет о торгах опционными контрактами	Удаляются поля pr_volat - Волатильность в дневном клиринге pr_theorpr - Теоретическая цена в дневном клиринга (пункты)
	fposXXYY.csv/fposclXXYYZZZ.csv - информация о позиционном состоянии участника клиринга/ Брокерской фирмы и их клиентов по фьючерсным контрактам/ коллатеральным инструментам	Полное описание - см. Приложение 2. Удаляются поля go_netto accum_go fee_trans vat_ex vat_cc pos_failed

Наименование пакета	Наименование отчета	Описание изменений
		var_marg_prom
	onlineregXXYY.csv/Отчет по клиентам, зарегистрированным онлайн	не меняется
	oposXXYY.csv/oposclXXYYZZZ.csv - Отчет по опционным позициям РФ/БФ/клиента	Удаляются поля: vat_ex vat_cc var_marg_prom prem_prom prem_prom_currency
	payXXYY.csv/ payclXXYYZZZ.csv Отчет по платежам РФ/клиентским платежам	Полное описание - см. Приложение 3 Удаляются поля: payer inn bik
	chargesXXYY.csv - отчет о начисленных комиссиях	Полное описание - см. Приложение 4
	paycbXXYY.csv/paycbXX00.csv - Информация об операциях с иностранной валютой, а также с Профилем актива, предоставленных в качестве Обеспечения по Участнику клиринг	не меняется
	riskparamsXXYY.csv/Отчет с коэффициентом prohibit_coeff по БФ	не меняется
	riskposXXYY.csv/Информация о позиционном состоянии по инструментам	Удаляются поля: free_risk
	toeqXXYY.csv/Информация о привязке счетов на срочном и фондовом рынках	не меняется

Наименование пакета	Наименование отчета	Описание изменений
	clientsXX00.csv/clientsXXYY.csv – информация о разделах клиринговых регистров	Удаляются поля: isrepo account_forts
	volat.csv/Параметры кривой волатильности	не меняется
	multilegordlog_XXYY.csv/Отчет по логу репо заявок РФ/БФ - фьючерсы	Удаляются поля: date_clr rate
	multilegorglog_trade_XXYY	Удаляются поля: date_clr rate
	moncbXXYY.csv - Движение денежных средств с учетом курса ЦБ	не меняется
	F14_XXYY.xls - Сводная финансовая ведомость	Полное описание - см. Приложение 5 Добавляется: Плановый Оборот за следующий день дебет кредит Плановый Баланс конец на следующего дня дебет кредит
TR_UPDYYYYMMDD.zip - Отчеты по транзакциям - Отчеты после Клиринговой сессии в 00:30		

Наименование пакета	Наименование отчета	Описание изменений
	tranerrXXYY.csv - Отчет по ошибочным транзакциям 3 РФ/БФ – отчет о количестве ошибочных транзакций по каждому логину	Не меняется
	tranerrfeeXXYY.csv - Отчет по ошибочным транзакциям 2 РФ/БФ – детализированный отчет о сборах за ошибочные транзакции по каждому логину	Не меняется
	tranfeeXXYY.csv - информация о сборах за транзакции по Участнику клиринга/ Брокерской фирмы и их клиентов.	Удаляются поля: vat_sbortr futopt mm addr4 fee
	usersXXYY.csv/ Отчет по ошибочным транзакциям РФ/БФ. информация об итоговом размере сбора	Не меняется
	tranfcfeeXXYY.csv - Отчет tranfcfee_csv по сбору за флуд	Не меняется
	usersfcXXYY.csv - Отчет users по сбору за флуд	Не меняется
EXCHANGEYYYYMMDD.zip - - Отчеты с биржевой информацией после Клиринговой сессии в 00:30	multilegordlog_XXYY.csv - Отчет по логу репо заявок РФ/БФ - фьючерсы	Удаляются поля: date_clr rate
	onlineregXXYY.csv - Отчет по клиентам зарегистрированным онлайн	не меняется

Наименование пакета	Наименование отчета	Описание изменений
FUTOPTMM (отчеты для Маркет-мейкеров)	mmfutXXYY.csv/ Отчет о выполнении обязательств ММ по фьючерсам mmopt_strikesXXXX.csv/Отчет о выполнении обязательств ММ по опционам mmopt_averageXXXX.csv/Отчет о выполнении обязательств ММ по опционам mm_onesidespredXXYY.csv/Клиентский отчет о лимитах в нетто-обороте mmLPXXYY.csv/MM отчет mm_lp_csv GROUPXX.xls/ Клиентский отчёт по вознаграждениям маркетмейкеров по программе ранжирования MM_PAYMENT_XX00.xls/MM_PAYMENT_XX00.xls	не меняется не меняется не меняется не меняется не меняется не меняется не меняется не меняется
RFSYYYYMMDD.zip - Отчет по сделкам RFS	ind04_XXYY.csv - Отчет по сделкам RFS indlink04_XXYY.csv - Отчеты по соответству Квазисделок фактически заключенным сделкам requests_XXYY.csv - Отчет о запросах на ликвидность	не меняется не меняется не меняется
REBATE (Ежемесячно – отчеты по возвратной премии)	PREMIUM_XX.xls - Отчет об биржевой возвратной премии участникам маркетинговых программ rebate_options_XXYY.csv - Отчет по маркетинговой программе по опционам	не меняется не меняется

Наименование пакета	Наименование отчета	Описание изменений
	rebate_at_XXYY.csv - Отчет по маркетинговой программе автоследования	не меняется
FORDLOGYYYYMMDD.zip - BK - заявки по фьючерсам		
	fordlogXXYY.csv - Отчет по принятым заявкам по фьючерсным контрактам	не меняется
OORDLOGYYYYMMDD.zip - BK - заявки по опционам		
	oordlogXXYY.csv - Отчет по принятым заявкам по опционным контрактам	не меняется
ERRLOGYYYYMMDD.zip - BK - непринятые заявки		
	errlogXXYY.csv - Отчет об отвергнутых заявках	не меняется
EXCHANGEHLDYYYYMMDD.zip	ДСВД - отчеты с биржевой информацией	
	f04_trade_XXYY.csv/f04cl_trade_XXYYZZZ.csv - Отчет о торгах фьючерсными контрактами по РФ/БФ/клиенту в ДСВД	Удаляются поля: profit_usd vat_ex_b vat_cc_b vat_ex_s vat_cc_s
	o04_trade_XXYY.csv/o04cl_trade_XXYYZZZ.csv - Отчет о торгах опционными контрактами по РФ/БФ/клиенту в ДСВД	Удаляются поля: profit_usd vat_ex_b

Наименование пакета	Наименование отчета	Описание изменений
		vat_cc_b
		vat_ex_s
		vat_cc_s
	multilegf04_trade_XXYY.csv/multilegf04cl_trade_XXYYZZZ.csv - Отчет о связанных сделках по РФ/БФ/клиенту в ДСВД	Удаляются поля:
		vat_ex_b
		vat_cc_b
		vat_ex_s
		vat_cc_s
	fordlog_trade_XXYY.csv - Отчет по принятым заявкам по фьючерсным контрактам в ДСВД	не меняется
	oordlog_trade_XXYY.csv - Отчет по принятым заявкам по опционным контрактам в ДСВД	не меняется
	multilegordlog_trade_XXYY.csv - Отчет по логу репо заявок РФ/БФ - фьючерсы в ДСВД	Удаляются поля:
		date_clr
		rate
MTYYYYMMDD.zip	Отчет о маржинальном требовании	
	mtXX00.csv - отчет о маржинальных требованиях	Новый отчет

## 5 ПРИЛОЖЕНИЕ 1.

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

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

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

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

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

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

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

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

Название поля	Название полей отчета	Правило формирования сейчас	Правило формирования в ЕТС (КС)	Правило формирования в ЕТС (РС)
fut_sb0r	Рассчитанная в Расчетную сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с фьючерсами (руб.)	сумма биржевого и клирингового сбора за заключение <b>безадресных сделок с фьючерсами</b> (руб.) за текущую сессию	Фактически списанная <b>за текущий торговый день</b> сумма биржевого и клирингового сбора за заключение <b>безадресных сделок с фьючерсами</b> (руб.) = сумма биржевого и клирингового сбора за заключение безадресных сделок с фьючерсами (руб.) за предыдущую сессию = fut_sb0r_mtm отчета mon за предыдущую сессию.  Совпадает с аналогичным полем в отчете monsettle за текущий торговый день.	Фактически списанная сумма в <b>Расчетную сессию</b> сумма биржевого и клирингового сбора за заключение <b>безадресных сделок с фьючерсами</b> .  Сумма совпадает с значением fut_sb0r_mtm отчета mon за предыдущую Клиринговую сессию
fut_sb0r_mtm	Начисленная в Клиринговую Сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с фьючерсами (руб.)	нет в текущей версии	<u>Начисленная</u> в Клиринговую Сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с фьючерсами (руб.) <u>за текущую</u> сессию	0 - в расчетную сессию проведены расчеты. Обязательства / требования = 0

Название поля	Название полей отчета	Правило формирования сейчас	Правило формирования в ETC (КС)	Правило формирования в ETC (РС)
opt_sb0r	Рассчитанная в Расчетную сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с опционами (руб.)	сумма биржевого и клирингового сбора за заключение <b>безадресных сделок с опционами</b> (руб.) за текущую сессию	сумма биржевого и клирингового сбора за заключение <b>безадресных сделок с опционами</b> (руб.)	Фактически зачисленная/ списанная в Расчетную сессию сумма биржевого и клирингового сбора за заключение <b>безадресных сделок с опционами</b> .  Сумма равна opt_sb0r_mt0m отчета mon за предыдущую сессию
opt_sb0r_mt0m	Начисленная в Клиринговую Сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с опционами (руб.)	нет в текущей версии	<u>Начисленная</u> в Клиринговую Сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с опционами (руб.) за <u>текущую</u> сессию	0 - в расчетную сессию проведены расчеты. Обязательства / требования = 0
nov	Оценочная стоимость объёма позиций опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги, на конец отчетного дня (в рублях РФ)		Расчет не меняется	0 (значение рассчитывается по позиции по итогам торгового дня, а отчет mon settle формируется в течение торгового дня, поэтому указываем 0)

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

Название поля	Название полей отчета	Правило формирования сейчас	Правило формирования в ETC (КС)	Правило формирования в ETC (РС)
amount_end_mtm	Плановая сумма денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на конец отчетного дня (в рублях РФ)	нет в текущей версии	$amount\_end\_mtm = amount\_end + var\_marg\_mtm + prem\_mtm + charges\_mtm$	$amount\_end\_mtm = amount\_end$ (потому что mtm-регистры равны 0)
free	Сумма свободных денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты / Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на конец отчетного дня (в рублях РФ).	Поле free вычисляется как $amount\_end - go - ext\_rez + nov.$	Поле free вычисляется как $amount\_end\_mtm - go + nov.$	0 (значение рассчитывается по позиции по итогам торгового дня, а отчет monsettle формируется в течение торгового дня, поэтому указываем 0)

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

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

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

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

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

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

## 6 ПРИЛОЖЕНИЕ 2.

### 6.1 Отчет CHARGESXXXX.csv/CHARGESCLXXXXZZZ.csv.

#### 6.1.1 Описание логики построения отчета

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

#### 6.1.2 Формат отчета

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
<b>DATE</b>	Дата и время клиринговой сессии	
<b>settle_date</b>	Плановая дата и время расчетов по обязательствам	
<b>kod</b>	Код клиента/расчетный код	Код раздела денежного регистра В файле rauXX00.csv, формируемого для Участника клиринга, в случае если клиринговые услуги по ведению клиринговых регистров Клиринговый центр оказывает Участнику торгов, не совпадающего в одном лице с Участником клиринга, в поле account по признаку 'CL' не предоставляется информация по коду раздела денежного регистра, открытого в рамках Брокерской фирмы для Участника торгов.
<b>account</b>	Признак обеспечения BF/CL/RK	Признак раздела: всегда 'CL'
<b>id_pay</b>	Идентификатор операции	

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

## 7 ПРИЛОЖЕНИЕ 3

### 7.1 PayXXYY.csv, PayclXXYYZZZ.csv

#### 7.1.1 Описание логики работы отчета

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

#### 7.1.2 Формат отчета

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

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

## 8 ПРИЛОЖЕНИЕ 4

### 8.1 fposXXYY.csv, fposclXXYYZZZ.csv

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

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

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

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

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

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

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

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ЕТС
<b>var_marg_d_index_div</b>	Составляющая часть Вариационной маржи с учетом дивидендных выплат по ценным бумагам, входящих в базу расчетов Индексов Московской Биржи, по Сделкам однодневными фьючерсными контрактами с автопролонгацией на Индексы Московской Биржи, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)	не меняется
<b>pos_enforcement_exec</b>	количество исполненных <b>принудительно</b> поз для выхода из ВФ	не меняется
<b>pay_enforcement_exec</b>	сумма платежа за принудительное исполнение (с учетом знака)	<b>Начисленная</b> сумма платежа за принудительное исполнение (с учетом знака)

## 8.2 oposXXYY.csv, oposclXXYYZZZ.csv

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

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

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

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

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

Название поля	Описание поля	Правило формирования в ETC
<b>prem_prom_currency</b>	Сумма Премий по опционным контрактам по итогам дневной клиринговой сессии (в валюте, в которой осуществляются денежные расчеты)	Удалено
<b>nov</b>	Оценочная стоимость объёма позиций опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги (в рублях РФ)	не меняется

## 9 ПРИЛОЖЕНИЕ 5

### 9.1 Отчет F14.xlsx

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

## 10 Приложение 6. Отчет о маржинальных требованиях mtXX00.csv

**mtXX00.csv** - отчет о маржинальных требованиях.

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

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