Спецификация клиринговых/ биржевых отчетов

версия 9.0

Москва 2025

Содержание

История изменений 4
1. Пакеты отчетов 22
2. Пакет SETTLEYYYYMMDD.zip 25
2.1. Отчет monsettlclXXYYZZZ.csv 25
2.2. Отчет monsettlXXYY.csv/monsettlXX00.csv 26
3. Пакет FOYYYYMMDD_2.zip 29
3.1. Отчет clientsXXYY.csv/clientsXX00.csv 29
3.2. Отчет f04clXXYYZZZ.csv 30
3.3. Отчет f04_XXYY.csv 34
3.4. Отчет f07.csv 39
3.5. Отчет fposclXXYYZZZ.csv 40
3.6. Отчет fposXXYY.csv 42
3.7. Отчет moncbXXYY.csv/moncbXX00.csv 43
3.8. Отчет monclXXYYZZZ.csv 44
3.9. Отчет monXXYY.csv/monXX00.csv 46
3.10. Отчет multileg_dict.csv 48
3.11. Отчет multilegf04clXXYYZZZ.csv 48
3.12. Отчет multilegf04_XXYY.csv 50
3.13. Отчет o04clXXYYZZZ.csv 51
3.14. Отчет o04_XXYY.csv 54
3.15. Отчет o07.csv 56
3.16. Отчет oposclXXYYZZZ.csv 57
3.17. Отчет oposXXYY.csv 58
3.18. Отчет paycbXXYY.csv/paycbXX00.csv 59
3.19. Отчет payclXXYYZZZ.csv 59
3.20. Отчет payXXYY.csv 60
3.21. Отчет persinvestXXYY.csv/persinvestXX00.csv 61
3.22. Отчет riskparamsXX00.csv 61
3.23. Отчет riskposXXYY.csv 62
3.24. Отчет toeqXXYY.csv 63
3.25. Отчет volat.csv 64
3.26. Отчет chargesclXXYYZZZ.csv 64
3.27. Отчет chargesXXYY.csv 65
4. Пакет TR_UPDYYYYMMDD.zip 66
4.1. Отчет tranerrfeeXXYY.csv 66
4.2. Отчет tranerrXXYY.csv 66
4.3. Отчет tranfcfeeXXYY.csv 67
4.4. Отчет tranfeeXXYY.csv 67
4.5. Отчет usersfcXXYY.csv 67
4.6. Отчет usersXXYY.csv 68
5. Пакет EXCHANGEYYYYMMDD.zip 69
5.1. Отчет multilegordlog_XXYY.csv 69
5.2. Отчет onlineregXXYY.csv 70
6. Пакет FUTOPTMMYYYYMMDD.zip 71
6.1. Отчет mmfut_XXYY.csv 71
6.2. Отчет mmLP_XXYY.csv 72
6.3. Отчет mm_onesidespredXXYY.csv 73
6.4. Отчет mmopt_averageXXYY.csv 73
6.5. Отчет mmopt_strikesXXYY.csv 74
7. Пакет FORDLOGYYYYMMDD.zip 76
7.1. Отчет fordlogXXYY.csv 76
8. Пакет OORDLOGYYYYMMDD.zip 78
8.1. Отчет oordlogXXYY.csv 78
9. Пакет ERRLOGYYYYMMDD.zip 80
9.1. Отчет errlogXXYY.csv 80
10. Пакет REBATEYYYYMMDD.zip 83
10.1. Отчет rebate_options_XXYY.csv 83
11. Пакет EXCHANGEHLDYYYYMMDD.zip 84
11.1. Отчет f04_trade_XXYY.csv 84
11.2. Отчет f04cl_trade_XXYYZZZ.csv 88
11.3. Отчет o04_trade_XXYY.csv 92
11.4. Отчет o04cl_trade_XXYYZZZ.csv 94
11.5. Отчет multilegf04_trade_XXYY.csv 97
11.6. Отчет multilegf04cl_trade_XXYYZZZ.csv 99
11.7. Отчет fordlog_trade_XXYY.csv 100
11.8. Отчет oordlog_trade_XXYY.csv 102
11.9. Отчет multilegordlog_trade_XXYY.csv 104
12. Пакет RFSYYYYMMDD.zip 106
12.1. Отчет ind04_XXYY.csv 106

12.2. Отсчет indlink04_XXYY.csv 106
12.3. Отсчет requests_XXYY.csv 107

История изменений

Дата	Изменения
30.09.2025	Удален пакет отчетов FOYYYYMMDD_1.zip ПК - отчеты по итогам пром.клиринга (1.zip)
	Добавлен новый пакет отчетов SETTLEYYYYMMDD.zip - Отчеты по результатам Расчетной Сессии в 20:00: • monsettlXXYY.csv - Отчет по деньгам БФ/РФ по итогам Расчетной сессии • monsettlclXXYYZZZ.csv - Отчет по деньгам клиента по итогам Расчетной сессии
	Изменено название пакета FOYYYYMMDD_2.zip ВК - отчеты по итогам клиринга (2.zip). Теперь это: FOYYYYMMDD_2.zip - Отчеты по итогам Клиринговой сессии
	В пакет отчетов FOYYYYMMDD_2.zip - Отчеты по итогам Клиринговой сессии добавлены отчеты: • chargesXXYY.csv - Отчет о начисленных комиссиях, штрафах и иных обязательствах по РФ/БФ • chargesclXXYYZZZ.csv - Отчет о начисленных комиссиях, штрафах и иных обязательствах по клиентам
	Изменение в monXXYY.csv, monclXXYYZZZ.csv: • Добавлены новые поля settle_date, var_marg_mtm, prem_mtm, in_out_netto, charges, charges_mtm, fut_sbor_mtm, opt_sbor_mtm, amount_end_mtm, sbor_ex_mtm, sbor_cc_mtm. • Удалены поля pay, gowide, freewide, margincall, vat_ex, vat_cc, ext_rez.
	Изменение в multilegf04_XXYY.csv, multilegf04clXXYYZZZ.csv: • Удалены поля vat_ex_b, vat_cc_b, vat_ex_s, vat_cc_s, price_rur2.
	Изменение в f04_XXYY.csv, f04clXXYYZZZ.csv: • Удалены поля profit_usd, vat_ex_b, vat_cc_b, vat_ex_s, vat_cc_s.
	Изменение в o04_XXYY.csv, o04clXXYYZZZ.csv: • Удалены поля profit_usd, vat_ex_b, vat_cc_b, vat_ex_s, vat_cc_s.
	Изменение в f07.csv: • Удалены поля limit, pr_setll, pr_settl_r, spot, base.
	Изменение в o07.csv: • Удалены поля pr_volat, pr_theorpr.
	Изменение в payXXYY.csv, payclXXYYZZZ.csv: • Удалены поля payer, inn, bik.
	Изменение в fposXXYY.csv, fposclXXYYZZZ.csv: • Удалены поля go_netto, accum_go, fee_trans, vat_ex, vat_cc, pos_failed, var_marg_prom.
	Изменение в oposXXYY.csv,oposclXXYYZZZ.csv: • Удалены поля vat_ex, vat_cc, var_marg_prom, prem_prom, prem_prom_currency.
	Изменение в riskposXXYY.csv: • Удалено поле fee_risk.
	Изменение в clientsXX00.csv/clientsXXYY.csv: • Удалены поля isrepo, account_forts.
	Изменение в multilegordlog_XXYY.csv: • Удалены поля rate, date_clr.
	Изменение в tranfeeXXYY.csv: • Удалены поля futopt, mm, addtr, fee, vat_sbortr.
	Изменение в f04_trade_XXYY.csv, f04cl_trade_XXYYZZZ.csv: • Удалены поля profit_usd, vat_ex_b, vat_cc_b, vat_ex_s, vat_cc_s.
	Изменение в o04_trade_XXYY.csv,o04cl_trade_XXYYZZZ.csv: • Удалены поля profit_usd, vat_ex_b, vat_cc_b, vat_ex_s, vat_cc_s.
	Изменение в multilegf04_trade_XXYY.csv, multilegf04cl_trade_XXYYZZZ.csv:

Дата	Изменения
	• Удалены поля vat_ex_b, vat_cc_b, vat_ex_s, vat_cc_s, price_rur2.
	Изменение в multilegordlog_trade_XXYY.csv: • Удалены поля rate, date_clr.
22.09.2025	Изменения в f07.csv: • Добавлено поле exp_enforcement_pay
	Изменения в fposXXYY.csv, fposclXXYYZZZ.csv: • Добавлено поле pos_enforcement_exec • Добавлено поле pay_enforcement_exec
	Отмечены пакеты отчетов и поля, планируемые к удалению в версии 9.0.
18.06.2025	Добавлен пакет рассылки EXCHANGEHLDYYYYMMDD.zip с биржевыми отчетами по итогам сессий выходного дня: • f04_trade_XXYY.csv • f04cl_trade_XXYYZZZ.csv • o04_trade_XXYY.csv • o04cl_trade_XXYYZZZ.csv • multilegf04_trade_XXYY.csv • multilegf04cl_trade_XXYYZZZ.csv • fordlog_trade_XXYY.csv • oordlog_trade_XXYY.csv • multilegordlog_trade_XXYY.csv
28.01.2025	Изменения в f07.csv, dayf07.csv: • Добавлено поле buy_deposit_erc • Добавлено поле sell_deposit_erc • Добавлено поле buy_deposit_hrc • Добавлено поле sell_deposit_hrc • Добавлено поле buy_deposit_lrc • Добавлено поле sell_deposit_lrc • Добавлено поле buy_deposit_mrc • Добавлено поле sell_deposit_mrc
	Изменения в o07.csv, dayo07.csv: • Добавлено поле base_im_covered_sell_erc • Добавлено поле base_im_covered_sell_hrc • Добавлено поле base_im_covered_sell_lrc • Добавлено поле base_im_covered_sell_mrc • Добавлено поле base_im_sell_erc • Добавлено поле base_im_buy_erc • Добавлено поле base_im_sell_hrc • Добавлено поле base_im_buy_hrc • Добавлено поле base_im_sell_lrc • Добавлено поле base_im_buy_lrc • Добавлено поле base_im_sell_mrc

Дата	Изменения
	• Добавлено поле base_im_buy_mrc • Добавлено поле base_im_sell • Добавлено поле base_im_covered_sell • Поле basegobuy переименовано в base_im_buy
	В пакет REBATEYYYYMMDD.zip добавлен новый отчет rebate_options_XXYY.csv - Отчет по маркетинговой программе по опционам
11.12.2024	Изменение в clientsXX00.csv, clientsXXYY.csv: • Добавлено поле client_risk_level
23.09.2024	Изменения в mmopt_strikesXXXX.csv, mmopt_averageXXXX.csv, mmLP_XXYY.csv: • Добавлено поле margin_style
	Прекращается формирование и рассылка «Быстрого» пакета отчетов **FO_MON.zip**. Все отчеты (monXX00.csv/monXXYY.csv, monclXXYYZZZ.csv) из него формируются и рассылаются в основном пакете **FOYYYYMMDD_2.zip** по итогам основной клиринговой сессии.
24.06.2024	Изменения в f07.csv, dayf07.csv: • Значения в полях trades, volume, vol_rubl, avrg указаны с учетом заключенных сделок с календарными спредами
18.03.2024	Изменение в f04_XXYY.csv, f04clXXYYZZZ.csv: • Добавлен в поля type_buy и type_sell новый тип сделок (28)
	Изменение в clientsXX00.csv, clientsXXYY.csv: • Добавлено поле category • Добавлено поле clients_type
	Изменения в f07.csv, dayf07.csv: • Изменено описание поля limit
	Изменения в fordlogXXYY.csv, oordlogXXYY.csv, multilegordlog_XXYY.csv: • Добавлено поле compliance_id
	Файлы multilegordlog_XXYY.csv, onlineregXXYY.csv из пакета отчётов FOYYYYMMDD_2.zip перенесены в пакет отчетов EXCHANGEYYYYMMDD.zip, который подписывается сертификатом представителя ПАО Московская Биржа.
04.12.2023	Изменения в f07.csv, dayf07.csv: • Изменен размер поля ns_volrubl с numeric (16,5) на numeric (24,2)
	Изменение в f04_XXYY.csv, f04clXXYYZZZ.csv: • Добавлен в поля type_buy и type_sell новый тип сделок (27) • Изменено описание поля counterparty
	Изменение в o04_XXYY.csv, 004clXXYYZZZ.csv: • Добавлен в поля type_buy и type_sell новый тип сделок (8) • Изменено описание поля counterparty
	Изменение в multilegf04_XXYY.csv, multilegf04clXXYYZZZ.csv: • Добавлен в поля type_buy и type_sell новый тип связок (4)
	Изменение в fordlogXXYY.csv, oordlogXXYY.csv: • Добавлено поле match_ref • Изменено описание поля broker_to_rts
	Изменение в multilegordlog_XXYY.csv: • Добавлено поле match_ref • Изменено описание user_to
25.09.2023	Изменение в f04_XXYY.csv, f04clXXYYZZZ.csv:

Дата	Изменения
	• Добавлено поле var_marg_b_index_div • Добавлено поле var_marg_s_index_div
	Изменения в f07.csv: • Добавлено поле index_div
	Изменение в fposXXYY.csv, fposclXXYYZZZ.csv: • Добавлено поле var_marg_p_index_div • Добавлено поле var_marg_d_index_div
	Изменение в clientsXX00.csv, clientsXXYY.csv: • Добавлено поле n_level
	Изменения в dayriskparamsXXYY.csv, riskparamsXXYY.csv: • Прекращение формирование файлов по каждой Брокерской фирме • Формирование файлов консолидировано по всему Участнику клиринга, включая все Брокерские фирмы. • Изменено наименование файлов на dayriskparamsXX00.csv, riskparamsXX00.csv
03.04.2023	Изменение в clientsXX00.csv, clientsXXYY.csv: • Изменен тип поля с numeric(1) на varchar(1) • Изменено описание поля cross_trade
05.12.2022	Изменение в f04_XXYY.csv, f04clXXYYZZZ.csv: • Добавлено поле var_marg_b_settl_price • Добавлено поле var_marg_b_swap_rate • Добавлено поле var_marg_s_settl_price • Добавлено поле var_marg_s_swap_rate
	Изменение в fposXXYY.csv, fposclXXYYZZZ.csv: • Добавлено поле var_marg_p_settl_price • Добавлено поле var_marg_p_swap_rate • Добавлено поле var_marg_d_settl_price • Добавлено поле var_marg_d_swap_rate
	Изменение в clientsXX00.csv, clientsXXYY.csv: • Изменено описание поля date_begin • Изменено описание поля date_end • Изменено описание поля send_kod
	Изменения в f07.csv: • Изменено описание поля swap_rate
10.10.2022	Изменение в f04_XXYY.csv, f04clXXYYZZZ.csv: • Изменено наименование поля с type на type_buy • Добавлено поле type_sell • Добавлены новые типы сделок (24, 25, 26) • Изменено наименование поля с signs на signs_buy • Изменен размер поля signs_buy с numeric(11) на numeric(20) • Добавлено поле signs_sell
	Изменение в o04_XXYY.csv, 004clXXYYZZZ.csv: • Изменено наименование поля с type на type_buy

Дата	Изменения
	• Добавлено поле type_sell • Изменено наименование поля с signs на signs_buy • Изменен размер поля signs_buy с numeric(11) на numeric(20) • Добавлено поле signs_sell
	Изменение в multilegf04_XXYY.csv, multilegf04clXXYYZZZ.csv: • Изменено наименование поля с type на type_buy • Добавлено поле type_sell • Изменено наименование поля с signs на signs_buy • Изменен размер поля signs_buy с numeric(11) на numeric(20) • Добавлено поле signs_sell
	Изменение в clientsXX00.csv, clientsXXYY.csv: • Изменен размер поля name с char(50) на char(200)
	Изменение в mmfutXXYY.csv, mmopt_averageXXYY.csv: • Добавлено поле actual_mm_orders_percent
27.06.2022	Прекращение формирование файлов: tranfeeupdXXYY.csv tranfeeupddetailsXXYY.csv tranfeeshareXXYY.csv в связи с отменой расчета и взимания сбора за неэффективные транзакции с 21.06.2022
30.05.2022	Изменение в o04_XXYY.csv, o04clXXYYZZZ.csv: • Добавлено поле prem_buy_currency • Добавлено поле prem_sell_currency
	Изменение в o07.csv, dayo07.csv: • Добавлено поле settlement_currency • Добавлено поле tick_price_currency
	Изменение в oposXXYY.csv, oposclXXYYZZZ.csv: • Добавлено поле prem_currency • Добавлено поле prem_prom • Добавлено поле prem_prom_currency • Добавлено поле nov
	Изменение в monXX00.csv/monXXYY.csv, monclXXYYZZZ.csv: • Добавлено поле nov (перед полем go) • Добавлено поле com_pl_prem (перед полем com_pl_end)
	Изменение в daymonXX00.csv/daymonXXYY.csv: • Добавлено поле nov (перед полем gol2) • Добавлено поле com_pl_prem (перед полем com_pll2)
	Изменение в moncbXX00.csv/moncbXXYY.csv: • Добавлено поле prem (перед полем amount_end)
	Изменение в mmfutXXYY.csv: • Удалено поле order_book
	Изменение в mmopt_strikesXXXX.csv:

Дата	Изменения
	• Изменено наименование поля с underlying на futures • Изменено наименование поля с symbol на underlying • Добавлено поле underlying_type
	Изменение в mmopt_averageXXXX.csv: • Изменено наименование поля с underlying на futures • Изменено наименование поля с symbol на underlying • Добавлено поле underlying_type
	Изменение в mmLP_XXYY.csv: • Изменено наименование поля с symbol на underlying • Добавлено поле underlying_type
25.04.2022	Изменения в f07.csv: • Добавлено поле swap_rate
01.04.2022	Изменения в fordlogXXYY.csv, oordlogXXYY.csv: • Добавлено поле mm • Добавлено поле actualmm
06.12.2021	Изменения в f04_XXYY.csv, f04clXXYYZZZ.csv, fut_deal.csv: • Изменено описание поля type (тип «3»)
	Изменения в f07.csv, dayf07.csv: • Изменено описание поля limit
	Изменения в o07.csv, dayo07.csv: • Изменено описание поля depo_uncov, depo_cov
	Изменения в clientsXX00.csv/clientsXXYY.csv: • Изменено описание поля account_forts
	В связи с прекращением принятия Ценных бумаг в качестве Обеспечения по сделкам, заключенным на Срочном рынке удалено упоминание «депо регистр обеспечения», «ценные бумаги», «оценочная стоимость ценных бумаг» в файлах: • monXX00.csv/monXXYY.csv, monclXXYYZZZ.csv • daymonXX00.csv/daymonXXYY.csv • payXX00.csv/payXXYY.csv, payclXXYYZZZ.csv • paycbXX00.csv/paycbXXYY.csv • moncbXX00.csv/moncbXXYY.csv
27.09.2021	Прекращение формирования пакета рассылки **IQSГГГГММДД.zip** с файлами: ind04_XXYY.csv indlink _XXYY.csv requests_XXYY.csv в связи с прекращением поддержки сервиса индикативных котировок Срочного рынка (IQS)
	Изменение в mmfutXXYY.csv, mmopt_strikesXXXX.csv, mmopt_averageXXXX.csv: • Изменено описание поля order_book (удалено упоминание IQS)
	Прекращение формирования пакета рассылки **ГГГГММДД_MONPOS_NEW.zip** с информационными файлами: fpos_newXXYY.csv fposcl_newXXYYZZZ.csv opos_newXXYY.csv

Дата	Изменения
	oposcl_newXXYYZZZ.csv mon_newXXYY.csv moncl_newXXYYZZZ.csv
	Изменение в fposXXYY.csv, fposclXXYYZZZ.csv: • Изменено описание и расчет значения в поле go_brutto (становится равным, как в аналогичных файлах с приставкой '_new'
	Изменение в oposXXYY.csv, oposclXXYYZZZ.csv, monXXYY.csv, monclXXYYZZZ.csv: • Изменено описание и расчет значения в поле go (становится равным, как в аналогичных файлах с приставкой '_new'
28.06.2021	Изменения в f04_XXYY.csv, f04clXXYYZZZ.csv, fut_deal.csv: • Изменено описание по типу сделок 3 • Добавлены новые типы сделок (21, 22, 23)
	Изменения в o04_XXYY.csv, o04clXXYYZZZ.csv, opt_deal.csv: • Изменено описание по типу сделок 3 • Добавлены новые типы сделок (6, 7)
	Добавлено в Примечание к файлам monXX00.csv/mon_newXX00.csv, daymonXX00.csv о блокировке по признаку 'RK' суммы налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации по Сделкам, являющимся производными финансовыми инструментами, подлежащую удержанию с Участника клиринга – Нерезидента в соответствии с законодательством РФ.
24.02.2021	Добавлен файл mm_onesidespreadXXYY.csv
22.02.2021	Изменения в usersfcXXYY.csv и tranfcfeeXXYY.csv: • Формирование файлов изменяется с результатов итогов основной клиринговой сессии предыдущего торгового дня на информацию по итогам основной клиринговой сессии текущего торгового дня
01.02.2021	Изменения в f04_XXYY.csv , f04clXXYYZZZ.csv, fut_deal.csv: • Изменено описание поля type (тип «16» сделка с инструментом risk – не используется в связи с прекращением функционала по Управлению риском)
	Изменения в riskposXXYY.csv: • Изменено описание поля type (удален тип инструмента ‘R’ – инструмент risk)
	Прекращение формирования файла tofxXXYY.csv
14.09.2020	Изменение в clientsXX00.csv/ clientsXXYY.csv: • Добавлено поле ics_margin_type
	Изменения в fordlogXXYY.csv, oordlogXXYY.csv: • Добавлено поле private_amount • Добавлено поле private_amount_rest • Добавлено поле private_order_id • Изменено описание поля id_ord
	Изменения в errlogXXYY.csv: • Добавлено поле iceberg_amount • Добавлено поле variance_amount
	Изменение в ind04_XXYY.csv, indlink _XXYY.csv: • Добавлено поле dir
03.08.2020	Изменение в mmfutXXYY.csv, mmopt_strikesXXYY.csv: • Добавлено поле is_volat
17.02.2020	Изменение в clientsXX00.csv/ clientsXXYY.csv: • Добавлено поле lp_code

Дата	Изменения
	Изменение в ind04_XXYY.csv, indlink _XXYY.csv: • Добавлено поле trading_mode
	Добавлен файл requests_XXYY.csv
16.12.2019	Изменения в f04_XXYY.csv, f04clXXYYZZZ.csv: • Изменен размер поля id_deal с numeric(10) на numeric(19) • Изменен размер поля no_buy с numeric(15) на numeric(19) • Изменен размер поля no_sell с numeric(15) на numeric(19) • Изменен размер поля id_mult с numeric(10) на numeric(19)
	Изменения в o04_XXYY.csv, o04clXXYYZZZ.csv: • Изменен размер поля id_deal с numeric(10) на numeric(19) • Изменен размер поля no_buy с numeric(15) на numeric(19) • Изменен размер поля no_sell с numeric(15) на numeric(19)
	Изменения в multilegf04_XXYY.csv, multilegf04clXXYYZZZ.csv: • Изменен размер поля id_deal с numeric(10) на numeric(19) • Изменен размер поля no_buy с numeric(15) на numeric(19) • Изменен размер поля no_sell с numeric(15) на numeric(19) • Изменен размер поля id_trade с numeric(10) на numeric(19)
	Изменения в fut_deal.csv, opt_deal.csv, multileg_deal.csv, fordlogXXYY.csv, oordlogXXYY.csv: • Изменен размер поля id_deal с numeric(10) на numeric(19)
	Изменения в multilegordlog_XXYY.csv: • Изменен размер поля numb_order с numeric(15) на numeric(19) • Изменен размер поля n_order1 с numeric(15) на numeric(19)
	Добавлен файл MM_RANKING_N_XXYYZZZ.csv
05.08.2019	Изменения в f04_XXYY.csv, f04clXXYYZZZ.csv, o04_XXYY.csv, o04clXXYYZZZ.csv, multilegf04_XXYY.csv, multilegf04clXXYYZZZ.csv: • Удалено поле du_buy • Удалено поле du_sell
	Изменения в multilegordlog_XXYY.csv: • Удалено поле hedge • Удалено поле du
	Добавлен файл onlineregXXYY.csv
04.03.2019	Изменение в f07.csv, dayf07.csv: • Добавлено deposit_buy • Добавлено deposit_sell • Удалено поле perc_rate
	Изменения в clientsXX00.csv: • Добавляется файл clientsXXYY.csv • Добавлено поле clients_owner
	Изменения в persinvestXX00.csv: • Добавляется файл persinvestXXYY.csv
	Изменения в paycbXX00.csv: • Добавляется файл paycbXXYY.csv

Дата	Изменения
	Изменения в f04_XXYY.csv, f04clXXYYZZZ.csv, o04_XXYY.csv, o04clXXYYZZZ.csv, multilegf04_XXYY.csv, multilegf04clXXYYZZZ.csv: • Добавлено поле ncc_request_buy • Добавлено поле ncc_request_sell
	Изменения в multilegordlog_XXYY.csv: • Добавлено поле ncc_request
29.10.2018	Изменение в поле name в payXXYY.csv, payclXXYYZZZ.csv: • Изменен размер с char(75) на char(255)
08.10.2018	Изменения в toeqXXYY.csv: • Поле **kod_tks** переименовано в **kod_tks_fr** • Поле **kod_client** переименовано **kod_client_fr** • Поле **fav_tks_own** переименовано в **fav_tks_own_fr**, изменено описание поля • Поле **fav_tks_client** переименовано в **fav_tks_client_fr**, изменено описание поля • Поле **fav_tks_du** переименовано в **fav_tks_du_fr**, изменено описание поля • Поле **broker_ref** переименовано в **broker_ref_fr**, изменено описание поля • Добавлены поля kod_tks_vr, kod_client_vr, fav_tks_own_vr, fav_tks_client_vr, fav_tks_du_vr, broker_ref_vr
	Изменение в поле type в f04_XXYY.csv, f04clXXYYZZZ.csv, fut_deal.csv: • Изменено описание по типу сделок 17
	Изменение в поле type в riskposXXYY.csv: • Изменено описание по типу ’K’
	Изменение в moncbXXYY.csv: • Изменено описание полей account, type, amount_beg, amt_beg_cb, pay, pay_rub, amount_end, amt_end_cb, rate_cb, rate, go, com_ensure
	Изменение в paycbXX00.csv: • Изменено описание полей type, asset, pay, rub_equ, purpose
17.09.2018	Изменение в multilegordlog_XXYY.csv, fordlogXXYY.csv, oordlogXXYY.csv: • Добавлено поле aspref • Добавлено поле asp
	Изменение в fut_deal.csv, opt_deal.csv: • Изменено описание поля type
	Изменение в fposXXYY.csv, fposclXXYYZZZ.csv: • Изменено описание поле isin
	Добавлен пакет рассылки ГГГГММДД_MONPOS_NEW.zip с информационными отчетами: fpos_newXXYY.csv fposcl_newXXYYZZZ.csv opos_newXXYY.csv oposcl_newXXYYZZZ.csv mon_newXXYY.csv moncl_newXXYYZZZ.csv
30.07.2018	Добавлены файлы ind04_XXYY.csv, indlink _XXYY.csv
16.07.2018	Изменение в mmfutXXYY.csv, mmopt_strikesXXXX.csv, mmopt_averageXXXX.csv: • Добавлены поля order_book, is_group

Дата	Изменения
	Изменение в fposXXYY.csv, fposclXXYYZZZ.csv: • Изменено описание поля go_brutto
	Изменение в oposXXYY.csv, oposclXXYYZZZ.csv: • Изменено описание поля go
21.05.2018	Изменение в файлах fposXX00.csv, oposXX00.csv, moncbXX00.csv: • Добавлено в поле kod информация по RK • Удалена в поле kod информация по RF • Изменено описание поля account
	Изменение в файле riskposXX00.csv: • Добавлено в поле kod информация по RK • Удалена в поле kod информация по RF • Изменено описание поля account • Добавлен новый тип (K) в поле type
	Изменение в файле monXX00.csv: • Удалена в поле kod информация по RF • Изменено описание полей account, type, pay, com_pl_beg, com_pl_pay, com_pl_end • Изменено описание полей go, free
	Изменение в файле daymonXX00.csv: • Удалена в поле kod информация по RF • Изменено описание полей account, type, pay, com_pl_beg, com_pl_pay, com_pll2
	Изменение в monclXXYYZZZ.csv: • Изменено описание полей type, pay, go, com_pl_beg, com_pl_pay, com_pl_end
	Изменение в payXXYY.csv, payclXXYYZZZ.csv, paycbXX00.csv: • Изменено описание поля type
	Изменение в fposXXYY.csv, oposXXYY.csv, fposclXXYYZZZ.csv, oposclXXYYZZZ.csv: • Добавлено поле var_marg_prom
	Изменение в поле type в f04_XXYY.csv, f04clXXYYZZZ.csv: • Добавлены новые типы сделок (17, 18, 19, 20)
	Изменение в поле type в o04_XXYY.csv, o04clXXYYZZZ.csv: • Добавлен новый тип сделок (5)
	Изменение в f07.csv, dayf07.csv: • Удалено поле kof
	Изменения в clientsXX00.csv: • Поле **margin_type** переименовано в **margin_type_rk**, изменено описание поля • Добавлено новое поле margin_type_bf • Добавлено новое поле cal_spread_type
14.03.2018	Добавлены файлы errlogXXYY.csv, fordlogXXYY.csv, oordlogXXYY.csv
11.12.2017	Изменено описание полей go, free в файле monXXYY.csv
04.12.2017	Изменения в clientsXX00.csv: • Добавлено поле rk_uf
	Замена термина «Расчетная фирма (РФ)» на «Участника клиринга (Идентификатор Участника клиринга)»
	Изменено описание полей kod, account в файлах:

Дата	Изменения
	fposXXYY.csv oposXXYY.csv monXXYY.csv daymonXXYY.csv tranfeeXXYY.csv moncbXXYY.csv usersXXYY.csv tranerrXXYY.csv tranerrfeeXXYY.csv toeqXXYY.csv riskposXXYY.csv usersfcXXYY.csv tranfcfeeXXYY.csv
04.09.2017	Изменения в clientsXX00.csv: • Добавлено поле sb
01.06.2017	Добавлен файл mmLP_XXYY.csv
20.03.2017	Изменено описание поля vat_sbortr в файле tranfeeXXYY.csv
27.02.2017	Добавлен файл payXXYY.csv
26.12.2016	Изменения в riskparamsXXYY.csv: • Добавлены поля type, del_ord, prohibit_coeff_bf, state_bf, type_bf, del_ord_bf
	Добавлен файл dayriskparamsXXYY.csv
	Изменено описание полей payer, inn, bik в файлах payXX00.csv, payclXXYYZZZ.csv
01.12.2016	В f07.csv и dayf07.csv скорректировано описание поля is_percent
	В tranfeeXXYY.csv в поле trantype добавлен новый тип – «2»
	Изменено словосочетание «ошибочные транзакции» на «ошибочные транзакции, отличные от ошибок Flood Control» в файлах: • usersXXYY.csv • tranerrXXYY.csv • tranerrfeeXXYY.csv
04.10.2016	Добавлены файлы usersfcXXYY.csv, tranfcfeeXXYY.csv
16.08.2016	Добавлен файл riskparamsXXYY.csv
04.07.2016	Изменения в clientsXX00.csv: • Добавлено поле margin_type • Изменен размер поля rk с char(5) на char(12)
	Изменения в monXXYY.csv, daymonXXYY.csv, monclXXYYZZZ.csv: • Изменен размер поля kod с char(7) на char(12)
31.08.2015	Изменения в f04_XXYY.csv, f04clXXYYZZZ.csv, o04_XXYY.csv, o04clXXYYZZZ.csv: • Добавлено поле counterparty
06.08.2015	Прекращение предоставления файла delinfoXX00.csv
01.07.2015	Добавлены файлы mmfutXXYY.csv, mmopt_strikesXXXX.csv, mmopt_averageXXXX.csv
03.06.2015	Добавлен файл delivery_ofz_ctd_XX00.csv
06.04.2015	В f04_XXYY.csv, f04clXXYYZZZ.csv, o04_XXYY.csv, o04clXXYYZZZ.csv:
	• Изменено описание поля signs

Дата	Изменения
	Изменения в clientsXX00.csv: • Добавлены поля cross_trade, account_forts • Удалены поля spot, money
05.12.2014	В toeqXXYY.csv добавлено поле broker_ref
	Изменено описание полей в связи с закрытием рынка Standard
	Добавлен файл persinvestXX00.csv
03.10.2014	В fut_deal.csv в поле type добавлен новый тип - «16» В delinfoXX00.csv изменено описание поля id
22.08.2014	Изменение поля id_code в clientsXX00.csv: • Изменен размер с char(30) на char(50)
28.07.2014	Добавлены файлы riskposXXYY.csv, tofxXXYY.csv
	В clientsXX00.csv добавлены поля: • rk • rk_type
	В f04_XXYY. csv, f04cl_XXYYZZZ. csv в поле type добавлен новый тип -«16»
	Изменения в monXXYY.csv**,** daymonXXYY.csv: • Изменено описание полей kod, account
09.06.2014	Добавлен файл toeqXXYY.csv
25.04.2014	Добавлен файл paycbXX00.csv
16.12.2013	Изменение поля в: • Изменен размер поля type с numeric(1) на numeric(2) • Изменено описание поля type
18.11.2013	Изменения в daymonXXYY.csv: • Добавлены поля rub_beg, rub_pay, rubl2, com_pl_beg, com_pl_pay, com_pll2 • Изменено описание полей type, amount_beg, pay, amountl2, freel2
	Изменения в monXXYY.csv, monclXXYY.csv: • Добавлены поля rub_beg, rub_pay, rub_end, com_pl_beg, com_pl_pay, com_pl_end • Изменено описание полей type, amount_beg, pay, amount_end, free
	В moncbXXYY.csv добавлено поле: • com_ensure
	В payXX00.csv, payclXXYYZZZ.csv изменено описание поля: • type
11.11.2013	Меняется предоставление файлов с формата dbf на формат csv: clientsXX00 delinfoXX00 delivery_step1XX00 deliveryXX00 f04_XXYY f04clXXYYZZZ f07 fposXXYY fposclXXYYZZZ

Дата	Изменения
	fut_deal monXXYY monclXXYYZZZ moncbXXYY multileg_deal multileg_dict multilegf04_XX00 multilegf04clXXYYZZZ multilegordlog_XX00 o04_XXYY o04clXXYYZZZ o07 oposXXYY oposclXXYYZZZ opt_deal payXX00 payclXXYYZZZ volat
21.10.2013	Прекращение предоставления файлов tranfXXYY.dbf и tranoXXYY.dbf
	Изменения в tranfeeXXYY.dbf: • Изменено описание полей futopt, mm, fee, sbortr, vat_sbortr • Добавлено новое поле trantype • Изменен формат предоставления файла с dbf на csv
	Добавлены файлы с информацией по неэффективным транзакциям: • tranfeeupdXXYY.csv • tranfeeupddetailsXXYY.csv • tranfeeshareXXYY.csv
	Добавлены файлы с информацией за ошибочные транзакции: • usersXXYY.csv • tranerrXXYY.csv • tranerrfeeXXYY.csv
01.10.2013	Меняется предоставление файлов dayf07, dayo07, daymonXXYY с формата dbf на формат csv
27.05.2013	В monXXYY.dbf, monclXXYYZZZ.dbf, daymonXXYY.dbf добавлено поле: • ext_rez
	В f04_XXYY.dbf, f04cl_XXYYZZZ.dbf в поле type добавлены новые типы -«14», «15»
	В fposXXYY.dbf, fposclXXYYZZZ.dbf добавлено поле: • pos_failed
18.02.2013	Изменение полей в delinfoXX00.dbf: • Изменен размер поля id с char(12) на char(25) • Изменено описание поля id
08.01.2013	Поля с обозначением НДС не используются в связи с изменением Налогового Кодекса РФ

Дата	Изменения
21.12.2012	В f04_XXYY.dbf, f04cl_XXYYZZZ.dbf, o04_XXYY.dbf, o04cl_XXYYZZZ.dbf, multilegf04_XXYY.dbf, multilegf04clXXYYZZZ.dbf изменены размеры полей: • no_buy с numeric(10) на numeric(15) • no_sell с numeric(10) на numeric(15) • signs с numeric(10) на numeric(11)
	В multilegordlog_XXYY.dbf изменены размеры полей: • numb_order с numeric(10) на numeric(15) • n_order1 с numeric(10) на numeric(15)
03.12.2012	Удалено упоминание об инструментах RTS Money в связи с ликвидацией рынка
08.10.2012	В moncbXXYY.dbf изменен размер поля rate с numeric (16,2) на numeric (16,5)
21.05.2012	Изменение полей в delinfoXX00.dbf: • Изменен размер поля depo_acc с char(20) на char(32) • Поле codedealer переименовано в id с новым описанием • Добавлено новое поле shortname
02.02.2012	Добавлен файл moncbXXYY.dbf
19.12.2011	Смена названия «RTS Standard» на «Standard»
01.07.2011	Прекращение предоставление файлов fordlogXXYY.dbf, oordlogXXYY.dbf
27.05.2011	В multilegordlog_XXYY.dbf изменено описание полей: • price • price_rur
23.05.2011	В clientsXX00.dbf добавлены поля: • du • segr • isrepo
01.03.2011	Прекращение предоставления файлов repodeal_XXYY.dbf, repoordlog_XXYY.dbf
27.12.2010	В multilegf04_XXYY.dbf, multilegf04cl_XXYYZZZ.dbf добавлено поле: • price_rur2
	В clientsXX00.dbf добавлено поле: • money
	В delinfoXX00.dbf изменен размер поля depo_acc с char (15) на char (20)
	В multilegf04_XXYY.dbf, multilegf04cl_XXYYZZZ.dbf, multilegordlog_XXYY.dbf, multileg_deal.dbf, repodeal_XXYY.dbf, repoordlog_XXYY.dbf изменен размер поля rate с numeric(16,2) на numeric(16,5)
	В f04_XXYY.dbf, f04cl_XXYYZZZ.dbf в поле type добавлены новые типы -«12», «13»
27.08.2010	Изменение полей в dayf07.dbf: • contract – описание поля • multileg – добавлено поле
26.08.2010	Добавлены файлы multilegf04_XXYY.dbf, multilegf04clXXYYZZZ.dbf, multilegordlog_XXYY.dbf, multileg_deal.dbf, multileg_dict.dbf
	Изменение полей в f07.dbf: • contract – описание поля • multileg – добавлено поле
	В f04_XXYY.dbf, f04cl_XXYYZZZ.dbf, o04_XXYY.dbf, o04cl_XXYYZZZ.dbf в описание поля signs добавлена дополнительная информация (ссылка на ftp://ftp.moex.com/pub/FORTS/ файл «Информации дл бэк-офисов Участни»)
11.06.2010	В f04_XXYY.dbf, f04cl_XXYYZZZ.dbf добавлены поля:

Дата	Изменения
	• id_mult • signs
	В o04_XXYY.dbf, o04cl_XXYYZZZ.dbf добавлено поле: • signs
07.06.2010	В f04_XXYY.dbf, f04cl_XXYYZZZ.dbf в поле type добавлен новый тип -«11»
19.04.2010	Изменения полей в dayf07.dbf: • vol_rubl – изменен размер поля с 16,2 на 17,2 • fee – изменен размер поля с 16,2 на 16,5 • poses_rubl – изменен размер поля с 16,2 на 17,2 • kof – изменен размер поля с 9,6 на 10,6 • risk_wr – изменен размер поля с 16,2 на 16,5 • coffout – изменен размер поля с 16,5 на 7,5 • is_spread – изменен размер поля с 10 на 1 • deposit – изменен размер поля с 16,2 на 16,5 • is_percent – изменен размер поля с 10 на 1 • perc_rate – изменен размер поля с 16,2 на 7,2 • step_price – поле удалено • tick_pr_go – добавлено поле • limit_l1 – добавлено поле • type_exec – изменен размер поля с 10 на 1, добавлен новый тип сделки
	Изменения полей в f07.dbf: • pr_settl_r - изменен размер поля с 16,6 на 16,5 • type_exec – добавлен новый тип сделки
	В dayo07.dbf добавлено поле basegobuy
	В fposclXXYYZZZ.dbf добавлены поля fee_exec, fine_exec
	Добавлены файлы f04clXXYYZZZ.dbf, o04clXXYYZZZ.dbf, payclXXYYZZZ.dbf
	Прекращение предоставления файлов f08_XX00.dbf, o08_XX00.dbf
	Прекращение рассылки файлов по ЭДО fut_deal.dbf, opt_ deal.dbf
16.04.2010	Добавлены файлы repodeal_XXYY.dbf, repoordlog_XXYY.dbf
12.03.2010	В f04_XXYY.dbf в поле type • добавлены новые типы сделок • изменен размер поля
	В f08_XX00.dbf в поле type добавлены новые типы сделки • добавлены новые типы сделок • изменен размер поля
	В o04_XXYY.dbf в поле type изменен размер поля
	В o08_XX00.dbf в поле type изменен размер поля
30.09.2009	В tranfeeXXYY изменено описание и тип полей: fee, sbortr добавлено поле vat_sbortr
28.08.2009	В f04_XXYY, o04_XXYY, f08_XX00, o08_XX00 • изменено описание полей: fee_buy, fee_sell, fee_ns_b, fee_ns_s.

Дата	Изменения
	• добавлены поля: fee_ex_b, vat_ex_b, fee_cc_b, vat_cc_b, fee_ex_s, vat_ex_s, fee_cc_s, vat_cc_s
	В fposXXYY.dbf, fposclXXYYZZZ.dbf, oposXXYY.dbf, oposclXXYYZZZ.dbf: • изменено описание полей: sbor, sbor_exec, sbor_nosys • добавлены поля: sbor_ex, vat_ex, sbor_cc, vat_cc
	В monXXYY.dbf, monclXXYYZZZ.dbf: • изменено описание полей: fut_sbor, opt_sbor • добавлены поля: sbor_ex, vat_ex, sbor_cc, vat_cc
	В daymonXXYY.dbf изменено описание полей: fut_sbor, opt_sbor
30.07.2009	В o07 добавлено поле basegobuy
20.04.2009	Добавлены файлы dayf07.dbf, dayo07.dbf
16.04.2009	В f04_XXYY в поле type добавлен новый тип сделки
	В f08_XX00 в поле type добавлен новый тип сделки
10.04.2009	В отчет f07.dbf добавлены новые поля ns_volume, ns_trades, ns_fee, ns_volrubl, l_tradeday
	В tranfXXYY удалено поле dealtr
	В tranoXXYY удалено поле dealtr
	В tranfeeXXYY поле dealtr заменено на fee
	В delinfoXX00.dbf удалено поле gts_dvp, поле code_rps переименовано в codedealer, добавлено поле check
10.02.2009	В f04_XXYY.dbf добавлено поле repo_id. Изменилось описание поля type, user_sell, user_buy.
	В f07.dbf добавлены поля section, spot, base ,type_sbor
	В f08_XX00.dbf добавлено поле repo_id. Изменилось описание поля type, user_sell, user_buy.
	В clientsXX00.dbf добавлено поле spot
	В fposXXYY. dbf добавлены поля accum_go, fee_trans
	В fposclXXYYZZZ.dbf добавлены поля accum_go, fee_trans
	В o08_XX00.dbf добавлены поля var-marg_s, var_marg_b и примечания к ним, изменено примечание к полям prem_buy, prem_sell
	В monXXYY.dbf добавилось примечание к описанию полей var_marg, prem
	В monclXXYY.dbf добавилось примечание к описанию полей полей var_marg, prem
	В o07.dbf добавлено поле fut_type
	В oposXXYY.dbf добавлены новые поля var_marg_p, var_marg_d
	В o04.dbf добавлены новые поля var_marg_b, var_marg_s
10.12.2008	Добавлено описание отчетов tranfeeXXYY.dbf, tranoXXYY.dbf, tranfXXYY.dbf
16.05.2008	В fordlogXXYY.dbf добавлены поля date_exp, n_order1, date_clr
	В oordlogXXYY.dbf добавлены поля date_exp, n_order1, date_clr
	В f04_XXYY.dbf добавлено поле date_clr
	В o04_XXYY.dbf добавлено поле date_clr
	В f08_XXYY.dbf добавлено поле date_clr
	В o08_XXYY.dbf добавлено поле date_clr
	В deliveryXX00.dbf добавлены: • описание полей pos_iskl, pos_neisp, neisp, step

Дата	Изменения
	• п.5 примечаний
	Добавлено описание отчета delivery_step1XX00.dbf
31.10.2007	В f07.dbf добавлено поле type_exec.
03.09.2007	В daymon.dbf добавлено поле exp_vm. Изменилось описание поля: fut_sbor, opt_sbor, amountwide.
01.08.2007	В f07.dbf добавлены поля pr_setll, pr_settl_r.
	В o07.dbf добавлены поля pr_volat, pr_theorpr.
31.07.2007	В f04_XXYY.dbf изменился п.5 примечаний.
	В o04_XXYY.dbf изменился п.5 примечаний.
	В f07.dbf добавлено поле limi_l1.
	В monXXYY.dbf добавлены поля gowide, freewide, margincall.
	В monclXXYY.dbf добавлены поля gowide, freewide, margincall.
	Добавлен файл daymonXXYY.dbf
09.03.2007	Добавлен файл delinfoXX00.dbf.
	Добавлен файл clientsXX00.dbf.
30.10.2006	В f07.dbf добавлено поле lot_volume, tick_pr_go.
	В o07.dbf добавлено поле tick_pr_go.
15.06.2006	Добавлен файл deliveryXX00.dbf.
	В payXX00.dbf добавлены поля payer, inn, bik, purpose.
29.05.2006	В fordlogXXYY.dbf изменился смысл поля user_to. Вместо пользователя торговой системы, которому была адресована заявка, в это поле пишется код фирмы в РТС, которой была адресована заявка. Добавлены поля price_rur, ext_id. Изменен тип поля price с numeric(20, 5) на numeric(16, 5).
	В oordlogXXYY.dbf изменился смысл поля user_to. Вместо пользователя торговой системы, которому была адресована заявка, в это поле пишется код фирмы в РТС, которой была адресована заявка. Добавлены поля price_rur, ext_id. Изменен тип поля price с numeric(20, 5) на numeric(16, 5).
	В f07.dbf добавлены поля is_percent, perc_rate, sett_rur.
	В f04_XXYY.dbf изменены пункты примечаний 3, 4, 6. Добавлены поля price_rur, ext_id_b, ext_id_s. Изменен тип поля price с numeric(20, 5) на numeric(16, 5).
	В f08_XXYY.dbf добавлены поля price_rur, ext_id_b, ext_id_s. Изменен тип поля price с numeric(20, 5) на numeric(16, 5).
	В fut_deal.dbf и opt_deal.dbf добавлено поле type. В fut_deal.dbf и opt_deal.dbf теперь пишутся в том числе и нерыночные сделки. Добавлен пункт примечаний 4.
	В o04_XXYY.dbf изменены пункты примечаний 4. Добавлены поля price_rur, ext_id_b, ext_id_s. Изменен тип поля price с numeric(20, 5) на numeric(16, 5).
	В o08_XXYY.dbf добавлены поля price_rur, ext_id_b, ext_id_s. Изменен тип поля price с numeric(20, 5) на numeric(16, 5).
31.03.2006	В f07.dbf изменен тип поля vol_rubl с numeric(16, 5) на numeric(17, 2), poses_rubl с numeric(16, 5) на numeric(17, 2).
	В o07.dbf изменен тип поля vol_rubl с numeric(16, 5) на numeric(17, 2), poses_rubl с numeric(16, 5) на numeric(17, 2).
24.01.2006	В payXX00.dbf изменен тип поля comment с char(10) на char(50).
15.09.2005	В o04_XXYY.dbf добавлены поля pem_buy, prem_sell. Изменены пункты примечаний 6. Добавлены пункты примечаний 16 – 19.
	В o08_XXYY.dbf добавлены поля pem_buy, prem_sell.
29.08.2005	В f04_XXYY.dbf изменены пункты примечаний 3, 6.
	В o04_XXYY.dbf изменен пункт примечаний 3.
24.08.2005	В f04_XXYY.dbf добавлены поля fee_ns_b, fee_ns_s. Добавлены пункты примечаний 16, 17.
	В o04_XXYY.dbf добавлены поля fee_ns_b, fee_ns_s. Добавлены пункты примечаний 14, 15.
	В fposXXYY.dbf добавлено поле sbor_nosys. Изменены пункты примечаний 5, 6.
	В fposclXXYYZZZ.dbf добавлено поле sbor_nosys.
	В oposXXYY.dbf добавлено поле sbor_nosys. Изменены пункты примечаний 5, 6.
	В oposclXXYYZZZ.dbf добавлено поле sbor_nosys.
	В f08_XXYY.dbf добавлены поля fee_ns_b, fee_ns_s.

Дата	Изменения
	В o08_XXYY.dbf добавлены поля fee_ns_b, fee_ns_s.
16.06.2005	В o07.dbf добавлены поля name, close_time, volat, theorprice.
	Добавлены файлы fut_deal.dbf и opt_deal.dbf.
14.06.2005	В fposXXYY.dbf добавлено поле sbor_exec.
	В fposclXXYY.dbf добавлено поле sbor_exec.
	В oposXXYY.dbf добавлено поле sbor_exec.
	В oposclXXYY.dbf добавлено поле sbor_exec.
05.03.2005	В f04_XXYY.dbf добавлены поля du_buy, du_sell. Добавлен п.15 примечаний.
	В o04_XXYY.dbf добавлены поля du_buy, du_sell. Добавлен п.13 примечаний.
	В fposXXYY.dbf добавлено поле du.
	В fposclXXYYZZZ.dbf добавлено поле du.
	В oposXXYY.dbf добавлено поле du.
	В oposclXXYYZZZ.dbf добавлено поле du.
	В monXXYY.dbf добавлено поле du.
	В monXXYYZZZ.dbf добавлено поле du.
	В f08_XX00.dbf добавлены поля du_buy, du_sell.
	В o08_XX00.dbf добавлены поля du_buy, du_sell.
	В fordlogXXYY.dbf добавлено поле du.
	В oordlogXXYY.dbf добавлено поле du.
	В payXX00.dbf добавлено поле du.
16.08.2004	В oordlogXXYY.dbf добавлено поле comment.
26.02.2004	Добавлен файл payXX00.dbf.
10.02.2004	В f04_XXYY.dbf, o04_XXYY.dbf, f08_XX00.dbf, o08_XX00.dbf добавлены поля comm_buy, comm_sell.
09.12.2003	В oposXXYY.dbf, oposclXXYY.dbf добавилось поле pos_endcir.
24.09.2003	В oposXXYY.dbf, oposclXXYY.dbf добавилось поле pos_exec.
28.04.2003	В oordlogXXYY.dbf добавилось поле user_to.
20.02.2003	В f07.dbf добавилось поле deposit.
	В o07.dbf добавились поля depo_uncov, depo_cov.
30.12.2002	В f07.dbf добавилось поле execution2.
	В o07.dbf добавились поля date2, execution2. Добавились примечания.
	В fordlogXXYY.dbf добавились поля date2. Добавились примечания.
	В oordlogXXYY.dbf добавились поля date2.
18.12.2002	В f07.dbf добавилось поля poses_rubl, limit, kof, risk_wr, coffout, base_fut, is_spread, name, date2. Удалены поля sel_depo, buy_depo. Добавились примечания.
	В o07.dbf добавилось поля poses_rubl, fut_contr, strike put, evrop.
	В fposXXYY.dbf изменилось описание поля go_netto. Изменились примечания.
	В fposclXXYY.dbf изменилось описание поля go_netto. Изменились примечания.
	В oposXXYY.dbf изменилось описание поля go.
	В oposclXXYY.dbf изменилось описание поля go.
	В monXXYY.dbf изменились примечания.
	В f04_XXYY.dbf, f08_XX00.dbf удалены поля sub_sell, sub_buy, comiss, nkd, name, summa. Изменился тип и назначение поля type. Добавились поля fee_buy, fee_sell, date2. Добавились примечания.
	В o04_XXYY.dbf, o08_XX00.dbf удалены поля sub_sell, sub_buy, comiss, nkd, type, name, summa. Изменился тип и назначение поля type. Добавились поля fee_buy, fee_sell, date2. Добавились примечания.

1. Пакеты отчетов

Файл пакета	Наименование пакета	Подписант пакета	Отчет	Наименование отчета	Время формирования
SETTLEYYYYMMDD.zip	Отчеты по результатам Расчетной сессии в 20:00	НКЦ	monsettlclXXYYZZZ.csv	Отчет по деньгам клиента по итогам Расчетной Сессии	После РС
			monsettlXXYY.csv	Отчет по деньгам БФ/РФ по итогам Расчетной Сессии	
FOYYYYMMDD_2.zip	Отчеты по итогам Клиринговой сессии	НКЦ	clientsXXYY.csv	Отчет по зарегистрированным клиентам	После КС
			f04clXXYYZZZ.csv	Клиентский о торгах фьючерсными контрактами	
			f04_XXYY.csv	Отчет о торгах фьючерсными контрактами по РФ/БФ	
			f07.csv	Отчет о торгах фьючерсными контрактами	
			fposclXXYYZZZ.csv	Отчет по фьючерсным позициям клиентов	
			fposXXYY.csv	Отчет по фьючерсным позициям РФ/БФ	
			moncbXXYY.csv	Движение денежных средств с учетом курса ЦБ	
			monclXXYYZZZ.csv	Отчет по деньгам клиентов	
			monXXYY.csv	Отчет по деньгам БФ/РФ	
			multileg_dict.csv	Отчет о связанных инструментах	
			multilegf04clXXYYZZZ.csv	Отчет о связанных сделках по клиентам	
			multilegf04_XXYY.csv	Отчет о связанных сделках по РФ/БФ	
			o04clXXYYZZZ.csv	Клиентский о торгах опционными контрактами	
			o04_XXYY.csv	Отчет о торгах опционными контрактами по РФ/БФ	
			o07.csv	Отчет о торгах опционными контрактами	
			oposclXXYYZZZ.csv	Отчет по опционным позициям клиентов	
			oposXXYY.csv	Отчет по опционным позициям РФ/БФ	
			paycbXXYY.csv	Отчет по платежам РФ	
			payclXXYYZZZ.csv	Отчет по клиентским платежам	
			payXXYY.csv	Отчет по платежам	
			persinvestXXYY.csv	Отчет об инвестиционных счетах	
			riskparamsXX00.csv	Отчет с коэффициентом prohibit_coeff по БФ	
			riskposXXYY.csv	Информация о позиционном состоянии по инструментам	

Файл пакета	Наименование пакета	Подписант пакета	Отчет	Наименование отчета	Время формирования
			toeqXXYY.csv	Информация о привязке счетов на срочном и фондовом рынках	
			volat.csv	Параметры кривой волатильности	
			chargesclXXYYZZZ.csv	Отчет о начисленных комиссиях, штрафах и иных обязательствах по клиентам	
			chargesXXYY.csv	Отчет о начисленных комиссиях, штрафах и иных обязательствах по РФ/БФ	
TR_UPDYYYYMMDD.zip	Отчеты по транзакциям. Отчеты после Клиринговой сессии	НКЦ	tranerrfeeXXYY.csv	Отчет по ошибочным транзакциям 2 РФ/БФ	После КС
			tranerrXXYY.csv	Отчет по ошибочным транзакциям 3 РФ/БФ	
			tranfcfeeXXYY.csv	Отчет tranfcfee_csv по сбору за флуд	
			tranfeeXXYY.csv	Отчет по транзакциям РФ/БФ	
			usersfcXXYY.csv	Отчет users по сбору за флуд	
			usersXXYY.csv	Отчет по ошибочным транзакциям РФ/БФ	
EXCHANGEYYYYMMDD.zip	Отчеты с биржевой информацией после Клиринговой сессии	МБ	multilegordlog_XXYY.csv	Отчет по принятым заявкам по связкам РФ/БФ	После КС
			onlineregXXYY.csv	Отчет по клиентам зарегистрированным онлайн	
FUTOPTMMYYYYMMDD.zip	Отчеты для Маркет-мейкеров	МБ	mmfut_XXYY.csv	Отчет о выполнении обязательств ММ по фьючерсам	После КС
			mmLP_XXYY.csv	Отчет с информацией по оборотам ММ по конкретному инструменту	
			mm_onesidespredXXYY.csv	Клиентский отчет о лимитах в нетто-обороте	
			mmopt_averageXXYY.csv	Отчет о выполнении обязательств ММ по опционам (средний арифметический % исполнения по страйкам)	
			mmopt_strikesXXYY.csv	Отчет о выполнении обязательств ММ по опционам (в разбивке по страйкам)	
FORDLOGYYYYMMDD.zip	ВК - заявки по фьючерсам	МБ	fordlogXXYY.csv	Отчет по принятым заявкам по фьючерсным контрактам	После КС
OORDLOGYYYYMMDD.zip	ВК - заявки по опционам	МБ	oordlogXXYY.csv	Отчет по принятым заявкам по опционным контрактам	После КС
ERRLOGYYYYMMDD.zip	ВК - непринятые заявки	МБ	errlogXXYY.csv	Отчет об отвергнутых заявках	После КС
REBATEYYYYMMDD.zip	Отчеты по возвратной премии	МБ	rebate_options_XXYY.csv	Отчет по маркетинговой программе по опционам	После КС

Файл пакета	Наименование пакета	Подписант пакета	Отчет	Наименование отчета	Время формирования
EXCHANGEHLDYYYYMMDD.zip	Биржевые отчеты по итогам сессий выходного дня	МБ	f04_trade_XXYY.csv	Отчет о торгах фьючерсными контрактами в ДСВД по РФ/БФ	До 14:00 следующего дня
			f04cl_trade_XXYYZZZ.csv	Клиентский о торгах фьючерсными контрактами в ДСВД	
			o04_trade_XXYY.csv	Отчет о торгах опционными контрактами в ДСВД по РФ/БФ	
			o04cl_trade_XXYYZZZ.csv	Клиентский о торгах опционными контрактами в ДСВД	
			multilegf04_trade_XXYY.csv	Отчет о связанных сделках в ДСВД по РФ/БФ	
			multilegf04cl_trade_XXYYZZZ.csv	Отчет о связанных сделках в ДСВД по клиентам	
			fordlog_trade_XXYY.csv	Отчет по принятым в ДСВД заявкам по фьючерсным контрактам	
			oordlog_trade_XXYY.csv	Отчет по принятым в ДСВД заявкам по опционным контрактам	
			multilegordlog_trade_XXYY.csv	Отчет по принятым в ДСВД заявкам по связкам	
RFSYYYYMMDD.zip	Отчеты по сделкам RFS	МБ	ind04_XXYY.csv	Отчет по сделкам RFS	После КС
			indlink04_XXYY.csv	Отчеты по соответствию Квазисделок фактически заключенным сделкам	
			requests_XXYY.csv	Отчет о запросах на ликвидность	

2. Пакет SETTLEYYYYMMDD.zip

Отчеты по результатам Расчетной сессии в 20:00.

2.1. Отчет monsettlclXXYYZZZ.csv

Отчет по деньгам клиента по итогам Расчетной сессии. Файл формата csv.

Структура отчета *monsettlclXXYYZZZ.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчета
settle_date	char(10)	Дата расчетов
kod	char(12)	Код Брокерской фирмы / раздела денежного регистра / Расчетный код
account	char(2)	Признак клиента ('CL' - клиент)
type	char(2)	Тип Обеспечения: ‘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	numeric(16, 2)	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)
var_marg	numeric(16, 2)	Вариационная маржа (руб.), фактически зачисленная/списанная в Расчетную сессию
var_marg_mtm	numeric(16, 2)	В Расчетную сессию поле равно 0
prem	numeric(16, 2)	Опционная премия (руб.), фактически зачисленная/списанная в Расчетную сессию
prem_mtm	numeric(16, 2)	В Расчетную сессию поле равно 0
in_out_netto	numeric(16, 2)	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 до Расчетной сессии (в рублях РФ) по операциям ввода / вывода
charges	numeric(16, 2)	Фактическое исполнение обязательства по уплате комиссий, штрафов и обязательства по выплате / получению единовременного платежа по выходу из вечного фьючерса
charges_mtm	numeric(16, 2)	В Расчетную сессию поле равно 0
fut_sbor	numeric(16, 2)	Рассчитанная в Расчетную сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с фьючерсами (руб.)
fut_sbor_mtm	numeric(16, 2)	В Расчетную сессию поле равно 0
opt_sbor	numeric(16, 2)	Рассчитанная в Расчетную сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с опционами (руб.)
opt_sbor_mtm	numeric(16, 2)	В Расчетную сессию поле равно 0
nov	numeric(16,2)	Оценочная стоимость объема позиций опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги, на конец отчетного дня (в рублях РФ) В Расчетную сессию поле равно 0
go	numeric(16, 2)	Сумма гарантийного обеспечения по всем инструментам по риск-параметрам В Расчетную сессию поле равно 0
amount_end	numeric(16, 2)	Сумма денежных средств в рублях РФ и/или оценочная стоимость иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на момент проведения Расчетной сессии (в рублях РФ)
amount_end_mtm	numeric(16, 2)	Значение совпадает с amount_end
free	numeric(16, 2)	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) В Расчетную сессию поле равно 0

Название поля	Тип поля	Описание поля
du	numeric(1)	Признак того, что раздел денежного регистра предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении
sbor_ex	numeric(16,2)	Рассчитанная в Расчетную сессию сумма биржевого сбора за адресные и безадресные сделки (руб.)
sbor_ex_mtm	numeric(16,2)	В Расчетную сессию поле равно 0
sbor_cc	numeric(16,2)	Рассчитанная в Расчетную сессию сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра за адресные и безадресные сделки (руб.)
sbor_cc_mtm	numeric(16,2)	В Расчетную сессию поле равно 0
rub_beg	numeric(16,2)	Сумма денежных средств в рублях РФ на начало торгового дня
rub_pay	numeric(16,2)	Изменение суммы денежных средств в рублях РФ в течение торгового дня по операциям ввода/ вывода
rub_end	numeric(16,2)	Сумма денежных средств в рублях РФ на конец торгового дня
com_pl_beg	numeric(16,2)	Оценочная стоимость иностранной валюты и/или Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на начало отчетного дня (в рублях РФ)
com_pl_pay	numeric(16,2)	Изменение оценочной стоимости иностранной валюты и/или Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу в течение дня до Расчетной Сессии (в рублях РФ) по ценам на начало дня
com_pl_prem	numeric(16,2)	Изменение оценочной стоимости объема позиций опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги, в течение дня до Расчетной сессии (в рублях РФ)
com_pl_end	numeric(16,2)	Оценочная стоимость иностранной валюты и/или Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на момент проведения Расчетной сессии (в рублях РФ) по ценам на начало дня

Примечание:

1. Ключевые поля date, kod, account, type.
2. Поле prem должно содержать сумму премии по сделкам с немаржируемыми опционами.
3. Поле var_marg должно содержать сумму вариационной маржи по фьючерсам и маржируемым опционам и сумму гарантийных переводов.
4. Поле amount_end вычисляется как amount_end = amount_begin + in_out_netto+ var_marg + prem+ charges.
5. Поле amount_end_mtm вычисляется как amount_end_mtm = amount_end + var_marg_mtm + prem_mtm+ charges_mtm.
6. Поле free вычисляется как amount_end_mtm – go + nov.
7. Отчет monsettlclXXYYZZZ.csv формируется после Расчетной сессии, во время Торговой сессии, актуальные значения nov, go, free доступны в потоках и в Терминале Срочного Рынка. В отчете monsettlclXXYYZZZ.csv в полях nov, go, free указаны 0..
8. Файл формируется при установлении услуги формирования отчетов по разделу клиринговых регистров.
9. Для type ='PL' поля rub_beg, rub_pay, rub_end, com_pl_beg, com_pl_pay, com_pl_end не заполняются.

2.2. Отчет monsettlXXYY.csv/monsettlXX00.csv

Отчет по деньгам БФ/РФ по итогам Расчетной сессии. Файл формата csv.

Структура отчета *monsettlXXYY.csv/monsettlXX00.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчета
settle_date	char(10)	Дата расчетов
kod	char(12)	Код Брокерской фирмы / раздела денежного регистра / Расчетный код
account	char(2)	Признак Обеспечения: 'BF' – суммарные средства, учитываемые на Брокерской фирме, 'CL' – средства, учитываемые на разделе денежного регистра,

Название поля	Тип поля	Описание поля
		'RK' – суммарные средства, учитываемые на Расчетном коде.
type	char(2)	Тип Обеспечения: ‘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	numeric(16, 2)	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)
var_marg	numeric(16, 2)	Вариационная маржа (руб.), фактически зачисленная/списанная в Расчетную сессию
var_marg_mtm	numeric(16, 2)	В Расчетную сессию поле равно 0
prem	numeric(16, 2)	Опционная премия (руб.), фактически зачисленная/списанная в Расчетную сессию
prem_mtm	numeric(16, 2)	В Расчетную сессию поле равно 0
in_out_netto	numeric(16, 2)	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 до начала Расчетной сессии
charges	numeric(16, 2)	Фактическое исполнение обязательства по уплате комиссий, штрафов и обязательства по выплате / получению единовременного платежа по выходу из вечного фьючерса, рассчитанное в Расчетную сессию
charges_mtm	numeric(16, 2)	В Расчетную сессию поле равно 0
fut_sbor	numeric(16, 2)	Рассчитанная в Расчетную сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с фьючерсами (руб.)
fut_sbor_mtm	numeric(16, 2)	В Расчетную сессию поле равно 0
opt_sbor	numeric(16, 2)	Рассчитанная в Расчетную сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с опционами (руб.)
opt_sbor_mtm	numeric(16, 2)	В Расчетную сессию поле равно 0
nov	numeric(16,2)	Оценочная стоимость объема позиций опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги, на конец отчетного дня (в рублях РФ) В Расчетную сессию поле равно 0
go	numeric(16, 2)	Сумма гарантийного обеспечения по всем инструментам по риск-параметрам В Расчетную сессию поле равно 0
amount_end	numeric(16, 2)	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_mtm	numeric(16, 2)	Значение совпадает с amount_end
free	numeric(16, 2)	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) В Расчетную сессию поле равно 0
du	numeric(1)	Признак того, что раздел денежного регистра предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении
sbor_ex	numeric(16,2)	Рассчитанная в Расчетную сессию сумма биржевого сбора за адресные и безадресные сделки (руб.)
sbor_ex_mtm	numeric(16,2)	В Расчетную сессию поле равно 0
sbor_cc	numeric(16,2)	Рассчитанная в Расчетную сессию сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра за адресные и безадресные сделки (руб.)
sbor_cc_mtm	numeric(16,2)	В Расчетную сессию поле равно 0

Название поля	Тип поля	Описание поля
rub_beg	numeric(16,2)	Сумма денежных средств в рублях РФ на начало торгового дня
rub_pay	numeric(16,2)	Изменение суммы денежных средств в рублях РФ в течение торгового дня до Расчетной сессии по операциям ввода/ вывода
rub_end	numeric(16,2)	Сумма денежных средств в рублях РФ до Расчетной сессии
com_pl_beg	numeric(16,2)	Оценочная стоимость иностранной валюты и/или Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на начало отчетного дня до Расчетной Сессии (в рублях РФ) по ценам на начало дня
com_pl_pay	numeric(16,2)	Изменение оценочной стоимости иностранной валюты и/или Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу в течение дня до Расчетной Сессии (в рублях РФ)
com_pl_prem	numeric(16,2)	Изменение оценочной стоимости объема позиций опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги, в течение дня до Расчетной сессии (в рублях РФ)
com_pl_end	numeric(16,2)	Оценочная стоимость иностранной валюты и/или Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу до Расчетной сессии (в рублях РФ)

Примечание:

1. Ключевые поля date, kod, account, type.
2. Поля kod=‘Расчетный код’ и account=‘RK’ отражаются в отчете monXX00 уровня Участника клиринга.
3. Для BF поле go вычисляется не как сумма равная соответствующим полям по всем ее клиентам.
4. Поле amount_end вычисляется как amount_end = amount_begin + in_out_netto+ var_marg + prem+ charges.
5. Поле amount_end_mtm вычисляется как amount_end_mtm = amount_end + var_marg_mtm + prem_mtm+ charges_mtm.
6. Поле free вычисляется как amount_end_mtm – go + nov.
7. Отчет monsettlXXYY.csv формируется после Расчетной сессии, во время Торговой сессии, актуальные значения nov, go, free доступны в потоках и в Терминале Срочного Рынка. В отчете monsettlXXYY.csv в полях nov, go, free указаны 0..
8. Поле prem должно содержать сумму премии по сделкам с немаржируемыми опционами.
9. Поле var_marg должно содержать сумму вариационной маржи по фьючерсам и маржируемым опционам.
10. Для type =‘PL’ поля rub_beg, rub_pay, rub_end, com_pl_beg, com_pl_pay, com_pl_end не заполняются.
11. В файле monsettlXXYY.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.
12. В файле monsettlXXYY.csv в поле go по признаку 'RK' блокируется сумма налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации по Сделкам, являющимся производными финансовыми инструментами, подлежащую удержанию с Участника клиринга – Нерезидента в соответствии с законодательством РФ.

3. Пакет FOYYYYMMDD_2.zip

Отчеты по итогам Клиринговой сессии.

3.1. Отчет clientsXXYY.csv/clientsXX00.csv

Информация о разделах клиринговых регистров, где XX – Идентификатор Участника клиринга, XXYY – Код Брокерской фирмы, открытой для Участника торгов. Файл формата csv.

Структура отчета clients*XXYY.csv/clientsXX00.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения клиринга
kod	char(7)	Код раздела клиринговых регистров
account	char(2)	Признак раздела: Всегда 'CL'
name	char(200)	Наименование раздела клиринговых регистров
id_code	char(50)	ИНН (код, заменяющий ИНН)
date_open	date	Дата открытия клирингового раздела
reports	numeric(1)	Признак формирования отчетов («1» - отчеты формируются, «0» – отчеты не формируются)
date_begin	date	Дата начала формирования отчетов по разделу в случае предоставления Заявления на формирование отчетов по разделу клиринговых регистров, за исключением основного раздела Брокерской фирмы с кодом вида XXYY000
date_end	date	Дата окончания формирования отчетов по разделу в случае предоставления Заявления на формирование отчетов по разделу клиринговых регистров, за исключением основного раздела Брокерской фирмы с кодом вида XXYY000
send_kod	char(7)	Код раздела денежного регистра обеспечения для учитывания комиссионного вознаграждения за формирование отчетов по итогам клиринга в случае переадресации на другой раздел денежного регистра обеспечения
code_adr	char(7)	Код для заключения адресных сделок
du	numeric(1)	Признак того, что раздел денежного регистра предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении.
segr	numeric(1)	Признак «1» обособленной Брокерской фирмы
rk	char(12)	Расчетный код, соответствующий Брокерской фирме с кодами XX00000 и XXYY000
rk_type	char(1)	Тип Расчетного кода: 'S' - Собственный 'L' - Клиентский 'D' - ДУ
cross_trade	varchar(1)	Признак возможности: 'Y' – кросс-сделки разрешены, предусмотрено снятие только активных кросс-заявок, 'N' – кросс-сделки запрещены, предусмотрено снятие только активных кросс-заявок, 'P' – кросс-сделки запрещены, предусмотрено снятие пассивных кросс-заявок, 'X' – кросс-сделки разрешены, предусмотрено снятие пассивных кросс-заявок.
margin_type_rk	numeric(1)	Информация о действующих правилах расчета Гарантийного обеспечения по каждому Расчетному коду: 4 – Неттинг
sb	numeric(1)	Признак специальной Брокерской фирмы: 1 – является Брокерская фирма специальной,

Название поля	Тип поля	Описание поля
		0 – не является Брокерская фирма специальной
rk_uf	numeric(1)	Признак Расчетного кода «Единый пул»: 1 – Расчетный код является Расчетным кодом Единого пула, 0 – Расчетный код не является Расчетным кодом Единого пула
margin_type_bf	numeric(1)	Информация о действующих правилах агрегирования счетов по Брокерской фирме: 3 – Полунеттинг 4 – Неттинг
cal_spread_type	numeric(1)	Правило учета календарных спредов для Брокерской фирмы: 3 – Полунеттинг 4 – Неттинг
clients_owner	numeric(1)	Признак Брокерской фирмы, открытой Клиринговому брокеру: 1 – Клиринговый центр оказывает клиринговые услуги по открытию и ведению клиринговых регистров, открытых в рамках данной Брокерской фирмы, Участнику клиринга, 2 – Клиринговый центр оказывает клиринговые услуги по открытию и ведению клиринговых регистров, открытых в рамках данной Брокерской фирмы, Участнику торгов
lp_code	char(20)	Код провайдера ликвидности платформы Request for stream (RFS)
ics_margin_type	numeric(1)	Правило учета межконтрактных спредов для Брокерской фирмы: 3 – Полунеттинг 4 – Неттинг
n_level	char(4000)	Сведения по ИНН (код, заменяющий ИНН) с разделителем '/' для отображения всех уровней зарегистрированных лиц, позволяющие их идентифицировать
category	varchar(20)	Значение, включающее 20 символов, не обязательное для заполнения при регистрации в ЛКУ «Единая регистрация клиентов»
clients_type	varchar(2)	Тип зарегистрированного в ЛКУ «Единая регистрация клиентов»
client_risk_level	i4	Категория уровня риска клиента: 0 – Не указано 1 – Клиент с Начальным Уровнем Риска (КНУР) 2 – Клиент со Стандартным Уровнем Риска (КСУР) 3 – Клиент с Повышенным Уровнем Риска (КПУР) 4 – Клиент с Особым Уровнем Риска (КОУР)

Примечание:

1. В файле clientsXX00.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, не предоставляется информация по коду раздела регистра учета позиций, открытого в рамках Брокерской фирмы для Участника торгов, за исключением полей date, kod, cross_trade.

2. Поле n_level отражает сведения из ЛКУ «Единая регистрация клиентов» на основании изменений с 01.10.2023 в Положение 437-П о деятельности по проведению организованных торгов.

3.2. Отчет f04clXXYYZZZ.csv

Информация о фьючерсных сделках клиентов, где XXYYZZZ – код раздела. Файл формата csv.

Структура отчета *f04clXXYYZZZ.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
id_deal	numeric(19)	Идентификатор сделки в торговой системе
isin	char(25)	Уникальный код инструмента (фьючерсного контракта)

Название поля	Тип поля	Описание поля
price	numeric(16,5)	Цена заключения фьючерсных контрактов (в пунктах)
vol	numeric(10)	Количество инструментов в сделке (шт.)
kod_sell	char(7)	Код продавца
kod_buy	char(7)	Код покупателя
date	char(10)	Дата регистрации сделки
time	char(8)	Время сделки.
type_buy	numeric(2)	Тип сделки Покупателя: 0 – безадресная сделка, 1 – возникла в результате экспирации опционов, 2 – адресная сделка/ или перевод позиций между разделами с одинаковыми идентификационными данными с признаком битовой маски 0x8 в шлюзе и уникальным ненулевым id в поле signs_ buy, 3 – для Сделок, заключенных по закрывающим и балансирующим сделкам с Добросовестным участником клиринга, 4 – первая часть сделки РЕПО - не используется, 5 – вторая часть сделки РЕПО - не используется, 7 – сделки купли-продажи по разделам ДУ (вместо сделок РЕПО) - не используется, 8 – сделки исполнения поставочного фьючерсного контракта через инструмент Standard - не используется, 9 – первая части сделки РЕПО T+N - не используется, 10 – вторая часть сделки РЕПО T+N - не используется, 11 – закрытие позиции в результате исполнения расчетного/поставочного фьючерсного контракта (отражается в противоположную сторону для закрытия позиции в учете), 12 – не используется, 13 – не используется, 14 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 15 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 16 – не используется, 17 – не является сделкой, операция по изменению позиции по фьючерсному контракту с текущей датой исполнения, базовым активом которого является данная иностранная валюта / ценная бумага / драгоценный металл, в количестве и по направлению, соответствующему переданному / полученному Профилю актива по иностранной валюте / ценной бумаге /драгоценному металлу (коллатеральный инструмент)/, 18 – для сделок, заключенных на основании Индикативных заявок, 19 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, заключенных на основании Индикативных заявок, 20 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, заключенных на основании Индикативных заявок, 21 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга при проведении процедуры кросс-дефолта, 22 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование, 23 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга, не исполнившего Обязательства по поставке по поставочным Срочным контрактам на драгоценные металлы,

Название поля	Тип поля	Описание поля
		24 – для Сделок, заключенных путем подачи поручения об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией, 25 – для Сделок, заключенных вследствие подачи Участником клиринга – Продавцом поручения об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией, 26 – для исполнения однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией посредством заключения квартального фьючерсного контракта, 27 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие, 28 – для Сделок, заключенных на основании Заявки с указанием спреда «TAS» (опция Trade at Settlement).
type_sell	numeric(2)	Тип сделки Продавца: 0 – безадресная сделка, 1 – возникла в результате экспирации опционов, 2 – адресная сделка/ или перевод позиций между разделами с одинаковыми идентификационными данными с признаком битовой маски 0x8 в шлюзе и уникальным ненулевым id в поле signs_ sell, 3 – для Сделок, заключенных по закрывающим и балансирующим сделкам с Добросовестным участником клиринга, 4 – первая часть сделки РЕПО - не используется, 5 – вторая часть сделки РЕПО - не используется, 7 – сделки купли-продажи по разделам ДУ (вместо сделок РЕПО) - не используется, 8 – сделки исполнения поставочного фьючерсного контракта через инструмент Standard - не используется, 9 – первая части сделки РЕПО T+N - не используется, 10 – вторая часть сделки РЕПО T+N - не используется, 11 – закрытие позиции в результате исполнения расчетного/поставочного фьючерсного контракта (отражается в противоположную сторону для закрытия позиции в учете), 12 – не используется, 13 – не используется, 14 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 15 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 16 – не используется, 17 – не является сделкой, операция по изменению позиции по фьючерсному контракту с текущей датой исполнения, базовым активом которого является данная иностранная валюта / ценная бумага / драгоценный металл, в количестве и по направлению, соответствующему переданному / полученному Профилю актива по иностранной валюте / ценной бумаге /драгоценному металлу (коллатеральный инструмент)/, 18 – для сделок, заключенных на основании Индикативных заявок, 19 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, заключенных на основании Индикативных заявок, 20 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, заключенных на основании Индикативных заявок, 21 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга при проведении процедуры кросс-дефолта,

Название поля	Тип поля	Описание поля
		22 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование, 23 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга, не исполнившего Обязательства по поставке по поставочным Срочным контрактам на драгоценные металлы, 24 – для Сделок, заключенных путем подачи поручения об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией, 25 – для Сделок, заключенных вследствие подачи Участником клиринга – Покупателем поручения об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией, 26 – для исполнения однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией посредством заключения квартального фьючерсного контракта, 27 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие, 28 – для Сделок, заключенных на основании Заявки с указанием спреда «TAS» (опция Trade at Settlement).
var_marg_b	numeric(16,2)	Вариационная маржа покупателя по сделке (руб.)
var_marg_s	numeric(16,2)	Вариационная маржа перевод продавца по сделке (руб.)
user_sell	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Продавца
user_buy	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Покупателя
no_buy	numeric(19)	Номер заявки покупателя в торговой системе
no_sell	numeric(19)	Номер заявки продавца в торговой системе
fee_buy	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресной сделки покупателем (руб.)
fee_sell	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресной сделки продавцом (руб.)
date2	Date	Дата регистрации сделки
comm_buy	char(20)	Комментарий покупателя
comm_sell	char(20)	Комментарий продавца
fee_ns_b	numeric(16, 2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение адресной сделки покупателем (руб.)
fee_ns_s	numeric(16, 2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение адресной сделки продавцом (руб.)
price_rur	numeric(16, 5)	Цена заключения фьючерсных контрактов (в рублях РФ)
ext_id_b	numeric(11)	Внешний номер покупателя.
ext_id_s	numeric(11)	Внешний номер продавца.
date_clr	date	Дата проведения клиринга.
repo_id	numeric(19)	Поле содержит id_deal другой части сделки для фьючерсных контрактов в календарном спреде. В иных случаях – значение '0'
fee_ex_b	numeric(16,2)	Биржевой сбор за заключение адресной / безадресной сделки покупателем (руб.)
fee_cc_b	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за заключение адресной / безадресной сделки покупателем (руб.)
fee_ex_s	numeric(16,2)	Биржевой сбор за заключение адресной / безадресной сделки продавцом (руб.)
fee_cc_s	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за заключение адресной / безадресной сделки продавцом (руб.)
id_mult	numeric(19)	Признак технической сделки, являющейся частью связанной сделки, в данном поле проставляется идентификационный номер связанной сделки. Аналог полю id_deal_multileg в Plaza-2 шлюзе в таблице сделок. Для обычных сделок признак не указывается.
signs_buy	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Покупателя. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на

Название поля	Тип поля	Описание поля
		ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
signs_sell	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Продавца. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
counterparty	char(7)	Код контрагента по Сделке (Идентификатор Участника клиринга или код Брокерской фирмы, открытой в рамках Идентификатора Участника клиринга), заключенной на основании адресной Заявки. Для Сделок со значением '27' в полях type_buy/ type_sell указывается код 'CCNC' центрального контрагента (Клиринговый центр)
ncc_request_buy	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Покупатель): 0 – отсутствует, 1 – присутствует
ncc_request_sell	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Продавец): 0 – отсутствует, 1 – присутствует
var_marg_b_settl_price	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи, связанная с изменением Расчетной цены по фьючерсному контракту (в рублях РФ)
var_marg_b_swap_rate	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи, 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 (в рублях РФ)
var_marg_s_settl_price	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи, связанная с изменением Расчетной цены по фьючерсному контракту (в рублях РФ)
var_marg_s_swap_rate	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи, 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 (в рублях РФ)
var_marg_b_index_div	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи с учетом дивидендных выплат по ценным бумагам, входящих в базу расчетов Индексов Московской Биржи, для однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией на Индексы Московской Биржи (в рублях РФ)
var_marg_s_index_div	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи с учетом дивидендных выплат по ценным бумагам, входящих в базу расчетов Индексов Московской Биржи, для однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией на Индексы Московской Биржи (в рублях РФ)

Примечание:

1. Файл формируется при установлении услуги формирования отчетов по разделу клиринговых регистров.

3.3. Отчет f04_XXYY.csv

Информация о фьючерсных сделках Брокерской фирмы и ее клиентов, где XXYY – код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *f04_XXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
id_deal	numeric(19)	Идентификатор сделки в торговой системе
isin	char(25)	Уникальный код инструмента (фьючерсного контракта)
price	numeric(16,5)	Цена заключения фьючерсных контрактов (в пунктах)
vol	numeric(10)	Количество инструментов в сделке (шт.)
kod_sell	char(7)	Код продавца

Название поля	Тип поля	Описание поля
kod_buy	char(7)	Код покупателя
date	char(10)	Дата регистрации сделки
time	char(8)	Время сделки.
type_buy	numeric(2)	Тип сделки Покупателя: 0 – безадресная сделка, 1 – возникла в результате экспирации опционов, 2 – адресная сделка/ или перевод позиций между разделами с одинаковыми идентификационными данными с признаком битовой маски 0x8 в шлюзе и уникальным ненулевым id в поле signs_buy, 3 – для Сделок, заключенных по закрывающим и балансирующим сделкам с Добросовестным участником клиринга, 4 – первая часть сделки РЕПО - не используется, 5 – вторая часть сделки РЕПО - не используется, 7 – сделки купли-продажи по разделам ДУ (вместо сделок РЕПО) - не используется, 8 – сделки исполнения поставочного фьючерсного контракта через инструмент Standard - не используется, 9 – первая части сделки РЕПО T+N - не используется, 10 – вторая часть сделки РЕПО T+N - не используется, 11 – закрытие позиции в результате исполнения расчетного/поставочного фьючерсного контракта (отражается в противоположную сторону для закрытия позиции в учете), 12 – не используется, 13 – не используется, 14 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 15 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 16 – не используется, 17 – не является сделкой, операция по изменению позиции по фьючерсному контракту с текущей датой исполнения, базовым активом которого является данная иностранная валюта / ценная бумага / драгоценный металл, в количестве и по направлению, соответствующему переданному / полученному Профилю актива по иностранной валюте / ценной бумаге /драгоценному металлу (коллатеральный инструмент)/, 18 – для сделок, заключенных на основании Индикативных заявок, 19 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, заключенных на основании Индикативных заявок, 20 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, заключенных на основании Индикативных заявок, 21 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга при проведении процедуры кросс-дефолта, 22 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование, 23 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга, не исполнившего Обязательства по поставке по поставочным Срочным контрактам на драгоценные металлы, 24 – для Сделок, заключенных путем подачи поручения об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией,

Название поля	Тип поля	Описание поля
		25 – для Сделок, заключенных вследствие подачи Участником клиринга – Продавцом поручения об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией, 26 – для исполнения однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией посредством заключения квартального фьючерсного контракта, 27 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие, 28 – для Сделок, заключенных на основании Заявки с указанием спреда «TAS» (опция Trade at Settlement).
type_sell	numeric(2)	Тип сделки Продавца: 0 – безадресная сделка, 1 – возникла в результате экспирации опционов, 2 – адресная сделка/ или перевод позиций между разделами с одинаковыми идентификационными данными с признаком битовой маски 0x8 в шлюзе и уникальным ненулевым id в поле signs_sell, 3 – для Сделок, заключенных по закрывающим и балансирующим сделкам с Добросовестным участником клиринга, 4 – первая часть сделки РЕПО - не используется, 5 – вторая часть сделки РЕПО - не используется, 7 – сделки купли-продажи по разделам ДУ (вместо сделок РЕПО) - не используется, 8 – сделки исполнения поставочного фьючерсного контракта через инструмент Standard - не используется, 9 – первая части сделки РЕПО T+N - не используется, 10 – вторая часть сделки РЕПО T+N - не используется, 11 – закрытие позиции в результате исполнения расчетного/поставочного фьючерсного контракта (отражается в противоположную сторону для закрытия позиции в учете), 12 – не используется, 13 – не используется, 14 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 15 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 16 – не используется, 17 – не является сделкой, операция по изменению позиции по фьючерсному контракту с текущей датой исполнения, базовым активом которого является данная иностранная валюта / ценная бумага / драгоценный металл, в количестве и по направлению, соответствующему переданному / полученному Профилю актива по иностранной валюте / ценной бумаге /драгоценному металлу (коллатеральный инструмент)/, 18 – для сделок, заключенных на основании Индикативных заявок, 19 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, заключенных на основании Индикативных заявок, 20 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, заключенных на основании Индикативных заявок, 21 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга при проведении процедуры кросс-дефолта, 22 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование,

Название поля	Тип поля	Описание поля
		23 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга, не исполнившего Обязательства по поставке по поставочным Срочным контрактам на драгоценные металлы, 24 – для Сделок, заключенных путем подачи поручения об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией, 25 – для Сделок, заключенных вследствие подачи Участником клиринга – Покупателем поручения об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией, 26 – для исполнения однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией посредством заключения квартального фьючерсного контракта, 27 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие, 28 – для Сделок, заключенных на основании Заявки с указанием спреда «TAS» (опция Trade at Settlement).
var_marg_b	numeric(16,2)	Вариационная маржа покупателя по сделке (руб.)
var_marg_s	numeric(16,2)	Вариационная маржа продавца по сделке (руб.)
user_sell	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Продавца
user_buy	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Покупателя
no_buy	numeric(19)	Номер заявки покупателя в торговой системе
no_sell	numeric(19)	Номер заявки продавца в торговой системе
fee_buy	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресной сделки покупателем (руб.)
fee_sell	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресной сделки продавцом (руб.)
date2	Date	Дата регистрации сделки
comm_buy	char(20)	Комментарий покупателя
comm_sell	char(20)	Комментарий продавца
fee_ns_b	numeric(16, 2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение адресной сделки покупателем (руб.)
fee_ns_s	numeric(16, 2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение адресной сделки продавцом (руб.)
price_rur	numeric(16, 5)	Цена заключения фьючерсных контрактов (в рублях РФ)
ext_id_b	numeric(11)	Внешний номер покупателя.
ext_id_s	numeric(11)	Внешний номер продавца.
date_clr	date	Дата проведения клиринга.
repo_id	numeric(19)	Поле содержит id_deal другой части сделки для фьючерсных контрактов в календарном спреде. В иных случаях – значение '0'
fee_ex_b	numeric(16,2)	Биржевой сбор за заключение адресной / безадресной сделки покупателем (руб.)
fee_cc_b	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за заключение адресной / безадресной сделки покупателем (руб.)
fee_ex_s	numeric(16,2)	Биржевой сбор за заключение адресной / безадресной сделки продавцом (руб.)
fee_cc_s	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за заключение адресной / безадресной сделки продавцом (руб.)
id_mult	numeric(19)	Признак технической сделки, являющейся частью связанной сделки, в данном поле проставляется идентификационный номер связанной сделки. Аналог полю id_deal_multileg в Plaza-2 шлюзе в таблице сделок. Для обычных сделок признак не указывается.
signs_buy	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Покупателя. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])

Название поля	Тип поля	Описание поля
signs_sell	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Продавца. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
counterparty	char(7)	Код контрагента по Сделке (Идентификатор Участника клиринга или код Брокерской фирмы, открытой в рамках Идентификатора Участника клиринга), заключенной на основании адресной Заявки. Для Сделок со значением '27' в полях type_buy/ type_sell указывается код 'CCNC' центрального контрагента (Клиринговый центр)
ncc_request_buy	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Покупатель): 0 – отсутствует, 1 – присутствует
ncc_request_sell	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Продавец): 0 – отсутствует, 1 – присутствует
var_marg_b_settl_price	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи, связанная с изменением Расчетной цены по фьючерсному контракту (в рублях РФ)
var_marg_b_swap_rate	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи, 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 (в рублях РФ)
var_marg_s_settl_price	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи, связанная с изменением Расчетной цены по фьючерсному контракту (в рублях РФ)
var_marg_s_swap_rate	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи, 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 (в рублях РФ)
var_marg_b_index_div	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи с учетом дивидендных выплат по ценным бумагам, входящих в базу расчетов Индексов Московской Биржи, для однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией на Индексы Московской Биржи (в рублях РФ)
var_marg_s_index_div	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи с учетом дивидендных выплат по ценным бумагам, входящих в базу расчетов Индексов Московской Биржи, для однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией на Индексы Московской Биржи (в рублях РФ)

Примечание:

1. id_deal соответствует идентификатору сделки, выдаваемому шлюзовыми процедурами.
2. Поле isin = полю contract в f07.
3. Для перевода price в рубли существуют формулы:
   a. Если f07.is_percent = 0, то $Price_{rur}$=R {R [f07.tick_price / f07.tick ; 5] * Price ; 5}
   b. Если f07.is_percent = 1, то $Price_{rur}$=1000000 / [1 + Price / 36500]^{n}

      , где n – разница в днях между f07.execution и f07.date.
4. no_buy, no_sell – идентификаторы заявок, на основе которых заключена сделка. Данные идентификаторы соответствует идентификаторам заявок, выдаваемых шлюзовыми процедурами.
5. Поле date2 по смыслу аналогично полю date.
6. Поля no_buy, no_sell = полю private_order_id в fordlogXXYY.csv, если сделка заключена на основании айсберг заявки, будет указываться номер Айсберг-заявки.

3.4. Отчет f07.csv

Результаты торгов фьючерсными контрактами. Файл формата csv.

Структура отчета *f07.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения торгов
contract	char(25)	Уникальный код инструмента (фьючерсного контракта, инструмента связки)
execution	char(10)	Дата окончания обращения инструмента (дата исполнения)
volume	numeric(10)	Количество инструментов в заключенных Сделках (в штуках)
vol_rubl	numeric(17,2)	Объем обязательств по заключенным Сделкам (в рублях РФ)
low	numeric(16,5)	Минимальная цена сделки (пункты)
high	numeric(16,5)	Максимальная цена сделки (пункты)
open	numeric(16,5)	Цена открытия (пункты)
close	numeric(16,5)	Цена закрытия (пункты)
settl	numeric(16,5)	Расчетная цена (пункты)
trades	numeric(10)	Количество записей, внесенных в Реестр сделок при регистрации заключенных Сделок/ Связок
interest	numeric(10)	Количество Инструментов в заключенных Сделках, обязательства по которым не прекращены, учитываемых на разделах регистра учета позиций (в штуках)
fee	numeric(16,5)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за один фьючерсный контракт (в рублях РФ)
tick_price	numeric(16,5)	Стоимость шага цены (руб.)
tick	numeric(16,5)	Минимальный шаг цены (пункты)
avrg	numeric(16,5)	Средневзвешенная цена (пункты)
poses_rubl	numeric(17,2)	Объем позиций в рублях
risk_wr	numeric(16,5)	Величина добавочного риска, который несут позиции в продажу опционов на этот фьючерс по клиентскому счёту (руб.)
coffout	numeric(7,5)	Краевой коэффициент опционов на этот фьючерс
base_fut	char(25)	Код базисного актива фьючерсного контракта, являющегося базисным активом опционного контракта / код ценной бумаги
is_spread	numeric(1)	Признак вхождения Инструмента в группу Инструментов, определенную Методикой определения риск-параметров срочного рынка: 1 – фьючерсный контракт входит в группу, 0 – фьючерсный контракт не входит в группу.
name	char(25)	Краткий код фьючерсного контракта
date2	date	Дата проведения торгов
execution2	date	Дата окончания обращения инструмента (дата исполнения)
deposit	numeric(16,5)	Базовое гарантийное обеспечение под одну позицию (руб.)
is_percent	numeric(1)	Признак фьючерсного контракта: 0 – указывается не в процентах, 1 – указывается в процентах, 2 – признак контракта на электроэнергию, 3 – признак контракта на еврооблигации, 4 – признак контракта на ставку RUONIA
settl_rur	numeric(16,5)	Расчетная цена в руб.
lot_volume	numeric(10)	Количество единиц базового актива в контракте (лот)
tick_pr_go	numeric(16,5)	Стоимость шага цены в руб. для расчета ГО (руб.)
limit_l1	numeric(16,5)	Лимит L1. Широкий лимит (пункты)
type_exec	numeric(1)	Тип исполнения инструмента: 0 – расчетный; 1 - поставочный

Название поля	Тип поля	Описание поля
section	char(50)	Секция, к которой относится инструмент
type_sbor	char(50)	Тип расчета биржевого сбора, указанного в полях «fee» и «nc_fee»: RUR – в рублях за один контракт; PERCENT – в % от суммы сделки
ns_volume	numeric(10)	Оборот по адресным сделкам в контрактах
ns_trades	numeric(10)	Количество адресных сделок
ns_fee	numeric(16,5)	Ставка сбора по адресным сделкам
ns_volrubl	numeric(24,2)	Оборот по адресным сделкам в рублях
l_tradeday	date	Дата последнего торгового дня по инструменту
multileg	numeric(1)	Имеет признак: 0 – обычная сделка, 1- связанная сделка
deposit_buy	numeric(16,5)	Ставка обеспечения по инструменту, рассчитанная с учетом направления позиции в покупку (в рублях РФ)
deposit_sell	numeric(16,5)	Ставка обеспечения по инструменту, рассчитанная с учетом направления позиции в продажу (в рублях РФ)
swap_rate	numeric(16,5)	Ставка обеспечения при отклонении цены фьючерсного контракта от цены базового актива больше заданного на уровне фьючерсного контракта (в рублях РФ). Определяется в соответствии со спецификации контракта.
index_div	numeric(18,4)	Значение с учетом дивидендных выплат по ценным бумагам, входящих в базу расчетов Индексов Московской Биржи, для однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией на Индексы Московской Биржи (в пунктах).
buy_deposit_erc	numeric(16,2)	Базовое ГО покупателя для КОУР (руб)
sell_deposit_erc	numeric(16,2)	Базовое ГО продавца для КОУР (руб)
buy_deposit_hrc	numeric(16,2)	Базовое ГО покупателя для КПУР (руб)
sell_deposit_hrc	numeric(16,2)	Базовое ГО продавца для КПУР (руб)
buy_deposit_lrc	numeric(16,2)	Базовое ГО покупателя для КНУР (руб)
sell_deposit_lrc	numeric(16,2)	Базовое ГО продавца для КНУР (руб)
buy_deposit_mrc	numeric(16,2)	Базовое ГО покупателя для КСУР (руб)
sell_deposit_mrc	numeric(16,2)	Базовое ГО продавца для КСУР (руб)
exp_enforcement_pay	numeric(16,2)	Сумма платежа (в рублях) за 1 контракт по сделкам прекращения обязательств по вечным фьючерсам, в случае принудительного исполнения, от стороны подавшей поручение на выход из вечного фьючерса, стороне, которую принудительно закрыли

Примечание:

1. Ключевые поля date (или date2), contract
2. Базовый фьючерсный контракт (base_fut) включает в себя все фьючерсы на этот базовый фьючерсный контракт.
3. Поле date2 по смыслу аналогично полю date.
4. Поле execution2 по смыслу аналогично полю execution. Оно отличается от поля execution2 только форматом.
5. В полях interest, poses_rubl, limit, risk_wr, coffout, is_spread, is_percent, settl_rur, pr_settl_r для Связок всегда – 0.
6. Поля base_fut, type_exec для Связок всегда пустые.
7. Значение settl_rur=round(settl*round(tick_price/tick;5);2).
8. Значения, рассчитанные в полях low, high, open, close, не учитывают цены сделок с календарными спредами и сделок, заключенных на основании индикативных заявок.
9. Значение, рассчитанное в поле avrg, не учитывает цены сделок, заключенных на основании индикативных заявок.
10. В полях volume, vol_rubl не учитывается оборот по сделкам, заключенным на основании индикативных заявок.
11. Значение в поле swap_rate заполняется по однодневным фьючерсным контрактам с автопролонгацией, по остальным инструментам значение – 0.

3.5. Отчет fposclXXYYZZZ.csv

Информация о позиционном состоянии клиентов по фьючерсным контрактам/ коллатеральным инструментам, где XXYYZZZ - код раздела. Файл формата csv.

Структура отчета *fposclXXYYZZZ.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
kod	char(7)	Код клиента
account	char(2)	Признак клиента ('CL' – клиент)
isin	char(25)	Уникальный код инструмента (фьючерсный контракт/ коллатеральный инструмент)
pos_beg	numeric(11)	Количество позиций на начало дня
pos_end	numeric(11)	Количество позиций на конец дня
var_marg_p	numeric(16,2)	Начисленная вариационная маржа по открытым позициям на начало дня (руб.)
var_marg_d	numeric(16,2)	Начисленная вариационная маржа по сделкам (руб.)
sbor	numeric(16,2)	Начисленная сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за безадресные сделки (руб.)
go_brutto	numeric(16,2)	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.)
pos_exec	numeric(11)	Количество исполненных позиций (больше нуля – исполняется продажа; меньше нуля - покупка)
du	numeric(1)	Счет ДУ (1 – ДУ, 0 – не ДУ)
sbor_exec	numeric(16,2)	Начисленное комиссионное вознаграждение Клирингового центра за исполнение (руб.).
sbor_nosys	numeric(16,2)	Начисленная сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за адресные сделки (руб.)
fee_exec	numeric(16,2)	Начисленные пени за просрочку исполнения по фьючерсным контрактам
fine_exec	numeric(16,2)	Начисленная неустойка за неисполнение фьючерсных контрактов
sbor_ex	numeric(16,2)	Начисленный биржевой сбор за адресные и безадресные сделки (руб.)
sbor_cc	numeric(16,2)	Начисленное комиссионное вознаграждение Клирингового центра за адресные и безадресные сделки (руб.)
var_marg_p_settl_price	numeric(16,2)	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)
var_marg_p_swap_rate	numeric(16,2)	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)
var_marg_d_settl_price	numeric(16,2)	Составляющая часть, связанная с изменением Расчетной цены по фьючерсному контракту, Вариационной маржи по Сделкам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)
var_marg_d_swap_rate	numeric(16,2)	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)
var_marg_p_index_div	numeric(16,2)	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)
var_marg_d_index_div	numeric(16,2)	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)
pos_enforcement_exec	numeric(20)	Количество принудительно исполненных позиций для выхода из вечного фьючерса

Название поля	Тип поля	Описание поля
pay_enforcement_exec	numeric(16,2)	Сумма платежа (с учетом знака) за принудительное исполнение вечного фьючерса

Примечание:

1. Ключевые поля date, kod, account, isin.
2. Итоговая вариационная маржа считается как var_marg_p + var_marg_d.
3. Если в день исполнения pos_beg <> 0, то pos_end = 0, а pos_exec = - pos_beg.
4. Файл формируется при установлении услуги формирования отчетов по разделу клиринговых регистров.

3.6. Отчет fposXXYY.csv

Информация о позиционном состоянии Участника клиринга/ Брокерской фирмы и их клиентов по фьючерсным контрактам/ коллатеральным инструментам. Файл формата csv.

Структура отчета *fposXXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
kod	char(7)	Код Брокерской фирмы / код раздела регистра учета позиций / Расчетный код
account	char(2)	Признак обязательств: 'BF' – суммарные обязательства, учитываемые на разделах регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы, указанный в поле «kod», 'CL' – обязательства, учитываемые на разделе регистра учета позиций, имеющем код, указанный в поле «kod», 'RK' – суммарные обязательства, учитываемые на Расчетном коде, указанный в поле «kod».
isin	char(25)	Уникальный код инструмента (фьючерсный контракт/ коллатеральный инструмент)
pos_beg	numeric(11)	Количество позиций на начало дня
pos_end	numeric(11)	Количество позиций на конец дня
var_marg_p	numeric(16,2)	Начисленная вариационная маржа по открытым позициям на начало дня (руб.)
var_marg_d	numeric(16,2)	Начисленная вариационная маржа по сделкам (руб.)
sbor	numeric(16,2)	Начисленная сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за безадресные сделки (руб.)
go_brutto	numeric(16,2)	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.)
pos_exec	numeric(11)	Количество исполненных позиций (больше нуля – исполняется продажа; меньше нуля - покупка)
du	numeric(1)	Счет ДУ (1 – ДУ, 0 – не ДУ)
sbor_exec	numeric(16,2)	Начисленное комиссионное вознаграждение Клирингового центра за исполнение (руб.).
sbor_nosys	numeric(16,2)	Начисленная сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за адресные сделки (руб.)
fee_exec	numeric(16,2)	Начисленные пени за просрочку исполнения по фьючерсным контрактам
fine_exec	numeric(16,2)	Начисленная неустойка за неисполнение фьючерсных контрактов
sbor_ex	numeric(16,2)	Начисленный биржевой сбор за адресные и безадресные сделки (руб.)
sbor_cc	numeric(16,2)	Начисленное комиссионное вознаграждение Клирингового центра за адресные и безадресные сделки (руб.)
var_marg_p_settl_price	numeric(16,2)	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)

Название поля	Тип поля	Описание поля
var_marg_p_swap_rate	numeric(16,2)	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)
var_marg_d_settl_price	numeric(16,2)	Составляющая часть, связанная с изменением Расчетной цены по фьючерсному контракту, Вариационной маржи по Сделкам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)
var_marg_d_swap_rate	numeric(16,2)	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)
var_marg_p_index_div	numeric(16,2)	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)
var_marg_d_index_div	numeric(16,2)	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)
pos_enforcement_exec	numeric(20)	Количество принудительно исполненных позиций для выхода из вечного фьючерса
pay_enforcement_exec	numeric(16,2)	Сумма платежа (с учетом знака) за принудительное исполнение вечного фьючерса

Примечание:

1. Ключевые поля date, kod, account, isin
2. Если в день исполнения pos_beg <> 0, то pos_end = 0, а pos_exec = - pos_beg.

3.7. Отчет moncbXXYY.csv/moncbXX00.csv

Информация об иностранной валюте, а также Профиля актива, предоставленных в качестве Обеспечения Участником клиринга/ Брокерской фирмой и их клиентов. Файл формата csv.

Структура отчета *moncbXXYY.csv/moncbXX00.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
kod	char(7)	Код Брокерской фирмы / Код раздела денежного регистра / Расчетный код
account	char(2)	Признак учета: 'BF' – иностранная валюта / Профиль актива, учитываемые на всех разделах денежного регистра Брокерской фирмы, 'CL' – иностранная валюта / Профиль актива, учитываемые на разделе денежного регистра, 'RK' – иностранная валюта / Профиль актива, учитываемые на всех разделах денежного регистра по Расчетному коду
type	char(60)	Код иностранной валюты / Профиля актива
amount_beg	numeric(10)	Количество иностранной валюты/ Профиля актива на начало отчетного дня (в штуках)
amt_beg_cb	numeric(16,2)	Стоимость иностранной валюты / Профиля актива по иностранной валюте на начало отчетного дня (в рублях РФ) по курсу ЦБ РФ на предыдущий отчетный день. Для Профиля актива по ценной бумаге, драгоценному металлу равно 0.
pay	numeric(16,2)	Изменение количества иностранной валюты/ Профиля актива в течение дня (в штуках)
pay_rub	numeric(16,2)	Изменение стоимости иностранной валюты/ Профиля актива по иностранной валюте в течение дня (в рублях РФ) по курсу ЦБ РФ на отчетный день. Для Профиля актива по ценной бумаге, драгоценному металлу равно «0»

Название поля	Тип поля	Описание поля
prem	numeric(16,2)	Изменение стоимости иностранной валюты, в которой осуществляются денежные расчеты Премий по опционным контрактам, заключенным в течение дня (в рублях РФ)
amount_end	numeric(10)	Количество иностранной валюты/ Профиля актива на конец отчетного дня (в штуках)
amt_end_cb	numeric(16,2)	Стоимость иностранной валюты / Профиля актива по иностранной валюте на конец отчетного дня (в рублях РФ) по курсу ЦБ РФ на отчетный день. Для Профиля актива по ценной бумаге, драгоценному металлу равно 0
rate_cb	numeric(16,5)	Курс ЦБ РФ иностранной валюты / Профиля актива по иностранной валюте на отчетный день. Для Профиля актива по ценной бумаге, драгоценному металлу равно 0
rate	numeric(16,5)	Оценочная стоимость единицы иностранной валюты/ единицы Профиля актива (в рублях РФ)
go	numeric(16,2)	Оценочная стоимость иностранной валюты/ Профиля актива (в рублях РФ)*
com_ensure	numeric(1)	Тип Средств обеспечения: 0 – средства частичного обеспечения – не используется; 1 – средства полного обеспечения в иностранной валюте/ Профиле актива.

Примечание:

1. Профиль актива – это Профиль актива по иностранной валюте / ценной бумаге/ драгоценному металлу.
2. Оценочная стоимость иностранной валюты, указываемая в полях «rate» и «go», определяется в соответствии с Методикой выбора и оценки иностранной валюты, принимаемых в качестве Обеспечения, утверждаемой Клиринговым центром.
3. *Значение в поле «go» носит информационный характер, не равно значению в поле «com_pl_end» в файле monXXYY.csv.
4. В файле moncbXXYY.csv уровня Брокерской фирмы в случае, если Участник клиринга или Участник торгов не имеет права управлять клиентами в рамках данной Брокерской фирмы, в поле account по признаку 'CL' не предоставляется информация по кодам разделов денежных регистров таких клиентов.
5. Отчет предоставляется по итогам основной клиринговой сессии.

3.8. Отчет monclXXYYZZZ.csv

Отчет по деньгам клиента по итогам Клиринговой сессии. Файл формата csv.

Структура отчета *monclXXYYZZZ.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
settle_date	char(10)	Дата расчетов T+1, т.е. дата дня, когда будет Расчетная сессия
kod	char(12)	Код Брокерской фирмы / раздела денежного регистра / Расчетный код
account	char(2)	признак клиента ('CL' - клиент)
type	char(2)	Тип Обеспечения: ‘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	numeric(16, 2)	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)
var_marg	numeric(16, 2)	Вариационная маржа (руб.) фактически зачисленная/списанная в Расчетную сессию
var_marg_mtm	numeric(16, 2)	Вариационная маржа (руб.) начисленная в Клиринговую сессию
prem	numeric(16, 2)	Опционная премия (руб.) фактически зачисленная/списанная в Расчетную сессию
prem_mtm	numeric(16, 2)	Опционная премия (руб.) начисленная в Клиринговую сессию
in_out_netto	numeric(16, 2)	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
charges	numeric(16, 2)	Фактическое исполнение в Расчетную сессию обязательства по уплате комиссий, штрафов и обязательства по выплате / получению единовременного платежа по выходу из вечного фьючерса

Название поля	Тип поля	Описание поля
charges_mtm	numeric(16, 2)	Начисленные обязательства по уплате комиссий, штрафов и обязательства по выплате / получению единовременного платежа по выходу из вечного фьючерса
fut_sbor	numeric(16, 2)	Рассчитанная в Расчетную сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с фьючерсами (руб.)
fut_sbor_mtm	numeric(16, 2)	Начисленная в Клиринговую сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с фьючерсами (руб.)
opt_sbor	numeric(16, 2)	Рассчитанная в Расчетную сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с опционами (руб.)
opt_sbor_mtm	numeric(16, 2)	Начисленная в Клиринговую сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с опционами (руб.)
nov	numeric(16,2)	Оценочная стоимость объема позиций опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги, на конец отчетного дня (в рублях РФ)
go	numeric(16, 2)	Сумма гарантийного обеспечения по всем инструментам по риск-параметрам
amount_end	numeric(16, 2)	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_mtm	numeric(16, 2)	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 (в рублях РФ)
free	numeric(16, 2)	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)
du	numeric(1)	Признак того, что раздел денежного регистра предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении
sbor_ex	numeric(16,2)	Рассчитанный в Расчетную сессию биржевой сбор за адресные и безадресные сделки (руб.)
sbor_ex_mtm	numeric(16,2)	Начисленные обязательства по уплате биржевого сбора за адресные и безадресные сделки (руб.)
sbor_cc	numeric(16,2)	Рассчитанная в Расчетную сессию сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра за адресные и безадресные сделки (руб.)
sbor_cc_mtm	numeric(16,2)	Начисленные обязательства по уплате Комиссионного вознаграждения Клирингового центра за адресные и безадресные сделки (руб.)
rub_beg	numeric(16,2)	Сумма денежных средств в рублях РФ на начало торгового дня
rub_pay	numeric(16,2)	Изменение суммы денежных средств в рублях РФ в течение торгового дня по операциям ввода/ вывода, и расчета по вм, премии и charges
rub_end	numeric(16,2)	Сумма денежных средств в рублях РФ на конец торгового дня
com_pl_beg	numeric(16,2)	Оценочная стоимость иностранной валюты и/или Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на начало отчетного дня (в рублях РФ)
com_pl_pay	numeric(16,2)	Изменение оценочной стоимости иностранной валюты и/или Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу в течение дня (в рублях РФ)
com_pl_prem	numeric(16,2)	Изменение оценочной стоимости объема позиций опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги, в течение дня (в рублях РФ)
com_pl_end	numeric(16,2)	Оценочная стоимость иностранной валюты и/или Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на конец отчетного дня (в рублях РФ)

Примечание:

1. Ключевые поля date, kod, account, type.
2. Поле prem должно содержать сумму премии по сделкам с немаржируемыми опционами.
3. Поле var_marg должно содержать сумму вариационной маржи по фьючерсам и маржируемым опционам.
4. Поле amount_end вычисляется как amount_end = amount_begin + in_out_netto+ var_marg + prem+ charges.
5. Поле amount_end_mtm вычисляется как amount_end_mtm = amount_end + var_marg_mtm + prem_mtm+ charges_mtm.
6. Поле free вычисляется как amount_end_mtm – go + nov.
7. Файл формируется при установлении услуги формирования отчетов по разделу клиринговых регистров.
8. Для type ='PL' поля rub_beg, rub_pay, rub_end, com_pl_beg, com_pl_pay, com_pl_end не заполняются.

3.9. Отчет monXXYY.csv/monXX00.csv

Отчет по деньгам БФ/РФ по итогам Клиринговой сессии. Файл формата csv.

Структура отчета *monXXYY.csv/monXX00.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
settle_date	char(10)	Дата расчетов T+1, т.е. дата дня, когда будет Расчетная сессия
kod	char(12)	Код Брокерской фирмы / раздела денежного регистра / Расчетный код
account	char(2)	Признак Обеспечения: 'BF' – суммарные средства, учитываемые на Брокерской фирме, 'CL' – средства, учитываемые на разделе денежного регистра, 'RK' – суммарные средства, учитываемые на Расчетном коде.
type	char(2)	Тип Обеспечения: '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	numeric(16, 2)	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)
var_marg	numeric(16, 2)	Вариационная маржа (руб.) фактически зачисленная/списанная в Расчетную сессию
var_marg_mtm	numeric(16, 2)	Вариационная маржа (руб.) начисленная в Клиринговую сессию
prem	numeric(16, 2)	Опционная премия (руб.) фактически зачисленная/списанная в Расчетную сессию
prem_mtm	numeric(16, 2)	Опционная премия (руб.) начисленная в Клиринговую сессию
in_out_netto	numeric(16, 2)	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
charges	numeric(16, 2)	Фактическое исполнение обязательства по уплате комиссий, штрафов и обязательства по выплате / получению единовременного платежа по выходу из вечного фьючерса
charges_mtm	numeric(16, 2)	Начисленные обязательства по уплате комиссий, штрафов и обязательства по выплате / получению единовременного платежа по выходу из вечного фьючерса
fut_sbor	numeric(16, 2)	Рассчитанная в Расчетную сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с фьючерсами (руб.)
fut_sbor_mtm	numeric(16, 2)	Начисленная в Клиринговую сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с фьючерсами (руб.)
opt_sbor	numeric(16, 2)	Рассчитанная в Расчетную сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с опционами (руб.)
opt_sbor_mtm	numeric(16, 2)	Начисленная в Клиринговую сессию сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресных сделок с опционами (руб.)

Название поля	Тип поля	Описание поля
nov	numeric(16,2)	Оценочная стоимость объема позиций опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги, на конец отчетного дня (в рублях РФ)
go	numeric(16, 2)	Сумма гарантийного обеспечения по всем инструментам по риск-параметрам
amount_end	numeric(16, 2)	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_mtm	numeric(16, 2)	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 (в рублях РФ)
free	numeric(16, 2)	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).
du	numeric(1)	Признак того, что раздел денежного регистра предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении
sbor_ex	numeric(16,2)	Рассчитанная с Расчетную сессию сумма Биржевогой сбора за адресные и безадресные сделки (руб.)
sbor_ex_mtm	numeric(16,2)	Начисленные обязательства по уплате биржевого сбора за адресные и безадресные сделки (руб.)
sbor_cc	numeric(16,2)	Рассчитанная в Расчетную сессию сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра за адресные и безадресные сделки (руб.)
sbor_cc_mtm	numeric(16,2)	Начисленное обязательство по уплате Комиссионного вознаграждения Клирингового центра за адресные и безадресные сделки (руб.)
rub_beg	numeric(16,2)	Сумма денежных средств в рублях РФ на начало торгового дня
rub_pay	numeric(16,2)	Изменение суммы денежных средств в рублях РФ в течение торгового дня
rub_end	numeric(16,2)	Сумма денежных средств в рублях РФ на конец торгового дня
com_pl_beg	numeric(16,2)	Оценочная стоимость иностранной валюты и/или Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на начало отчетного дня (в рублях РФ)
com_pl_pay	numeric(16,2)	Изменение оценочной стоимости иностранной валюты и/или Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу в течение дня (в рублях РФ)
com_pl_prem	numeric(16,2)	Изменение оценочной стоимости объема позиций опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги, в течение дня (в рублях РФ)
com_pl_end	numeric(16,2)	Оценочная стоимость иностранной валюты и/или Профиля актива по иностранной валюте, ценной бумаге, драгоценному металлу на конец отчетного дня (в рублях РФ)

Примечание:

1. Ключевые поля date, kod, account, type.
2. Поля kod=‘Расчетный код’ и account=‘RK’ отражаются в отчете monXX00 уровня Участника клиринга.
3. Для BF поле go вычисляется не как сумма равная соответствующим полям по всем ее клиентам.
4. Поле amount_end вычисляется как amount_end = amount_begin + in_out_netto+ var_marg + prem+ charges.
5. Поле amount_end_mtm вычисляется как amount_end_mtm = amount_end + var_marg_mtm + prem_mtm+ charges_mtm.
6. Поле free вычисляется как amount_end_mtm – go + nov.
7. Поле prem должно содержать сумму премии по сделкам с немаржируемыми опционами.
8. Поле var_marg должно содержать сумму вариационной маржи по фьючерсам и маржируемым опционам.
9. Для type =‘PL’ поля rub_beg, rub_pay, rub_end, com_pl_beg, com_pl_pay, com_pl_end не заполняются.
10. 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.

11. В файле monXX00.csv в поле go по признаку 'RK' блокируется сумма налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации по Сделкам, являющимся производными финансовыми инструментами, подлежащую удержанию с Участника клиринга – Нерезидента в соответствии с законодательством РФ.

3.10. Отчет multileg_dict.csv

Информация об инструментах-связках. Файл формата csv.

Структура отчета *multileg_dict.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата Торгового дня, в ходе которого возможно заключение сделок с данной Связкой
isin	char(25)	Код (обозначение) Связки
num_legs	numeric(10)	Количество Сделок в Связке
isin_leg	char(25)	Код (обозначение) Инструмента, входящего в Связку
vol	numeric(10)	Количество Инструментов, входящих в Связку (в штуках)

Примечание:

1. Раскрывается, из каких инструментов состоит Связка.
2. Для каждой части связки раскрывается, в каком объеме в Связке представлен инструмент.
3. Объем инструмента может быть как положительный, так и отрицательный. Положительный объем инструмента говорит о длинной позиции в связке. Отрицательный объем говорит о короткой позиции.

3.11. Отчет multilegf04clXXYYZZZ.csv

Информация о связанных сделках клиентов, где XXYYZZZ – код раздела. Файл формата csv.

Структура отчета *multilegf04clXXYYZZZ.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
id_deal	numeric(19)	Идентификационный номер сделки
isin	char(25)	Уникальный код инструмента связки
price1	numeric(16,5)	Цена первой части связанной сделки (в пунктах).
price	numeric(16,5)	Цена сделки (в пунктах).
vol	numeric(10)	Количество контрактов связки (в штуках)
rate	numeric(16,5)	Ставка. Используется для репо и пары сделок (в процентах годовых.
days	numeric(4)	Срок связки (в календарных днях). Используется для репо и пары сделок.
kod_sell	char(7)	Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке по связке, поданной Продавцом, на основании которой заключена связанная сделка
kod_rts_s	char(7)	Код продавца
kod_buy	char(7)	Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке по связке, поданной Покупателем, на основании которой заключена связанная сделка
kod_rts_b	char(7)	Код покупателя
date	char(10)	Дата регистрации связанной сделки
time	char(8)	Время регистрации связанной сделки
type_buy	numeric(2)	Тип связки Покупателя: 2 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки, 3 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании безадресной Заявки 4 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие
type_sell	numeric(2)	Тип связки Продавца: 2 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки,

Название поля	Тип поля	Описание поля
		3 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании безадресной Заявки 4 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие
signs_buy	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Покупателя. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
signs_sell	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Продавца. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
var_marg_b	numeric(16,2)	Вариационная маржа Покупателя по связанной сделке (в рублях РФ)
var_marg_s	numeric(16,2)	Вариационная маржа Продавца по связанной сделке (в рублях РФ)
user_sell	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Продавца по связанной сделке
user_buy	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Покупателя по связанной сделке
no_buy	numeric(19)	Идентификационный номер Заявки по связке, поданной Покупателем, на основании которой заключена связанная сделка
no_sell	numeric(19)	Идентификационный номер Заявки по связке, поданной Продавцом, на основании которой заключена связанная сделка
fee_buy	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ)
fee_sell	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ)
date2	char(10)	Дата регистрации связанной сделки
comm_buy	char(20)	Комментарий в Заявке по связке, поданной Покупателем
comm_sell	char(20)	Комментарий в Заявке по связке, поданной Продавцом
fee_ns_b	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за связанную сделку, заключенную на основании адресной Заявки по связке, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ)
fee_ns_s	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за связанную сделку, заключенную на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ)
price_rur1	numeric(16,5)	Цена первой части связанной сделки в рублях
price_rur	numeric(16,5)	Цена сделки в рублях
ext_id_b	numeric(11)	Дополнительный идентификационный номер, указанный в Заявке по связке, поданной Покупателем
ext_id_s	numeric(11)	Дополнительный идентификационный номер, указанный в Заявке по связке, поданной Продавцом
date_clr	Date	Дата проведения клиринга
fee_ex_b	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Покупателем (в рублях РФ)
fee_cc_b	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Покупателем (в рублях РФ)
fee_ex_s	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Продавцом (в рублях РФ)
fee_cc_s	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Продавцом (в рублях РФ)
id_trade	numeric(19)	Идентификатор записи в таблице сделок, изменяющей позицию в дате поставки по первой части связки (первой сделки, зарегистрированной по результатам исполнения связки)
ncc_request_buy	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Покупатель): 0 – отсутствует, 1 – присутствует
ncc_request_sell	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Продавец):

Название поля	Тип поля	Описание поля
		0 – отсутствует, 1 – присутствует

Примечание:

1. Отчет формируется при установлении услуги формирования отчетов по разделу клиринговых регистров.

3.12. Отчет multilegf04_XXYY.csv

Информация о связанных сделках, заключенных в режиме биржевой торговли Участником клиринга/ Брокерской фирмой и их клиентами. Файл формата csv.

Структура отчета *multilegf04_XXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
id_deal	numeric(19)	Идентификационный номер сделки
isin	char(25)	Уникальный код инструмента связки
price1	numeric(16,5)	Цена первой части связанной сделки (в пунктах).
price	numeric(16,5)	Цена сделки (в пунктах).
vol	numeric(10)	Количество контрактов связки (в штуках)
rate	numeric(16,5)	Ставка. Используется для репо и пары сделок (в процентах годовых.
days	numeric(4)	Срок связки (в календарных днях). Используется для репо и пары сделок.
kod_sell	char(7)	Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке по связке, поданной Продавцом, на основании которой заключена связанная сделка
kod_rts_s	char(7)	Код продавца
kod_buy	char(7)	Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке по связке, поданной Покупателем, на основании которой заключена связанная сделка
kod_rts_b	char(7)	Код покупателя
date	char(10)	Дата регистрации связанной сделки
time	char(8)	Время регистрации связанной сделки
type_buy	numeric(2)	Тип связки Покупателя: 2 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки, 3 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании безадресной Заявки 4 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие
type_sell	numeric(2)	Тип связки Продавца: 2 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки, 3 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании безадресной Заявки 4 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие
signs_buy	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Покупателя. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
signs_sell	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Продавца. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
var_marg_b	numeric(16,2)	Вариационная маржа Покупателя по связанной сделке (в рублях РФ)
var_marg_s	numeric(16,2)	Вариационная маржа Продавца по связанной сделке (в рублях РФ)

Название поля	Тип поля	Описание поля
user_sell	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Продавца по связанной сделке
user_buy	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Покупателя по связанной сделке
no_buy	numeric(19)	Идентификационный номер Заявки по связке, поданной Покупателем, на основании которой заключена связанная сделка
no_sell	numeric(19)	Идентификационный номер Заявки по связке, поданной Продавцом, на основании которой заключена связанная сделка
fee_buy	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ)
fee_sell	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ)
date2	char(10)	Дата регистрации связанной сделки
comm_buy	char(20)	Комментарий в Заявке по связке, поданной Покупателем
comm_sell	char(20)	Комментарий в Заявке по связке, поданной Продавцом
fee_ns_b	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за связанную сделку, заключенную на основании адресной Заявки по связке, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ)
fee_ns_s	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за связанную сделку, заключенную на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ)
price_rur1	numeric(16,5)	Цена первой части связанной сделки в рублях
price_rur	numeric(16,5)	Цена сделки в рублях
ext_id_b	numeric(11)	Дополнительный идентификационный номер, указанный в Заявке по связке, поданной Покупателем
ext_id_s	numeric(11)	Дополнительный идентификационный номер, указанный в Заявке по связке, поданной Продавцом
date_clr	date	Дата проведения клиринга
fee_ex_b	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Покупателем (в рублях РФ)
fee_cc_b	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Покупателем (в рублях РФ)
fee_ex_s	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Продавцом (в рублях РФ)
fee_cc_s	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Продавцом (в рублях РФ)
id_trade	numeric(19)	Идентификатор записи в таблице сделок, изменяющей позицию в дате поставки по первой части связки (первой сделки, зарегистрированной по результатам исполнения связки)
ncc_request_buy	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Покупатель): 0 – отсутствует, 1 – присутствует
ncc_request_sell	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Продавец): 0 – отсутствует, 1 – присутствует

Примечание:

1. Предоставляется по итогам основной клиринговой сессии.

3.13. Отчет o04clXXYYZZZ.csv

Информация об опционных сделках клиентов, где XXYYZZZ – код раздела. Файл формата csv.

Структура отчета *o04clXXYYZZZ.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
id_deal	numeric(19)	Идентификатор сделки в торговой системе
isin	char(25)	Уникальный код инструмента (опционного контракта)

Название поля	Тип поля	Описание поля
price	numeric(16,5)	Цена сделки (пункты)
vol	numeric(10)	Количество инструментов в сделке (шт.)
kod_sell	char(7)	Код продавца
kod_buy	char(7)	Код покупателя
date	char(10)	Дата регистрации сделки
time	char(8)	Время сделки
type_buy	numeric(2)	Тип сделки Покупателя: 0 – безадресная сделка, 1 – возникла в результате экспирации опционов, 2 – адресная сделка/ или перевод позиций между разделами с одинаковыми идентификационными данными с признаком битовой маски 0x8 в шлюзе и уникальным ненулевым id в поле signs_buy, 3 – для опционных контрактов, заключенных по закрывающим и балансирующим сделкам с Добросовестным участником клиринга, 4 – возникла в результате истечения опциона без экспирации, 5 – для опционных контрактов, заключенных на основании Индикативных заявок, 6 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга при проведении процедуры кросс-дефолта, 7 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование 8 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие
type_sell	numeric(2)	Тип сделки Покупателя: 0 – безадресная сделка, 1 – возникла в результате экспирации опционов, 2 – адресная сделка/ или перевод позиций между разделами с одинаковыми идентификационными данными с признаком битовой маски 0x8 в шлюзе и уникальным ненулевым id в поле signs_sell, 3 – для опционных контрактов, заключенных по закрывающим и балансирующим сделкам с Добросовестным участником клиринга, 4 – возникла в результате истечения опциона без экспирации, 5 – для опционных контрактов, заключенных на основании Индикативных заявок, 6 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга при проведении процедуры кросс-дефолта, 7 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование 8 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие
user_buy	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Покупателя
user_sell	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Продавца
no_buy	numeric(19)	Номер заявки покупателя в торговой системе
no_sell	numeric(19)	Номер заявки продавца в торговой системе
fee_buy	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресной сделки покупателем (руб.)

Название поля	Тип поля	Описание поля
fee_sell	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресной сделки продавцом (руб.)
date2	date	Дата регистрации сделки
comm_buy	char(20)	Комментарий покупателя
comm_sell	char(20)	Комментарий продавца
fee_ns_b	numeric(16, 2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение адресной сделки покупателем (руб.)
fee_ns_s	numeric(16, 2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение адресной сделки продавцом (руб.)
prem_buy	numeric(16, 2)	Премия покупателя (руб.)
prem_sell	numeric(16, 2)	Премия продавца (руб.)
price_rur	numeric(16, 5)	Цена сделки в руб.
ext_id_b	numeric(11)	Внешний номер покупателя.
ext_id_s	numeric(11)	Внешний номер продавца.
date_clr	date	Дата проведения клиринга.
var_marg_b	numeric(16,5)	Вариационная маржа покупателя (руб.)
var_marg_s	numeric(16,5)	Вариационная маржа продавца (руб.)
fee_ex_b	numeric(16,2)	Биржевой сбор за заключение адресной / безадресной сделки покупателем (руб.)
fee_cc_b	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за заключение адресной / безадресной сделки покупателем (руб.)
fee_ex_s	numeric(16,2)	Биржевой сбор за заключение адресной / безадресной сделки продавцом (руб.)
fee_cc_s	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за заключение адресной / безадресной сделки продавцом (руб.)
signs_buy	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Покупателя. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
signs_sell	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Продавца. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
counterparty	char(7)	Код контрагента по Сделке (Идентификатор Участника клиринга или код Брокерской фирмы, открытой в рамках Идентификатора Участника клиринга), заключенной на основании адресной Заявки. Для Сделок со значением '8' в полях type_buy/ type_sell указывается код 'CCNC' центрального контрагента (Клиринговый центр)
ncc_request_buy	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Покупатель): 0 – отсутствует, 1 – присутствует
ncc_request_sell	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Продавец): 0 – отсутствует, 1 – присутствует
prem_buy_currency	numeric(16,2)	Обязательства Покупателя по уплате Премий по опционным контрактам (в иностранной валюте, в которой ведутся торги базисным активом)
prem_sell_currency	numeric(16,2)	Требования Продавца по уплате Премий по опционным контрактам (в иностранной валюте, в которой ведутся торги базисным активом)

Примечание:

1. Файл формируется при установлении услуги формирования отчетов по разделу клиринговых регистров.

3.14. Отчет o04_XXYY.csv

Информация об опционных сделках Брокерской фирмы и ее клиентов, где XXYY – код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *o04_XXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
id_deal	numeric(19)	Идентификатор сделки в торговой системе
isin	char(25)	Уникальный код инструмента (опционного контракта)
price	numeric(16,5)	Цена сделки (пункты)
vol	numeric(10)	Количество инструментов в сделке (шт.)
kod_sell	char(7)	Код продавца
kod_buy	char(7)	Код покупателя
date	char(10)	Дата регистрации сделки
time	char(8)	Время сделки
type_buy	numeric(2)	Тип сделки Покупателя: 0 – безадресная сделка, 1 – возникла в результате экспирации опционов, 2 – адресная сделка/ или перевод позиций между разделами с одинаковыми идентификационными данными с признаком битовой маски 0x8 в шлюзе и уникальным ненулевым id в поле signs_buy, 3 – для опционных контрактов, заключенных по закрывающим и балансирующим сделкам с Добросовестным участником клиринга, 4 – возникла в результате истечения опциона без экспирации, 5 – для опционных контрактов, заключенных на основании Индикативных заявок, 6 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга при проведении процедуры кросс-дефолта, 7 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование 8 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие
type_sell	numeric(2)	Тип сделки Покупателя: 0 – безадресная сделка, 1 – возникла в результате экспирации опционов, 2 – адресная сделка/ или перевод позиций между разделами с одинаковыми идентификационными данными с признаком битовой маски 0x8 в шлюзе и уникальным ненулевым id в поле signs_sell, 3 – для опционных контрактов, заключенных по закрывающим и балансирующим сделкам с Добросовестным участником клиринга, 4 – возникла в результате истечения опциона без экспирации, 5 – для опционных контрактов, заключенных на основании Индикативных заявок, 6 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга при проведении процедуры кросс-дефолта, 7 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование 8 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие

Название поля	Тип поля	Описание поля
user_buy	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Покупателя
user_sell	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Продавца
no_buy	numeric(19)	Номер заявки покупателя в торговой системе
no_sell	numeric(19)	Номер заявки продавца в торговой системе
fee_buy	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресной сделки покупателем (руб.)
fee_sell	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресной сделки продавцом (руб.)
date2	date	Дата регистрации сделки
comm_buy	char(20)	Комментарий покупателя
comm_sell	char(20)	Комментарий продавца
fee_ns_b	numeric(16, 2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение адресной сделки покупателем (руб.)
fee_ns_s	numeric(16, 2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение адресной сделки продавцом (руб.)
prem_buy	numeric(16, 2)	Премия покупателя (руб.)
prem_sell	numeric(16, 2)	Премия продавца (руб.)
price_rur	numeric(16, 5)	Цена сделки в руб.
ext_id_b	numeric(11)	Внешний номер покупателя.
ext_id_s	numeric(11)	Внешний номер продавца.
date_clr	date	Дата проведения клиринга.
var_marg_b	numeric(16,5)	Вариационная маржа покупателя (руб.)
var_marg_s	numeric(16,5)	Вариационная маржа продавца (руб.)
fee_ex_b	numeric(16,2)	Биржевой сбор за заключение адресной / безадресной сделки покупателем (руб.)
fee_cc_b	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за заключение адресной / безадресной сделки покупателем (руб.)
fee_ex_s	numeric(16,2)	Биржевой сбор за заключение адресной / безадресной сделки продавцом (руб.)
fee_cc_s	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за заключение адресной / безадресной сделки продавцом (руб.)
signs_buy	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Покупателя. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
signs_sell	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Продавца. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
counterparty	char(7)	Код контрагента по Сделке (Идентификатор Участника клиринга или код Брокерской фирмы, открытой в рамках Идентификатора Участника клиринга), заключенной на основании адресной Заявки. Для Сделок со значением '8' в полях type_buy/ type_sell указывается код 'CCNC' центрального контрагента (Клиринговый центр)
ncc_request_buy	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Покупатель): 0 – отсутствует, 1 – присутствует
ncc_request_sell	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Продавец): 0 – отсутствует, 1 – присутствует

Название поля	Тип поля	Описание поля
prem_buy_currency	numeric(16,2)	Обязательства Покупателя по уплате Премий по опционным контрактам (в иностранной валюте, в которой ведутся торги базисным активом)
prem_sell_currency	numeric(16,2)	Требования Продавца по уплате Премий по опционным контрактам (в иностранной валюте, в которой ведутся торги базисным активом)

Примечание:

1. id_deal соответствует идентификатору сделки, выдаваемому шлюзовыми процедурами.
2. o04_XXYY.isin = o07.contract.
3. no_buy, no_sell – идентификаторы заявок, на основе которых заключена сделка. Данные идентификаторы соответствует идентификаторам заявок, выдаваемых шлюзовыми процедурами.
4. Поле date2 по смыслу аналогично полю date.
5. Поля var_marg_b и var_marg_s для немаржируемых опционов = 0

3.15. Отчет o07.csv

Результаты опционных торгов. Файл формата csv.

Структура отчета *o07.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения торгов
contract	char(25)	Уникальный код инструмента (опционного контракта)
execution	char(10)	Дата окончания обращения инструмента (дата окончания экспирации)
volume	numeric(10)	Оборот в контрактах
vol_rubl	numeric(16,2)	Оборот в рублях
low	numeric(16,5)	Минимальная цена сделки (пункты)
high	numeric(16,5)	Максимальная цена сделки (пункты)
open	numeric(16,5)	Цена открытия (пункты)
close	numeric(16,5)	Цена закрытия (пункты)
avrg	numeric(16,5)	Средневзвешенная цена (пункты)
trades	numeric(10)	Количество сделок
interest	numeric(10)	Количество позиций
fee	numeric(16,5)	Сумма Биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра (руб.)
tick_price	numeric(16,5)	Стоимость шага цены (руб.)
tick	numeric(16,5)	Минимальный шаг цены (пункты)
poses_rubl	numeric(17,2)	Объем позиций в рублях
depo_uncov	numeric(16,5)	Верхняя/нижняя граница ценового коридора по опционному контракту (по непокрытой позиции) (руб.)
depo_cov	numeric(16,5)	Верхняя/нижняя граница ценового коридора по опционному контракту и фьючерсному контракту, являющемуся базисным активом опционного контракта (по синтетической позиции) (руб.)
fut_contr	char(25)	Код (обозначение) базисного актива опционного контракта
strike	numeric(16,5)	Страйк опциона (пункты)
put	char(1)	Тип опциона PUT(‘P’) или CALL(‘C’)
evrop	char(1)	Тип опциона европейский(‘E’) или американский(‘A’)
date2	date	Дата проведения торгов
execution2	date	Дата окончания обращения инструмента (дата окончания экспирации)
name	char(25)	Краткий код опционного контракта
close_time	char(8)	Время последней сделки.
volat	numeric(16, 5)	Волатильность.
theorprice	numeric(16, 5)	Теоретическая цена (пункты).

Название поля	Тип поля	Описание поля
tick_pr_go	numeric(16, 5)	Стоимость шага цены в руб. для расчета ГО (руб.)
fut_type	char(1)	Признак маржируемости опциона: «0» – немаржируемый опцион; «1» – маржируемый опцион;
base_im_buy	numeric(16,2)	Базовое ГО под покупку маржируемых опционов
settlement_currency	char(3)	Код валюты, в которой осуществляются денежные расчеты
tick_price_currency	numeric(16,5)	Стоимость шага цены опционного контракта, установленная в Торговой системе (в валюте, в которой осуществляются денежные расчеты)
base_im_covered_sell_erc	numeric(16,2)	Базовое ГО под одну покрытую позицию подписчика для КОУР (руб)
base_im_covered_sell_hrc	numeric(16,2)	Базовое ГО под одну покрытую позицию подписчика для КПУР (руб)
base_im_covered_sell_lrc	numeric(16,2)	Базовое ГО под одну покрытую позицию подписчика для КНУР (руб)
base_im_covered_sell_mrc	numeric(16,2)	Базовое ГО под одну покрытую позицию подписчика для КСУР (руб)
base_im_sell_erc	numeric(16,2)	Базовое ГО под одну непокрытую позицию подписчика для КОУР (руб)
base_im_buy_erc	numeric(16,2)	Базовое ГО под покупку маржируемого опциона для КОУР (руб).
base_im_sell_hrc	numeric(16,2)	Базовое ГО под одну непокрытую позицию подписчика для КПУР (руб)
base_im_buy_hrc	numeric(16,2)	Базовое ГО под покупку маржируемого опциона для КПУР (руб).
base_im_sell_lrc	numeric(16,2)	Базовое ГО под одну непокрытую позицию подписчика для КНУР (руб)
base_im_buy_lrc	numeric(16,2)	Базовое ГО под покупку маржируемого опциона для КНУР (руб).
base_im_sell_mrc	numeric(16,2)	Базовое ГО под одну непокрытую позицию подписчика для КСУР (руб)
base_im_buy_mrc	numeric(16,2)	Базовое ГО под покупку маржируемого опциона для КСУР (руб).
base_im_covered_sell	numeric(16,2)	Базовое ГО под одну покрытую позицию подписчика (руб)
base_im_sell	numeric(16,2)	Базовое ГО под одну непокрытую позицию подписчика (руб)

Примечание:

1. Ключевые поля date(или date2), contract
2. Поле date2 по смыслу аналогично полю date.
3. Поле execution2 по смыслу аналогично полю execution. Оно отличается от поля execution2 только форматом.

3.16. Отчет oposclXXYYZZZ.csv

Информация о позиционном состоянии по опционным контрактам клиентов, где XXYYZZZ - код раздела. Файл формата csv.

Структура отчета *oposclXXYYZZZ.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
kod	char(7)	Код клиента
account	char(2)	Признак клиента ('CL' - клиент)
isin	char(25)	Опционный контракт
pos_beg	numeric(11)	Количество позиций на начало дня
pos_end	numeric(11)	Количество позиций на конец дня
prem	numeric(16,2)	Сумма начисленной премии по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)
sbor	numeric(16,2)	Сумма начисленного биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за безадресные сделки (руб.)
go	numeric(16,2)	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.)
pos_exec	numeric(11)	Количество экспериированных позиций (больше нуля – экспериируются позиции в продажу; меньше нуля – в покупку)
pos_endcir	numeric(11)	Количество позиций удаленных в результате истечения срока обращения опциона (больше нуля – истек срок обращения опциона в продажу; меньше нуля – в покупку)
du	numeric(1)	Счет ДУ (1 – ДУ, 0 – не ДУ)

Название поля	Тип поля	Описание поля
sbor_exec	numeric(16,2)	Начисленное комиссионное вознаграждение Клирингового центра за исполнение (руб.)
sbor_nosys	numeric(16,2)	Сумма начисленного биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за адресные сделки (руб.).
var_marg_p	numeric(16,2)	Начисленная вариационная маржа по открытым позициям на начало дня (руб.)
var_marg_d	numeric(16,2)	Начисленная вариационная маржа по сделкам (руб.)
sbor_ex	numeric(16,2)	Начисленный биржевой сбор за адресные и безадресные сделки (руб.)
sbor_cc	numeric(16,2)	Начисленное комиссионное вознаграждение Клирингового центра за адресные и безадресные сделки (руб.)
prem_currency	numeric(16,2)	Начисленная сумма премий по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в валюте, в которой осуществляются денежные расчеты)
nov	numeric(16,2)	Оценочная стоимость объёма позиций опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги (в рублях РФ)

Примечание:

1. Ключевые поля date, kod, account, isin.
2. Для маржируемых опционов поле prem=0.
3. Для немаржируемых опционов поля var_marg_p и var_marg_d=0.
4. Файл формируется при установлении услуги формирования отчетов по разделу клиринговых регистров.

3.17. Отчет oposXXYY.csv

Информация о позиционном состоянии Участника клиринга/ Брокерской фирмы и их клиентов по опционным контрактам. Файл формата csv.

Структура отчета *oposXXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
kod	char(7)	Код Брокерской фирмы / код раздела регистра учета позиций / Расчетный код
account	char(2)	Признак обязательств: 'BF' – суммарные обязательства, учитываемые на разделах регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы, указанный в поле «kod», 'CL' – обязательства, учитываемые на разделе регистра учета позиций, имеющем код, указанный в поле «kod», 'RK' – суммарные обязательства, учитываемые на Расчетном коде, указанный в поле «kod».
isin	char(25)	Опционный контракт
pos_beg	numeric(11)	Количество позиций на начало дня
pos_end	numeric(11)	Количество позиций на конец дня
prem	numeric(16,2)	Сумма начисленной премии по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в рублях РФ)
sbor	numeric(16,2)	Сумма начисленного биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за безадресные сделки (руб.)
go	numeric(16,2)	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.)
pos_exec	numeric(11)	Количество эксперированных позиций (больше нуля – эксперируются позиции в продажу; меньше нуля – в покупку)
pos_endcir	numeric(11)	Количество позиций удаленных в результате истечения срока обращения опциона (больше нуля – истек срок обращения опциона в продажу; меньше нуля – в покупку)
du	numeric(1)	Счет ДУ (1 – ДУ, 0 – не ДУ)
sbor_exec	numeric(16,2)	Начисленное комиссионное вознаграждение Клирингового центра за исполнение (руб.).

Название поля	Тип поля	Описание поля
sbor_nosys	numeric(16,2)	Сумма начисленного биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за адресные сделки (руб.).
var_marg_p	numeric(16,2)	Начисленная вариационная маржа по открытым позициям на начало дня (руб.)
var_marg_d	numeric(16,2)	Начисленная вариационная маржа по сделкам (руб.)
sbor_ex	numeric(16,2)	Начисленный биржевой сбор за адресные и безадресные сделки (руб.)
sbor_cc	numeric(16,2)	Начисленное комиссионное вознаграждение Клирингового центра за адресные и безадресные сделки (руб.)
prem_currency	numeric(16,2)	Начисленная сумма премий по опционным контрактам, заключенным в течение отчетного дня (в валюте, в которой осуществляются денежные расчеты)
nov	numeric(16,2)	Оценочная стоимость объема позиций опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги (в рублях РФ)

Примечание:

1. Ключевые поля date, kod, account, isin.
2. Для маржируемых опционов поле prem=0.
3. Для немаржируемых опционов поля var_marg_p и var_marg_d=0.

3.18. Отчет paycbXXYY.csv/paycbXX00.csv

Информация об операциях с иностранной валютой, а также с Профилем актива, предоставленных в качестве Обеспечения по Участнику клиринга, где XX – код Идентификатора Участника клиринга/ XXYY – Код Брокерской фирмы, открытой для Участника торгов. Файл формата csv.

Структура отчета *paycbXXYY.csv/paycbXX00.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
kod	char(7)	Код раздела денежного регистра
account	char(2)	Признак раздела: Всегда 'CL'.
type	char(2)	Тип Обеспечения, выраженные в рублях РФ: ‘MN’ – денежные средства в иностранной валюте и / или в Профиле актива, ‘PL’ – Не используется
id_pay	numeric(10)	Идентификатор операции
type_pay	numeric(10)	Вид операции
asset	char(60)	Код иностранной валюты / Профиля актива
pay	numeric(16,5)	Количество внесенного/ выведенного обеспечения в иностранной валюте/ Профилях актива (в штуках)
rub_equ	numeric(16,2)	Оценочная стоимость иностранной валюты/ Профиля актива (в рублях РФ)
purpose	char(255)	Назначение платежа. Поле «purpose» заполняется в случае внесения Обеспечения в иностранной валюте, а также Профиля актива

Примечание:

1. Профиль актива – это Профиль актива по иностранной валюте / ценной бумаге/ драгоценному металлу.
2. В случае внесения Обеспечения поле «pay» принимает положительное значение, в случае вывода Обеспечения – отрицательное.
3. В файле paycbXX00.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.
4. Отчет предоставляется по итогам основной клиринговой сессии.

3.19. Отчет paycIXXYYZZZ.csv

Информация об операциях по разделу денежного регистра клиента, где XXYYZZZ означает код раздела. Файл формата csv.

Структура отчета *payclXXYYZZZ.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
kod	char(7)	Код раздела денежного регистра
account	char(2)	Признак всегда равен 'CL'.
type	char(2)	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
id_pay	numeric(10)	Идентификатор операции
type_pay	numeric(10)	Вид операции
pay	numeric(16,2)	Сумма платежа (руб.)
name	char(255)	Наименование операции (платежа)
comment	char(50)	Номер платежного поручения в случае поступления/ списания средств
du	numeric(1)	Счет ДУ (1 – ДУ, 0 – не ДУ)
purpose	char(255)	Назначение платежа

Примечание:

1. Файл формируется при установлении услуги формирования отчетов по разделу клиринговых регистров.

3.20. Отчет payXXYY.csv

Информация об операциях по разделам денежного регистра Участника клиринга, Брокерской фирмы, где XX – Идентификатор Участника клиринга, XXYY– код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *payXXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
kod	char(7)	Код раздела денежного регистра
account	char(2)	Признак раздела: Всегда 'CL'
type	char(2)	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
id_pay	numeric(10)	Идентификатор операции
type_pay	numeric(10)	Тип операции
pay	numeric(16,2)	Сумма платежа (руб.)
name	char(255)	Наименование операции (платежа)
comment	char(50)	Номер платежного поручения в случае поступления/ списания средств
du	numeric(1)	Признак того, что раздел денежного регистра предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении
purpose	char(255)	Назначение платежа

Примечание:

1. Ключевое поле id_pay.

2. Поле type_pay однозначно идентифицирует поле name. Смысл идентификатора основания платежа описывается полем name.

3. Поле pay может быть положительным и отрицательным. Если pay меньше нуля, то средства списываются, если больше нуля, то зачисляются.

4. 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.

5. В файле payXX00.csv, формируемого для Участника клиринга, в случае если клиринговые услуги по ведению клиринговых регистров Клиринговый центр оказывает Участнику торгов, не совпадающего в одном лице с Участником клиринга, в поле account по признаку 'CL' не предоставляется информация по коду раздела денежного регистра, открытого в рамках Брокерской фирмы для Участника торгов.

3.21. Отчет persinvestXXYY.csv/persinvestXX00.csv

Отчет о разделах клиринговых регистров, имеющих признак «Индивидуальный Инвестиционный Счет», где XX – Идентификатор Участника клиринга/XXYY – Код Брокерской фирмы, открытой для Участника торгов. Файл формата csv.

Структура отчета *persinvestXXYY.csv/persinvestXX00.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
kod	char(7)	Код раздела клиринговых регистров
account	char(2)	Признак раздела: Всегда 'CL'

Примечание:

1. Отчет предоставляется по итогам основной клиринговой сессии.

2. В файле persinvestXX00.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 регистра учета позиций, открытого в рамках Брокерской фирмы для Участника торгов.

3.22. Отчет riskparamsXX00.csv

Информация об установлении параметров ограничения на открытие позиций/ограничения на объявления заявок по Брокерским фирмам, где XX00 – код Участника клиринга. Файл формата csv.

Структура отчета *riskparamsXX00.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней/промежуточной клиринговой сессии)
kod	char(7)	Код Брокерской фирмы
prohibit_coeff	numeric(16,2)	Коэффициент, установленный Клиринговым центром на основании Поручения на установление ограничения на открытие позиций / ограничения на объявление заявок, полученного от Участника клиринга, для раздела регистра учета позиций, открытого в рамках Брокерской фирмы
state	int	Статус ограничения на открытие позиций в отношении каждого раздела регистра учета позиций или ограничение на объявление заявок в отношении каждого раздела регистра учета позиций: 0 – выключен, 1 – включен
type	int	Тип ограничений на открытие позиций в отношении каждого раздела регистра учета позиций или ограничение на объявление заявок в отношении каждого раздела регистра учета позиций: 0 – на открытие позиций,

Название поля	Тип поля	Описание поля
		1 – на объявление заявок
del_ord	int	Статус удаления Активных заявок в отношении каждого раздела регистра учета позиций: 0 – не удалять, 1 – удалять
prohibit_coeff_bf	numeric(16,2)	Коэффициент, установленный Клиринговым центром на основании Поручения на установление ограничения на открытие позиций / ограничения на объявление заявок, полученного от Участника клиринга, для Брокерской фирмы.
state_bf	int	Статус ограничения на открытие позиций в отношении всех разделов регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы, или ограничение на объявление заявок в отношении всех разделов регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы: 0 – выключен, 1 – включен
type_bf	int	Тип ограничений на открытие позиций в отношении всех разделов регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы, или ограничение на объявление заявок в отношении всех разделов регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы: 0 – на открытие позиций, 1 – на объявление заявок
del_ord_bf	int	Статус удаления Активных заявок в отношении всех разделов регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы: 0 – не удалять, 1 – удалять

Примечание:

1. Файл dayriskparamsXX00.csv предоставляется по итогам промежуточной клиринговой сессии.
2. Формирование файлов консолидировано по всему Участнику клиринга, включая все Брокерские фирмы.

3.23. Отчет riskposXXYY.csv

Информация о позиционном состоянии Участника клиринга/ Брокерской фирмы и их клиентов по фьючерсам/ опционам/ коллатеральным инструментам, где XXYY – код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *riskposXXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
kod	char(7)	Код Брокерской фирмы / код раздела регистра учета позиций / Расчетный код
account	char(2)	Признак обязательств: 'BF' – суммарные обязательства, учитываемые на разделах регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы, указанный в поле «kod»,

Название поля	Тип поля	Описание поля
		'CL' – обязательства, учитываемые на разделе регистра учета позиций, имеющем код, указанный в поле «kod», 'RK' – суммарные обязательства, учитываемые на Расчетном коде, указанный в поле «kod»
isin	char(25)	Уникальный код инструмента
type	char(1)	Тип инструмента: 'F' – фьючерсный контракт, 'O' – опционный контракт, 'K' – позиция по фьючерсному контракту с текущей датой исполнения, базовым активом которого является данная иностранная валюта / ценная бумага/ драгоценный металл, в количестве и по направлению, соответствующему переданному / полученному Профилю актива по иностранной валюте / ценной бумаге/ драгоценному металлу (коллатеральный инструмент)
pos_beg	numeric(11)	Количество позиций на начало дня
pos_end	numeric(11)	Количество позиций на конец дня
go_brutto	numeric(16,2)	Брутто-ГО (руб.)
sbor	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за адресные и безадресные сделки (руб.) за исключением коллатерального инструмента

Примечание:

1. Отчет предоставляется по итогам основной клиринговой сессии.

3.24. Отчет toeqXXYY.csv

Информация о соответствии Брокерской фирмы /клирингового раздела учета позиций на Срочном рынке Торгово-клиринговому счету Участника клиринга на Фондовом рынке/Валютном рынке и рынке драгоценных металлов, где XXYY – код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *toeqXXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
kod	char(7)	Код раздела клиринговых регистров по Идентификатору Участника клиринга / Брокерской фирмы/клиента
account	char(2)	Признак по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента ('RF' – Идентификатор Участника клиринга; 'BF' – Брокерская фирма; 'CL' - клиент) на срочном рынке
kod_tks_fr	char(12)	Код Торгово-клирингового счета на Фондовом рынке
kod_client_fr	char(12)	Краткий код клиента участника торгов на Фондовом рынке
fav_tks_own_fr	char(12)	Торгово-клиринговый счет, соответствующий Собственным Брокерским фирмам, на Фондовом рынке
fav_tks_client_fr	char(12)	Торгово-клиринговый счет, соответствующий Клиентским Брокерским фирмам, на Фондовом рынке
fav_tks_du_fr	char(12)	Торгово-клиринговый счет, соответствующий Брокерским фирмам ДУ, на Фондовом рынке
broker_ref_fr	char(20)	Примечание к сделке поставки на Фондовом рынке
kod_tks_vr	char(12)	Код Торгово-клирингового счета на Валютном рынке и рынке драгоценных металлов
kod_client_vr	char(12)	Краткий код клиента участника торгов на Валютном рынке и рынке драгоценных металлов
fav_tks_own_vr	char(12)	Торгово-клиринговый счет, соответствующий Собственным Брокерским фирмам, на Валютном рынке и рынке драгоценных металлов
fav_tks_client_vr	char(12)	Торгово-клиринговый счет, соответствующий Клиентским Брокерским фирмам, на Валютном рынке и рынке драгоценных металлов
fav_tks_du_vr	char(12)	Торгово-клиринговый счет, соответствующий Брокерским фирмам ДУ, на Валютном рынке и рынке драгоценных металлов

Название поля	Тип поля	Описание поля
broker_ref_vr	char(20)	Примечание к сделке поставки на Валютном рынке и рынке драгоценных металлов

Примечание:

1. Поля fav_tks_own_fr, fav_tks_client_fr, fav_tks_du_fr, fav_tks_own_vr, fav _tks_client_vr, fav _tks_du_vr заполняются только для account='RF'.

2. Отчет предоставляется по итогам основной клиринговой сессии.

3.25. Отчет volat.csv

Информация о расчете кривой волатильности по итогам торгов опционными контрактами. Файл формата csv.

Структура отчета *volat.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения торгов
contract	char(25)	Код базового актива одной опционной серии
execution	char(10)	Дата окончания обращения одной опционной серии (дата исполнения)
A	numeric(19,14)	Коэффициенты подстройки кривой волатильности для одной опционной серии
B	numeric(19,14)	
C	numeric(19,14)	
D	numeric(19,14)	
E	numeric(19,14)	
S	numeric(19,14)	
fut_type	int	Признак: 1. – одна опционная серия

Примечание:

1. Предоставляется по итогам основной клиринговой сессии.

3.26. Отчет chargesclXXYYZZZ.csv

Отчет о начисленных комиссиях, штрафах и иных обязательствах по клиентам. Файл формата csv.

Структура отчета *chargesclXXYYZZZ.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата и время клиринговой сессии
settle_date	char(10)	Плановая дата и время расчетов по обязательствам
kod	char(7)	Код клиента/расчетный код
account	char(2)	Признак раздела: Всегда 'CL'
id_pay	numeric(10)	Идентификатор операции
type_pay	numeric(10)	Тип операции
amount_charges_mtm	numeric(16,2)	Сумма комиссии, штрафа или обязательства / требования. Например, платежа по выходу из Вечного фьючерса
name	char(255)	Наименование операции (платежа)
comment	char(50)	Комментарий
du	numeric(1)	Признак того, что раздел денежного регистра предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении

Примечание:

1. Файл формируется при установлении услуги формирования отчетов по разделу клиринговых регистров.

3.27. Отчет chargesXXYY.csv

Отчет о начисленных комиссиях, штрафах и иных обязательствах по РФ/БФ. Файл формата csv.

Структура отчета *chargesXXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата и время клиринговой сессии
settle_date	char(10)	Плановая дата и время расчетов по обязательствам
kod	char(7)	Код клиента/расчетный код
account	char(2)	Признак раздела: Всегда 'CL'
id_pay	numeric(10)	Идентификатор операции
type_pay	numeric(10)	Тип операции
amount_charges_mtm	numeric(16,2)	Сумма комиссии,штрафа или обязательства / требования. Например, платежа по выходу из Вечного фьючерса
name	char(255)	Наименование операции (платежа)
comment	char(50)	Комментарий
du	numeric(1)	Признак того, что раздел денежного регистра предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, или нет: 1 – раздел предназначен для учета средств, находящихся в доверительном управлении, 0 – раздел предназначен для учета средств, не находящихся в доверительном управлении

Примечание:

1. Ключевое поле id_pay.
2. Поле type_pay однозначно идентифицирует поле name. Смысл идентификатора основания платежа описывается полем name.
3. В файле chargesXX00.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.

4. Пакет TR_UPDYYYYMMDD.zip

Отчеты по транзакциям. Отчеты после Клиринговой сессии.

4.1. Отчет tranerrfeeXXYY.csv

Информация о сборах за ошибочные транзакции, отличных от ошибок Flood Control, по каждому клиентскому логину (идентификатору) Участника клиринга/ Брокерской фирмы и их клиентов. Файл формата csv.

Структура отчета *tranerrfeeXXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
moment	datetime	Время совершения ошибочной транзакции, отличной от ошибок Flood Control (гггг-мм-дд чч:мм:сс)
kod	char(7)	Код раздела клиринговых регистров по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента
account	char(2)	Признак по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента ('RF' – Идентификатор Участника клиринга; 'BF' – Брокерская фирма; 'CL' - клиент)
login	char(50)	Наименование логина (идентификатора)
err_count	numeric(10)	Количество ошибочных транзакций, отличных от ошибок Flood Control
points	numeric(10)	Сумма баллов по ошибочным транзакциям, отличных от ошибок Flood Control
sbor_err	numeric(16,2)	Сбор за количество ошибочных транзакций, отличных от ошибок Flood Control, совершенное на момент времени «moment»

Примечание:

1. Включены комбинации (login, moment), по которым достигнут лимит.
2. Информация по «points» в Параметрах для расчёта сборов за неэффективные и ошибочные транзакции [http://fs.moex.com/files/5329].
3. Отчет предоставляется по итогам основной клиринговой сессии.

4.2. Отчет tranerrXXYY.csv

Информация о количестве ошибочных транзакций, отличных от ошибок Flood Control, по каждому клиентскому логину (идентификатору) Участника клиринга/ Брокерской фирмы и их клиентов. Файл формата csv.

Структура отчета *tranerrXXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
moment	datetime	Время совершения ошибочной транзакции, отличной от ошибок Flood Control (гггг-мм-дд чч:мм:сс)
kod	char(7)	Код раздела клиринговых регистров по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента
account	char(2)	Признак по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента ('RF' – Идентификатор Участника клиринга; 'BF' – Брокерская фирма; 'CL' - клиент)
login	char(50)	Наименование логина (идентификатора)
tran_type	char(20)	Тип транзакции
err_code	numeric(10)	Код ошибки
err_cnt	numeric(10)	Количество транзакций данного типа с данной ошибкой

Примечание:

1. Включены комбинации (login, moment), по которым достигнут лимит.

2. Информация по «tran_type» и «err_code» в Параметрах для расчёта сборов за неэффективные и ошибочные транзакции [http://fs.moex.com/files/5329].

3. В отчете отражаются только те транзакции типа DelUserOrders с «err_code» = 0 при условии, что не удалено ни одной заявки.

4. Отчет предоставляется по итогам основной клиринговой сессии.

4.3. Отчет tranfcfeeXXYY.csv

Информация о количестве и сборах за ошибочные транзакции Flood Control по каждому клиентскому логину (идентификатору) Участника клиринга/ Брокерской фирмы и их клиентов на время совершения транзакции. Файл формата csv.

Структура отчета *tranfcfeeXXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
moment	datetime	Время совершения ошибочной транзакции Flood Control (гг-гг-мм-дд чч:мм:сс)
kod	char(7)	Код раздела клиринговых регистров по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента
account	char(2)	Признак по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента ('RF' – Идентификатор Участника клиринга; 'BF' – Брокерская фирма; 'CL' - клиент)
login	char(50)	Наименование логина (идентификатора)
fc_count	numeric(10)	Количество ошибочных транзакций Flood Control
sbor_fc	numeric(16,2)	Сбор за количество ошибочных транзакций Flood Control, совершенное на момент времени «moment»

Примечание:

1. Отчет предоставляется по итогам основной клиринговой сессии.

4.4. Отчет tranfeeXXYY.csv

Информация о сборах за транзакции по Участнику клиринга/ Брокерской фирмы и их клиентов. Файл формата csv.

Структура отчета *tranfeeXXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
kod	char(7)	Код раздела клиринговых регистров по Идентификатору Участника клиринга / Брокерской фирмы / клиента
account	char(2)	Признак обязательств: 'RF' – суммарные обязательства по Идентификатору Участника клиринга; 'BF' – суммарные обязательства по Брокерской фирме; 'CL' – обязательства, учитываемые на разделе регистра учета позиций клиента
sbortr	numeric(16,2)	Сумма сбора технического центра за транзакции типа trantype, которая будет списана в следующий торговый день с раздела клиринговых регистров по признаку 'CL' (руб.)
trantype	numeric(1)	Тип транзакции («1» - сбор за ошибочные транзакции, отличные от ошибок Flood Control, «2» - сбор за ошибочные транзакции Flood Control)

Примечание:

1. Ключевые поля «date», «kod», «account», «sbortr», «trantype».

2. Если за ошибочные транзакции сбор меньше 1000,00 руб., то в «sbortr» такое значение не отражается.

4.5. Отчет usersfcXXYY.csv

Информация о сборах за ошибочные транзакции Flood Control по каждому клиентскому логину (идентификатору) Участника клиринга/ Брокерской фирмы и их клиентов. Файл формата csv.

Структура отчета *usersfcXXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
kod	char(7)	Код раздела клиринговых регистров по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента
account	char(2)	Признак по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента ('RF' – Идентификатор Участника клиринга; 'BF' – Брокерская фирма; 'CL' - клиент)
login	char(50)	Наименование логина (идентификатора)
maxmsg	numeric(10)	Пропускная способность логина (идентификатора) на конец торговой сессии
sbor_err	numeric(16,2)	Сбор за ошибочные транзакции Flood Control (руб.)

Примечание:

1. Если за ошибочные транзакции Flood Control сбор меньше 1000,00 руб., то в «sbor_err» такое значение не отражается.
2. Отчет предоставляется по итогам основной клиринговой сессии.

4.6. Отчет usersXXYY.csv

Информация о сборах за ошибочные транзакции, отличных от ошибок Flood Control, по каждому клиентскому логину (идентификатору) Участника клиринга/ Брокерской фирмы и их клиентов. Файл формата csv.

Структура отчета *usersXXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
kod	char(7)	Код раздела клиринговых регистров по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента
account	char(2)	Признак по Идентификатору Участника клиринга /Брокерской фирмы/клиента ('RF' – Идентификатор Участника клиринга; 'BF' – Брокерская фирма; 'CL' - клиент)
login	char(50)	Наименование логина (идентификатора)
maxmsg	numeric(10)	Пропускная способность логина на конец торговой сессии
sbor_err	numeric(16,2)	Сбор за ошибочные транзакции, отличных от ошибок Flood Control (руб.)

Примечание:

1. Если за ошибочные транзакции сбор меньше 1000,00 руб., то в «sbor_err» такое значение не отражается.
2. Отчет предоставляется по итогам основной клиринговой сессии.

5. Пакет EXCHANGEYYYYMMDD.zip

Отчеты с биржевой информацией после Клиринговой сессии.

5.1. Отчет multilegordlog_XXYY.csv

Лог действий по сведению и удалению заявок по связкам Участником клиринга (Участником торгов)/ Брокерской фирмой и их клиентами. Файл формата csv.

Структура отчета *multilegordlog_XXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
numb_order	numeric(19)	Идентификационный номер Заявки по связке
isin	char(25)	Уникальный код инструмента связки
price	numeric(16,5)	Цена первой части Заявки по репо и пары сделок (в пунктах)
vol	numeric(10)	Количество контрактов в Заявке по связке (в штуках)
days	numeric(4)	Срок связанной сделки (в календарных днях). Используется для репо и пары сделок.
rest_vol	numeric(10)	Количество контрактов в Заявке по связке, оставшееся в очереди после регистрации связанной сделки при частичном исполнении Заявки по связке
kod	char(7)	Код раздела клиринговых регистров по Идентификатору Участника клиринга / Брокерской фирмы / клиента
tip	numeric(1)	Тип Заявки: 1 – покупка, 2 – продажа
sost	numeric(1)	Действие с Заявкой по связке: 1 – объявление Заявки по связке, 2 – заключение связанной сделки на основании объявленной Заявки по связке, 0 – удаление Заявки по связке
(date)	char(10)	Дата действия с Заявкой по связке
(time)	char(8)	Время действия с Заявкой по связке
(user)	char(20)	Логин Участника торгов, выполнившего действие с Заявкой по связке
comment	char(20)	Комментарий в Заявке по связке
gate	numeric(1)	Признак использования Шлюза: 1 – действие с Заявкой по связке выполнено с использованием Шлюза, 0 – действие с Заявкой по связке выполнено без использования Шлюза
user_to	char(20)	Имя (наименование) Участника торгов, которому была адресована Заявка по связке (заполняется только для адресных заявок). При выставлении адресной заявки без указания контрагента указывается код 'CCNC' центрального контрагента (Клиринговый центр)
type	numeric(1)	Признак: 2 – адресная заявка на пару связанных сделок 3 – безадресная заявка на пару связанных сделок
date2	date	Дата действия с заявкой по связке
price_rur	numeric(16,5)	Цена первой части Заявки по репо и пары сделок (в рублях РФ).
ext_id	numeric(11)	Дополнительный идентификационный номер, указанный в Заявке по связке
date_exp	date	Дата окончания срока действия Заявки по связке
n_order1	numeric(19)	Идентификационный номер Заявки по связке при ее объявлении, до момента переноса Заявки по связке в следующие Торговые сессии
aspref	numeric(4)	Ссылка из таблицы user на мастер-логин Участника торгов
asp	char(20)	Логин Участника торгов из таблицы user (мастер-логин Участника)

Название поля	Тип поля	Описание поля
ncc_request	numeric(1)	Признак выставления Заявки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга: 0 – отсутствует, 1 – присутствует
match_ref	char(10)	Уникальное кодовое слово, выражающее взаимное согласие, для выставления двух встречных адресных заявок без указания контрагента
compliance_id	char(1)	Тип ввода заявки: • ' ' (пробел) или '' (пустая строка) – не заполнено/ не задано, • 'M' - Ручной ввод, • 'S' - В результате срабатывания условного поручения (стоп-лосс), • 'R' - В результате работы алгоритма-робота, • 'A' - В результате алгоритма автоследования, • 'D' - Закрытие позиции в результате не исполненного Маржинального требования.

Примечание:

1. Предоставляется по итогам основной клиринговой сессии в пакете отчетов EXCHANGEYYYYMMDD.zip., который подписывается сертификатом представителя ПАО Московская Биржа.
2. В поле match_ref могут использоваться буквы (кириллица и/или латиница), цифры, специальные символы.

5.2. Отчет onlineregXXYY.csv

Информация о зарегистрированных кодах разделов клиринговых регистров через сервис «Онлайн-регистрация» клиентов по Брокерской фирме Участника клиринга/ Участника торгов, где XXYY – код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *onlineregXXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата отчетного дня (дата проведения вечерней клиринговой сессии)
kod	char(7)	Код раздела клиринговых регистров

Примечание:

1. Предоставляется по итогам основной клиринговой сессии в пакете отчетов EXCHANGEYYYYMMDD.zip., который подписывается сертификатом представителя ПАО Московская Биржа.

6. Пакет FUTOPTMMYYYYMMDD.zip

Отчеты для Маркет-мейкеров.

6.1. Отчет mmfut_XXYY.csv

Информация об исполнении маркет-мейкерских обязательств по фьючерсам Брокерской фирмы, где XXYY – код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *mmfut_XXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
session_date	datetime	Дата торгового дня
agreement_number	varchar(50)	Номер маркет-мейкерского договора
group_code	varchar(7)	Код группировки для агрегирования показателей исполнения мм-обязательств
code	varchar(25)	Код раздела регистра учета позиций
symbol	varchar(25)	Код базового актива фьючерсного контракта
instrument	varchar(25)	Полный код фьючерсного контракта
spread	numeric(16,5)	Спрэд двусторонних котировок, соответствующий мм-обязательствам
average_spread	numeric(16,5)	Фактический средний спрэд двусторонних котировок
min_size	int	Минимальный объем заявок, соответствующий мм-обязательствам
spread_maintenance_%	numeric(16,2)	Фактическая продолжительность поддержания двусторонних котировок, %
spread_maintenance_seconds	int	Фактическая продолжительность поддержания двусторонних котировок, в секундах
quant_start	varchar(20)	Время начала кванта
quant_end	varchar(20)	Время окончания кванта
quant_seconds	int	Продолжительность кванта, в секундах
time_first_spread	varchar(25)	Время выставления первого спрэда
trade_number	int	Количество сделок
contract_number	int	Количество контрактов
position_number	int	Количество позиций
min_maintenance_%	int	Минимальная продолжительность поддержания двусторонних котировок, соответствующая мм-обязательствам (для фьючерсов по умолчанию=0),%
partial_maintenance _%	int	Частичная продолжительность поддержания двусторонних котировок, соответствующая мм-обязательствам,%
full_maintenance_%	int	Максимальная продолжительность поддержания двусторонних котировок, соответствующая мм-обязательствам,%
is_group	int	Индикатор для агрегирования показателей исполнения мм-обязательств по коду группы: ‘1’ – агрегирование показателей исполнения мм-обязательств по коду группы, ‘0’ – исполнение мм-обязательств по коду раздела регистра учета позиций
is_volat	int	Индикатор действия режима повышенной волатильности для условий программы: ‘1’ – применяются упрощенные условия для данного торгового дня и инструмента (в случае высокой волатильности и наличия режима повышенной волатильности для программы), ‘0’ – применяются стандартные условия для данного торгового дня и инструмента (в случае невысокой волатильности и/или отсутствия режима повышенной волатильности для программы)
actual_mm_orders_percent	numeric(5,2)	Доля пассивного объема мм-заявок (регуляторное требование), %

Примечание:

1. Отчет предоставляется по итогам основной клиринговой сессии.

6.2. Отчет mmLP_XXYY.csv

Информация об исполнении маркет-мейкерких обязательств по объему торгов Срочными контрактами, где XXYY – код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *mmLP_XXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
session_date	datetime	Дата торгового дня
agreement_number	varchar(50)	Номер маркет-мейкерского договора
group_code	varchar(7)	Код группировки для агрегирования показателей исполнения мм-обязательств
type	char(1)	Тип инструмента (‘C’ – календарный спред на фьючерсный контракт, ’F’ – фьючерсный контракт, ’O’ – опционный контракт)
underlying	varchar(25)	Код базисного актива фьючерсного/ опционного контракта: • Базисный актив, которого является ценная бумага – торговый код ценной бумаги на Фондовом рынке. Например, SBER. • Базисный актив, которого является фьючерсный контракт – код базового актива фьючерсного контракта. Например, SBRF.
instrument	varchar(25)	Код базисного актива фьючерсного/ опционного контракта: • Базисный актив, которого является ценная бумага – торговый код ценной бумаги на Фондовом рынке. Например, SBER. • Базисный актив, которого является фьючерсный контракт – код базового актива фьючерсного контракта. Например, SBRF.
min_order_size	numeric(16,2)	Не используется
volume_contracts	int	Объем сделок в Срочных контрактах, совершенных маркет-мейкером за торговый день
volume_fee	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора, взимаемая с маркет-мейкера за торговый день
volume_contracts_level_1	numeric(16,2)	Пороговое значение №1 по объему сделок в Срочных контрактах, совершенных маркет-мейкером за календарный месяц
volume_contracts_level_2	numeric(16,2)	Пороговое значение №2 по объему сделок в Срочных контрактах, совершенных маркет-мейкером за календарный месяц
volume_fee_level_1	numeric(16,2)	Пороговое значение №1 по сумме биржевого сбора, взимаемого с маркет-мейкера за календарный месяц
volume_fee_level_2	numeric(16,2)	Пороговое значение №2 по сумме биржевого сбора, взимаемого с маркет-мейкера за календарный месяц
underlying_type	char(1)	Код фьючерсного/опционного контракта: N/A - применимо для фьючерсного контракта, F – применимо для опционного контракта, базисный актив которого является фьючерсный контракт, E - применимо для опционного контракта, базисный актив которого является ценная бумага.
margin_style	char(1)	Тип маржирования опциона: M – маржируемый, P – премиальный.

Примечание:

1. Отчет предоставляется с информацией за месяц в последний отчетный рабочий день по итогам основной клиринговой сессии.

6.3. Отчет mm_onesidespredXXYY.csv

Информация о лимитах и нетто-оборотах при исполнении маркет-мейкерких обязательств по объему торгов Срочными контрактами, где XXYY – код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *mm_onesidespredXXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
session_date	datetime	Дата торгового дня
agreement_number	varchar(50)	Номер маркет-мейкерского договора
instrument_small_name	varchar(25)	Код фьючерсного/ опционного контракта
sell_for_oneside_spread	bigint	Лимит на продажу по нетто-обороту
buy_for_oneside_spread	bigint	Лимит на покупку по нетто-обороту
amount	bigint	Текущий нетто-оборот
obligation_type	varchar(30)	Тип назначенных обязательств: • двухсторонний спред, • односторонний спред на покупку, • односторонний спред на продаж

Примечание:

1. Отчет предоставляется по итогам основной клиринговой сессии по каждому маркет-мейкерскому договору в соответствии с установленными шаблонами, в которых есть признак, что на наконец месяца установлены лимиты на объём позиций.

6.4. Отчет mmopt_averageXXYY.csv

Информация об исполнении маркет-мейкерских обязательств по опционам (средний арифметический % исполнения по страйкам) Брокерской фирмы, где XXYY – код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *mmopt_averageXXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
session_date	datetime	Дата торгового дня
agreement_number	varchar(50)	Номер маркет-мейкерского договора
code	varchar(7)	Код раздела регистра учета позиций
underlying	varchar(25)	Код базисного актива опционного контракта: • Базисный актив, которого является ценная бумага – торговый код ценной бумаги на Фондовом рынке. Например, SBER. • Базисный актив, которого является фьючерсный контракт – код базового актива фьючерсного контракта. Например, SBRF.
futures	varchar(25)	Код опционного контракта: • Базисный актив, которого является ценная бумага – N/A. • Базисный актив, которого является фьючерсный контракт – код фьючерсного контракта. Например, SBRF-6.22.
expiration_date	datetime	Дата экспирации опционного контракта
average_maintenance_by_strike_%	numeric (6,2)	Средний арифметический процент поддержания двусторонних котировок по всем страйкам в мм-обязательстве, % (с учетом проверки на минимальный страйк)
lowest_maintenance_strike_%	numeric (6,2)	Минимальный процент поддержания двусторонней котировки по страйку из всего количества страйков в мм-обязательстве
quant_start	varchar(20)	Время начала кванта

Название поля	Тип поля	Описание поля
quant_end	varchar(20)	Время окончания кванта
min_maintenance_%	int	Минимальная продолжительность поддержания двусторонних котировок, соответствующая мм-обязательствам (по страйку), %
partial_maintenance _%	int	Частичная продолжительность поддержания двусторонних котировок, соответствующая мм-обязательствам,%
full_maintenance_%	int	Максимальная продолжительность поддержания двусторонних котировок, соответствующая мм-обязательствам,%
order_book	varchar(4)	Обязательства маркет-мейкера в основном стакане - ‘MAIN’
is_group	int	Индикатор для агрегирования показателей исполнения мм-обязательств по коду группы: ‘1’ – агрегирование показателей исполнения мм-обязательств по коду группы, ‘0’ – исполнение мм-обязательств по коду раздела регистра учета позиций
underlying_type	char(1)	Код опционного контракта: F - базисный актив, которого является фьючерсный контракт, E - базисный актив, которого является ценная бумага
actual_mm_orders_percent	numeric(5,2)	Доля пассивного объема мм-заявок (регуляторное требование), %
margin_style	char(1)	Тип маржирования опциона: M – маржируемый, P – премиальный.

Примечание:

1. Отчет предоставляется по итогам основной клиринговой сессии.

6.5. Отчет mmopt_strikesXXYY.csv

Информация об исполнении маркет-мейкерских обязательств по опционам (в разбивке по страйкам) Брокерской фирмы, где XXYY – код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *mmopt_strikesXXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
session_date	datetime	Дата торгового дня
agreement_number	varchar(50)	Номер маркет-мейкерского договора
group_code	varchar(7)	Код группировки для агрегирования показателей исполнения мм-обязательств
code	varchar(7)	Код раздела регистра учета позиций
underlying	varchar(25)	Код базисного актива опционного контракта: • Базисный актив, которого является ценная бумага – торговый код ценной бумаги на Фондовом рынке. Например, SBER. • Базисный актив, которого является фьючерсный контракт – код базового актива фьючерсного контракта. Например, SBRF.
futures	varchar(25)	Код опционного контракта: • Базисный актив, которого является ценная бумага – N/A. • Базисный актив, которого является фьючерсный контракт – код фьючерсного контракта. Например, SBRF-6.22.
expiration_date	datetime	Дата экспирации опционного контракта

Название поля	Тип поля	Описание поля
instrument	varchar(25)	Короткий код опионного контракта (см. расшифровку кода на http://moex.com/s205)
spread	numeric(16,5)	Спрэд двусторонних котировок, соответствующий мм-обязательствам
average_spread	numeric(16,5)	Фактический средний спрэд двусторонних котировок
min_size	int	Минимальный объем заявок, соответствующий мм-обязательствам
shift_from_cs	numeric(16,5)	Смещение от центрального страйка
call_put	varchar(3)	Тип опционного контракта
spread_maintenance_%	numeric(16,2)	Фактическая продолжительность поддержания двусторонних котировок, %
spread_maintenance_seconds	int	Фактическая продолжительность поддержания двусторонних котировок, в секундах
quant_start	varchar(20)	Время начала кванта
quant_end	varchar(20)	Время окончания кванта
quant_seconds	int	Продолжительность кванта, в секундах
time_first_spread	varchar(25)	Время выставления первого спрэда
trade_number	int	Количество сделок
contract_number	int	Количество контрактов
position_number	int	Количество позиций
min_maintenance_%	int	Минимальная продолжительность поддержания двусторонних котировок, соответствующая мм-обязательствам (по страйку), %
partial_maintenance _%	int	Частичная продолжительность поддержания двусторонних котировок, соответствующая мм-обязательствам,%
full_maintenance_%	int	Максимальная продолжительность поддержания двусторонних котировок, соответствующая мм-обязательствам,%
order_book	varchar(4)	Обязательства маркет-мейкера в основном стакане - ‘MAIN’
is_group	int	Индикатор для агрегирования показателей исполнения мм-обязательств по коду группы: ‘1’ – агрегирование показателей исполнения мм-обязательств по коду группы, ‘0’ – исполнение мм-обязательств по коду раздела регистра учета позиций
is_volat	int	Индикатор действия режима повышенной волатильности для условий программы: ‘1’ – применяются упрощенные условия для данного торгового дня и инструмента (в случае высокой волатильности и наличия режима повышенной волатильности для программы), ‘0’ – применяются стандартные условия для данного торгового дня и инструмента (в случае невысокой волатильности и/или отсутствия режима повышенной волатильности для программы)
underlying_type	char(1)	Код опционного контракта: F - базисный актив, которого является фьючерсный контракт, E - базисный актив, которого является ценная бумага.
margin_style	char(1)	Тип маржирования опциона: M – маржируемый, P – премиальный.

Примечание:

1. Отчет предоставляется по итогам основной клиринговой сессии.

7. Пакет FORDLOGYYYYMMDD.zip

ВК - заявки по фьючерсам.

7.1. Отчет fordlogXXYY.csv

Информация о принятых заявках по фьючесным контрактам по Брокерской фирме и ее клиентам, где XXYY – код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *fordlogXXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
N	i8	Порядковый номер выставленной заявки в пользовательской системе
id_ord	i8	Номер заявки в пользовательской системе, в случае айсберг заявки в этом поле будет номер всплывающей части айсберг-заявки
sess_id	i4	Идентификатор торговой сессии
isin	char(25)	Код инструмента
amount	i8	Количество заявок в операции (используется значение из xamount)
amount_rest	i4	Оставшееся количество в заявке (используется значение из xamount_rest)
id_deal	numeric(19)	Идентификатор сделки по данной записи журнала заявок
xstatus	i8	Расширенный статус заявки
price	numeric(16,5)	Цена выставленной заявки
moment	datetime	Дата-время с точностью до наносекунд появления заявки
dir	i1	Направление заявки: 1 – покупка, 2 – продажа.
action	i1	Действие с заявкой: 0 – удаление, 1 – добавление, 2 - сведение в сделку.
remove_type	i4	Тип снятия/удаления/иная операция в отношении выставленной заявки: 0 – снятие заявки Участником торгов/или иная операция, 1 – удаление заявки администратором торгов по запросу Участника торгов, 2 – удаление заявки торговой системой.
deal_price	numeric(16,5)	Цена заключенной сделки по данной записи журнала заявок
client_code	char(7)	Код раздела клиринговых регистров
login_from	char(20)	Логин пользователя, поставившего заявку
comment	char(20)	Комментарий к заявке
ext_id	i4	Идентификатор заявки в пользовательской системе
broker_to	char(7)	Код раздела Брокерской фирмы, в адрес которой подана адресная заявка
broker_to_rts	char(20)	Код РТС Брокерской фирмы, в адрес которой подана адресная заявка. При выставлении адресной заявки без указания контрагента указывается код 'CCNC' центрального контрагента (Клиринговый центр)
broker_from_rts	char(20)	Код РТС Брокерской фирмы, от которой подана адресная заявка
date_exp	date	Дата истечения срока жизни многодневной заявки.
id_ord_first	i8	Номер первой заявки в последовательности при пере выставления заявки со сроком истечения

Название поля	Тип поля	Описание поля
aspref	numeric(4)	Ссылка из таблицы user на мастер-логин Участника торгов
asp	char(20)	Логин Участника торгов из таблицы user (мастер-логин Участника)
private_amount	i8	Количество единиц инструмента в операции по Айсберг-заявке
private_amount_rest	i8	Оставшееся количество в Айсберг-заявке
private_order_id	i8	Номер Айсберг-заявки в системе
mm	i1	Признак заявки маркет-мейкера: 0 – обычная заявка, 1 – заявка, поданная в рамках выполнения обязательств маркет-мейкера
actualmm	i1	Проверка заявки маркет-мейкера: 0 – заявка не соответствует условиям выполнения обязательств маркет-мейкера по договору и/или регуляторным требованиям, 1 – заявка соответствует условиям выполнения обязательств маркет-мейкера по договору и/или регуляторным требованиям
match_ref	char(10)	Уникальное кодовое слово, выражающее взаимное согласие, для выставления двух встречных адресных заявок без указания контрагента
compliance_id	char(1)	Тип ввода заявки: • ' ' (пробел) или '' (пустая строка) – не заполнено/ не задано, • 'M' - Ручной ввод, • 'S' - В результате срабатывания условного поручения (стоп-лосс), • 'R' - В результате работы алгоритма-робота, • 'A' - В результате алгоритма автоследования, • 'D' - Закрытие позиции в результате не исполненного Маржинального требования.

Примечание:

1. Отчет предоставляется по подписке в соответствии с предоставленным Заявлением на предоставление отчетов по принятым/отвергнутым заявкам [http://fs.moex.com/files/16531/] путем выкладывания в Личном кабинете Участника (ЛКУ).
2. Ссылка на спецификацию PLAZA II шлюз (ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf]).
3. В поле match_ref могут использоваться буквы (кириллица и/или латиница), цифры, специальные символы.

8. Пакет OORDLOGYYYYMMDD.zip

ВК - заявки по опционам.

8.1. Отчет oordlogXXYY.csv

Информация о принятых заявках по опционным контрактам по Брокерской фирме и ее клиентам, где XXYY – код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *oordlogXXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
N	i8	Порядковый номер выставленной заявки в пользовательской системе
id_ord	i8	Номер заявки в пользовательской системе, в случае айсберг заявки в этом поле будет номер всплывающей части айсберг-заявки
sess_id	i4	Идентификатор торговой сессии
isin	char(25)	Код инструмента
amount	i8	Количество заявок в операции (используется значение из xamount)
amount_rest	i4	Оставшееся количество в заявке (используется значение из xamount_rest)
id_deal	numeric(19)	Идентификатор сделки по данной записи журнала заявок
xstatus	i8	Расширенный статус заявки
price	numeric(16,5)	Цена выставленной заявки
moment	datetime	Дата-время с точностью до наносекунд появления заявки
dir	i1	Направление заявки: 1 – покупка, 2 – продажа.
action	i1	Действие с заявкой: 0 – удаление, 1 – добавление, 2 - сведение в сделку.
remove_type	i4	Тип снятия/удаления/иная операция в отношении выставленной заявки: 0 – снятие заявки Участником торгов/или иная операция, 1 – удаление заявки администратором торгов по запросу Участника торгов, 2 – удаление заявки торговой системой.
deal_price	numeric(16,5)	Цена заключенной сделки по данной записи журнала заявок
client_code	char(7)	Код раздела клиринговых регистров
login_from	char(20)	Логин пользователя, поставившего заявку
comment	char(20)	Комментарий к заявке
ext_id	i4	Идентификатор заявки в пользовательской системе
broker_to	char(7)	Код раздела Брокерской фирмы, в адрес которой подана адресная заявка
broker_to_rts	char(20)	Код РТС Брокерской фирмы, в адрес которой подана адресная заявка. При выставлении адресной заявки без указания контрагента указывается код 'CCNC' центрального контрагента (Клиринговый центр)
broker_from_rts	char(20)	Код РТС Брокерской фирмы, от которой подана адресная заявка
date_exp	date	Дата истечения срока жизни многодневной заявки.
id_ord_first	i8	Номер первой заявки в последовательности при пере выставления заявки со сроком истечения

Название поля	Тип поля	Описание поля
aspref	numeric(4)	Ссылка из таблицы user на мастер-логин Участника торгов
asp	char(20)	Логин Участника торгов из таблицы user (мастер-логин Участника)
private_amount	i8	Количество единиц инструмента в операции по Айсберг-заявке
private_amount_rest	i8	Оставшееся количество в Айсберг-заявке
private_order_id	i8	Номер Айсберг-заявки в системе
mm	i1	Признак заявки маркет-мейкера: 0 – обычная заявка, 1 – заявка, поданная в рамках выполнения обязательств маркет-мейкера
actualmm	i1	Проверка заявки маркет-мейкера: 0 – заявка не соответствует условиям выполнения обязательств маркет-мейкера по договору и/или регуляторным требованиям, 1 – заявка соответствует условиям выполнения обязательств маркет-мейкера по договору и/или регуляторным требованиям
match_ref	char(10)	Уникальное кодовое слово, выражающее взаимное согласие, для выставления двух встречных адресных заявок без указания контрагента
compliance_id	char(1)	Тип ввода заявки: • ' ' (пробел) или '' (пустая строка) – не заполнено/ не задано, • 'M' - Ручной ввод, • 'S' - В результате срабатывания условного поручения (стоп-лосс), • 'R' - В результате работы алгоритма-робота, • 'A' - В результате алгоритма автоследования, • 'D' - Закрытие позиции в результате не исполненного Маржинального требования.

Примечание:

1. Отчет предоставляется по подписке в соответствии с предоставленным Заявлением на предоставление отчетов по принятым/отвергнутым заявкам [http://fs.moex.com/files/16531/] путем выкладывания в Личном кабинете Участника (ЛКУ).
2. Ссылка на спецификацию PLAZA II шлюз (ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf]).
3. В поле match_ref могут использоваться буквы (кириллица и/или латиница), цифры, специальные символы.

9. Пакет ERRLOGYYYYMMDD.zip

ВК - непринятые заявки.

9.1. Отчет errlogXXYY.csv

Информация об отвергнутых заявках по Брокерской фирме и ее клиентам, где XXYY – код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *errlogXXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
moment	datetime	Дата-время появления заявки
login_from	char(20)	Логин пользователя, поставившего заявку
error_code	numeric(10)	Код ошибки в соответствии со справочником кодов возврата спецификации PLAZA II шлюз
error_message	char(255)	Текст сообщения об ошибке
tran_type	char(10)	Типы операций в отношении заявок: **add** - добавление заявки, **move** - изменение заявки или пары заявок, **del** - удаление одиночной заявки, **masscnl** - массовое удаление заявок, **errorparse** – нераспаршенное сообщение.
isin	char(25)	Код инструмента
client_code	char(7)	Код раздела клиринговых регистров
order_type	i1	Тип заявки: 1 – котировочная, 2 – встречная (immediate-or-cancel), 3 – fill-or-kill.
dir	i1	Направление заявки: 1 – покупка, 2 – продажа.
move_mode	i1	Режим работы операции передвижки заявки (MoveOrder), заполняется при операции **move**: 0 – «не менять объёмы заявок», 1 – «изменить объёмы на присланные заявки», 2 – «произвести изменение остальных параметров заявок, в случае если объём хотя бы одной из присланных заявок не совпадает с присланным объёмом», 3 – «изменить объёмы заявок на присланные заявки за вычетом уже сведенного в сделки объёма».
amount	i8	Количество операций для первой заявки для изменения пары заявок. Заполняется при операции: - **add** (в т.ч. при пере выставлении заявки со сроком жизни), - **move**.
amount2	i8	Количество операций для второй заявки для изменения пары заявок. Заполняется при операции **move**.
price	numeric(16,5)	Цена первой заявки для изменения пары заявок. Заполняется при операции: - **add** (в т.ч. при пере выставлении заявки со сроком жизни), - **move**.
price2	numeric(16,5)	Цена второй заявки для изменения пары заявок.

Название поля	Тип поля	Описание поля
		Заполняется при операции **move**.
rate_price	numeric(16,5)	Своп-цена. Заполняется только для заявок по составным инструментам-связкам при операции **add** (в т.ч. при пере выставлении заявки со сроком жизни).
comment	char(20)	Комментарий в заявке. Заполняется при операции **add** (в т.ч. при пере выставлении заявки со сроком жизни).
ext_id	i4	Идентификатор первой заявки при изменении пары заявок. Заполняется при операции: - **add** (в т.ч. при пере выставлении заявки со сроком жизни), - **move**.
ext_id2	i4	Идентификатор второй заявки при изменении пары заявок. Заполняется при операции **move**.
broker_to_rts	char(20)	Код РТС Брокерской фирмы, в адрес которой подана адресная заявка. Заполняется при операции **add** (в т.ч. при пере выставлении заявки со сроком жизни).
date_exp	date	Дата истечения срока жизни многодневной заявки. Заполняется при операции **add** (в т.ч. при пере выставлении заявки со сроком жизни).
match_ref	char(10)	Код для сведения адресных заявок. Заполняется при операции **add** (в т.ч. при пере выставлении заявки со сроком жизни).
dont_check_money	i1	Признак отсутствия проверки торгового лимита на уровне клиентского кода раздела - 0. Заполняется при операции **add** (в т.ч. при пере выставлении заявки со сроком жизни).
opt_check_limit	i1	Признак наличия проверки торгового лимита по заявкам на опционы – 0. Заполняется при операции **add** (в т.ч. при пере выставлении заявки со сроком жизни).
del_move_ord_id	i8	Номер удаляемой заявки или первой заявки при изменении двух заявок. Заполняется при операции: - **move**, - **del**.
move_ord_id2	i8	Номер второй заявки при изменении пары заявок. Заполняется при операции **move**.
mass_cancel_buy_sell	i1	Критерий покупка/продажа в транзакции массового удаления заявок: 1 - удаление заявок на покупку, 2 - на продажу, 3 - всех заявок. Заполняется при операции **masscnl**.
mass_cancel_non_system	i1	Критерий адресная/безадресная заявка в транзакции массового удаления заявок: 0 - удаление безадресных заявок, 1 - адресных, 2 - всех заявок. Заполняется при операции **masscnl**.
mass_cancel_client_code	char(3)	Клиентский код в транзакции массового удаления заявок (последние 3 знака из кода раздела клиринговых регистров XXYYZZZ). Пустое значение соответствует любому клиентскому коду. Заполняется при операции **masscnl**.
mass_cancel_code_vcb	char(25)	Код базового актива инструмента в транзакции массового удаления заявок. Пустое значение соответствует любому коду базового актива инструмента. Заполняется при операции **masscnl**.

Название поля	Тип поля	Описание поля
mass_cancel_isin	char(25)	Код инструмента в транзакции массового удаления заявок. Пустое значение соответствует любому коду инструмента. Заполняется при операции **masscnl**.
mass_cancel_ext_id	i1	Критерий кода инструмента в транзакции массового удаления заявок. Заполняется при операции **masscnl**. 0 - соответствует любому коду инструмента.
iceberg_amount	i8	Количество единиц инструмента в операции по Айсберг-заявке
variance_amount	i8	Амплитуда отклонения случайной надбавки заданной количеством контрактов для всплывающей части по Айсберг-заявке

Примечание:

1. Отчет предоставляется по подписке в соответствии с предоставленным Заявлением на предоставление отчетов по принятым/отвергнутым заявкам [http://fs.moex.com/files/16531/] путем выкладывания в Личном кабинете Участника (ЛКУ).
2. Ссылка на спецификацию PLAZA II шлюз (ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf]).

10. Пакет REBATEYYYYMMDD.zip

Отчеты по возвратной премии.

10.1. Отчет rebate_options_XXYY.csv

Отчет по маркетинговой программе по опционам. Файл формата csv.

Структура отчета *rebate_options_XXYY.csv* :

Название поля	Тип поля	Описание поля
Date	date	Дата, за которую сделан расчет
Month	int	Номер месяца, за который формируется отчет
Year	int	Год месяца, за который формируется отчет
ClientCode	char(7)	Код клиента (7кк)
VOL	numeric(18,2)	Объем за отчетный месяц, млн. руб
Fee (0)	numeric(16,2)	Комиссия, уплаченная за сделки, которые попали в 0 уровень
Fee (1)	numeric(16,2)	Комиссия, уплаченная за сделки, которые попали в 1 уровень
Fee (2)	numeric(16,2)	Комиссия, уплаченная за сделки, которые попали во 2 уровень
Fee (3)	numeric(16,2)	Комиссия, уплаченная за сделки, которые попали в 3 уровень
Fee (4)	numeric(16,2)	Комиссия, уплаченная за сделки, которые попали в 4 уровень
Fee Total	numeric(16,2)	Комиссия, уплаченная 7кк за отчетный период. Значение рассчитывается как сумма значение "уплаченная комиссия" на 0 + 1+ 2+ 3+ 4 уровнях
Rebate	numeric(16,2)	Текущее (плановое) вознаграждение по итогу месяца

Примечание:

1. Маркетинговая программа предполагает прогрессивную шкалу коэффициента вознаграждения. Предусмотрено пять уровней объема сделок, для каждого из которых используется свой коэффициент вознаграждения. Чем выше объем тем больше коэффициент.

   R = $Fee(0)*k_0$+ $Fee(1)*k_1$+ $Fee(2)*k_2$ + $Fee(3)*k_3$+ $Fee(4)*k_4$ - итоговое вознаграждение, где

   Fee - комиссия, уплаченная за сделки соответствующего уровня

   k - коэффициент вознаграждения в процентах

11. Пакет EXCHANGEHLDYYYYMMDD.zip

Биржевые отчеты по итогам сессий выходного дня. Данные отчеты содержат основную информацию по торгам, которая может быть полезна для участника в рамках ДСВД, в которые не проводится клиринговых сессий. Структура отчетов аналогична текущим отчетам без суффикса "_ trade_ ". Данные, формируемые по итогам клиринговых сессий, в этих отчетах отображаться не будут (поля сохраняются, но будут пустые). Пакет EXCHANGEHLDYYYYMMDD.zip в названии будет содержать календарную дату соответствующей ДСВД. Пакет по первой ДСВД в торговом дне будет содержать также данные за соответствующую вечернюю сессию текущего торгового дня (например, вечернюю сессию пятницы). Пакет по второй ДСВД будет содержать данные только по этой ДСВД. Регламентное время предоставления отчетов - до 14:00 следующего календарного дня.

11.1. Отчет f04_trade_XXYY.csv

Информация о фьючерсных сделках в ДСВД Брокерской фирмы и ее клиентов, где XXYY – код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *f04_trade_XXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
id_deal	numeric(19)	Идентификатор сделки в торговой системе
isin	char(25)	Уникальный код инструмента (фьючерсного контракта)
price	numeric(16,5)	Цена заключения фьючерсных контрактов (в пунктах)
vol	numeric(10)	Количество инструментов в сделке (шт.)
kod_sell	char(7)	Код продавца
kod_buy	char(7)	Код покупателя
date	char(10)	Дата регистрации сделки
time	char(8)	Время сделки.
type_buy	numeric(2)	Тип сделки Покупателя: 0 – безадресная сделка, 1 – возникла в результате экспирации опционов, 2 – адресная сделка/ или перевод позиций между разделами с одинаковыми идентификационными данными с признаком битовой маски 0x8 в шлюзе и уникальным ненулевым id в поле signs_buy, 3 – для Сделок, заключенных по закрывающим и балансирующим сделкам с Добросовестным участником клиринга, 4 – первая часть сделки РЕПО - не используется, 5 – вторая часть сделки РЕПО - не используется, 7 – сделки купли-продажи по разделам ДУ (вместо сделок РЕПО) - не используется, 8 – сделки исполнения поставочного фьючерсного контракта через инструмент Standard - не используется, 9 – первая части сделки РЕПО T+N - не используется, 10 – вторая часть сделки РЕПО T+N - не используется, 11 – закрытие позиции в результате исполнения расчетного/поставочного фьючерсного контракта (отражается в противоположную сторону для закрытия позиции в учете), 12 – не используется, 13 – не используется, 14 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 15 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 16 – не используется, 17 – не является сделкой, операция по изменению позиции по фьючерсному контракту с текущей датой исполнения, базовым активом которого является данная иностранная валюта / ценная бумага / драгоценный металл, в количестве и по направлению, соответствующему переданному / получен-

Название поля	Тип поля	Описание поля
		ному Профилю актива по иностранной валюте / ценной бумаге /драгоценному металлу (коллатеральный инструмент)/, 18 – для сделок, заключенных на основании Индикативных заявок, 19 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, заключенных на основании Индикативных заявок, 20 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, заключенных на основании Индикативных заявок, 21 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга при проведении процедуры кросс-дефолта, 22 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование, 23 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга, не исполнившего Обязательства по поставке по поставочным Срочным контрактам на драгоценные металлы, 24 – для Сделок, заключенных путем подачи поручения об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией, 25 – для Сделок, заключенных вследствие подачи Участником клиринга – Продавцом поручения об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией, 26 – для исполнения однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией посредством заключения квартального фьючерсного контракта, 27 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие, 28 – для Сделок, заключенных на основании Заявки с указанием спреда «TAS» (опция Trade at Settlement).
type_sell	numeric(2)	Тип сделки Продавца: 0 – безадресная сделка, 1 – возникла в результате экспирации опционов, 2 – адресная сделка/ или перевод позиций между разделами с одинаковыми идентификационными данными с признаком битовой маски 0x8 в шлюзе и уникальным ненулевым id в поле signs_sell, 3 – для Сделок, заключенных по закрывающим и балансирующим сделкам с Добросовестным участником клиринга, 4 – первая часть сделки РЕПО - не используется, 5 – вторая часть сделки РЕПО - не используется, 7 – сделки купли-продажи по разделам ДУ (вместо сделок РЕПО) - не используется, 8 – сделки исполнения поставочного фьючерсного контракта через инструмент Standard - не используется, 9 – первая части сделки РЕПО T+N - не используется, 10 – вторая часть сделки РЕПО T+N - не используется, 11 – закрытие позиции в результате исполнения расчетного/поставочного фьючерсного контракта (отражается в противоположную сторону для закрытия позиции в учете), 12 – не используется, 13 – не используется, 14 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 15 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде,

Название поля	Тип поля	Описание поля
		16 – не используется, 17 – не является сделкой, операция по изменению позиции по фьючерсному контракту с текущей датой исполнения, базовым активом которого является данная иностранная валюта / ценная бумага / драгоценный металл, в количестве и по направлению, соответствующему переданному / полученному Профилю актива по иностранной валюте / ценной бумаге /драгоценному металлу (коллатеральный инструмент)/, 18 – для сделок, заключенных на основании Индикативных заявок, 19 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, заключенных на основании Индикативных заявок, 20 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, заключенных на основании Индикативных заявок, 21 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга при проведении процедуры кросс-дефолта, 22 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование, 23 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга, не исполнившего Обязательства по поставке по поставочным Срочным контрактам на драгоценные металлы, 24 – для Сделок, заключенных путем подачи поручения об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией, 25 – для Сделок, заключенных вследствие подачи Участником клиринга – Покупателем поручения об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией, 26 – для исполнения однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией посредством заключения квартального фьючерсного контракта, 27 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие, 28 – для Сделок, заключенных на основании Заявки с указанием спреда «TAS» (опция Trade at Settlement).
var_marg_b	numeric(16,2)	Вариационная маржа покупателя по сделке (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
var_marg_s	numeric(16,2)	Вариационная маржа продавца по сделке (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
user_sell	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Продавца
user_buy	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Покупателя
no_buy	numeric(19)	Номер заявки покупателя в торговой системе
no_sell	numeric(19)	Номер заявки продавца в торговой системе
fee_buy	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресной сделки покупателем (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_sell	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресной сделки продавцом (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
date2	Date	Дата регистрации сделки
comm_buy	char(20)	Комментарий покупателя
comm_sell	char(20)	Комментарий продавца
fee_ns_b	numeric(16, 2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение адресной сделки покупателем (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_ns_s	numeric(16, 2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение адресной сделки продавцом (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*

Название поля	Тип поля	Описание поля
price_rur	numeric(16, 5)	Цена заключения фьючерсных контрактов (в рублях РФ)
ext_id_b	numeric(11)	Внешний номер покупателя.
ext_id_s	numeric(11)	Внешний номер продавца.
date_clr	date	Дата проведения клиринга. *Не заполняется в случае ДСВД*
repo_id	numeric(19)	Поле содержит id_deal другой части сделки для фьючерсных контрактов в календарном спреде. В иных случаях – значение '0'
fee_ex_b	numeric(16,2)	Биржевой сбор за заключение адресной / безадресной сделки покупателем (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_cc_b	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за заключение адресной / безадресной сделки покупателем (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_ex_s	numeric(16,2)	Биржевой сбор за заключение адресной / безадресной сделки продавцом (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_cc_s	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за заключение адресной / безадресной сделки продавцом (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
id_mult	numeric(19)	Признак технической сделки, являющейся частью связанной сделки, в данном поле проставляется идентификационный номер связанной сделки. Аналог полю id_deal_multileg в Plaza-2 шлюзе в таблице сделок. Для обычных сделок признак не указывается.
signs_buy	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Покупателя. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
signs_sell	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Продавца. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
counterparty	char(7)	Код контрагента по Сделке (Идентификатор Участника клиринга или код Брокерской фирмы, открытой в рамках Идентификатора Участника клиринга), заключенной на основании адресной Заявки. Для Сделок со значением '27' в полях type_buy/ type_sell указывается код 'CCNC' центрального контрагента (Клиринговый центр)
ncc_request_buy	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Покупатель): 0 – отсутствует, 1 – присутствует
ncc_request_sell	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Продавец): 0 – отсутствует, 1 – присутствует
var_marg_b_settl_price	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи, связанная с изменением Расчетной цены по фьючерсному контракту (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
var_marg_b_swap_rate	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи, 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 (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
var_marg_s_settl_price	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи, связанная с изменением Расчетной цены по фьючерсному контракту (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
var_marg_s_swap_rate	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи, 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 (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*

Название поля	Тип поля	Описание поля
var_marg_b_index_div	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи с учетом дивидендных выплат по ценным бумагам, входящих в базу расчетов Индексов Московской Биржи, для однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией на Индексы Московской Биржи (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
var_marg_s_index_div	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи с учетом дивидендных выплат по ценным бумагам, входящих в базу расчетов Индексов Московской Биржи, для однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией на Индексы Московской Биржи (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*

Примечание:

1. Данные, формируемые по итогам клиринговых сессий, в отчете не отображаются (поля сохраняются, но будут пустые).
2. id_deal соответствует идентификатору сделки, выдаваемому шлюзовыми процедурами.
3. no_buy, no_sell – идентификаторы заявок, на основе которых заключена сделка. Данные идентификаторы соответствует идентификаторам заявок, выдаваемых шлюзовыми процедурами.
4. Поле date2 по смыслу аналогично полю date.
5. Поля no_buy, no_sell = полю private_order_id в fordlog_trade_XXYY.csv, если сделка заключена на основании айсберг заявки, будет указываться номер Айсберг-заявки.

11.2. Отчет f04cl_trade_XXYYZZZ.csv

Информация о фьючерсных сделках клиентов в ДСВД, где XXYYZZZ – код раздела. Файл формата csv.

Структура отчета *f04cl_trade_XXYYZZZ.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
id_deal	numeric(19)	Идентификатор сделки в торговой системе
isin	char(25)	Уникальный код инструмента (фьючерсного контракта)
price	numeric(16,5)	Цена заключения фьючерсных контрактов (в пунктах)
vol	numeric(10)	Количество инструментов в сделке (шт.)
kod_sell	char(7)	Код продавца
kod_buy	char(7)	Код покупателя
date	char(10)	Дата регистрации сделки
time	char(8)	Время сделки.
type_buy	numeric(2)	Тип сделки Покупателя: 0 – безадресная сделка, 1 – возникла в результате экспирации опционов, 2 – адресная сделка/ или перевод позиций между разделами с одинаковыми идентификационными данными с признаком битовой маски 0x8 в шлюзе и уникальным ненулевым id в поле signs_ buy, 3 – для Сделок, заключенных по закрывающим и балансирующим сделкам с Добросовестным участником клиринга, 4 – первая часть сделки РЕПО - не используется, 5 – вторая часть сделки РЕПО - не используется, 7 – сделки купли-продажи по разделам ДУ (вместо сделок РЕПО) - не используется, 8 – сделки исполнения поставочного фьючерсного контракта через инструмент Standard - не используется, 9 – первая части сделки РЕПО T+N - не используется, 10 – вторая часть сделки РЕПО T+N - не используется, 11 – закрытие позиции в результате исполнения расчетного/поставочного фьючерсного контракта (отражается в противоположную сторону для закрытия позиции в учете),

Название поля	Тип поля	Описание поля
		12 – не используется, 13 – не используется, 14 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 15 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 16 – не используется, 17 – не является сделкой, операция по изменению позиции по фьючерсному контракту с текущей датой исполнения, базовым активом которого является данная иностранная валюта / ценная бумага / драгоценный металл, в количестве и по направлению, соответствующему переданному / полученному Профилю актива по иностранной валюте / ценной бумаге /драгоценному металлу (коллатеральный инструмент)/, 18 – для сделок, заключенных на основании Индикативных заявок, 19 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, заключенных на основании Индикативных заявок, 20 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, заключенных на основании Индикативных заявок, 21 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга при проведении процедуры кросс-дефолта, 22 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование, 23 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга, не исполнившего Обязательства по поставке по поставочным Срочным контрактам на драгоценные металлы, 24 – для Сделок, заключенных путем подачи поручения об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией, 25 – для Сделок, заключенных вследствие подачи Участником клиринга – Продавцом поручения об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией, 26 – для исполнения однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией посредством заключения квартального фьючерсного контракта, 27 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие, 28 – для Сделок, заключенных на основании Заявки с указанием спреда «TAS» (опция Trade at Settlement).
type_sell	numeric(2)	Тип сделки Продавца: 0 – безадресная сделка, 1 – возникла в результате экспирации опционов, 2 – адресная сделка/ или перевод позиций между разделами с одинаковыми идентификационными данными с признаком битовой маски 0x8 в шлюзе и уникальным ненулевым id в поле signs_ sell, 3 – для Сделок, заключенных по закрывающим и балансирующим сделкам с Добросовестным участником клиринга, 4 – первая часть сделки РЕПО - не используется, 5 – вторая часть сделки РЕПО - не используется, 7 – сделки купли-продажи по разделам ДУ (вместо сделок РЕПО) - не используется, 8 – сделки исполнения поставочного фьючерсного контракта через инструмент Standard - не используется,

Название поля	Тип поля	Описание поля
		9 – первая части сделки РЕПО T+N - не используется, 10 – вторая часть сделки РЕПО T+N - не используется, 11 – закрытие позиции в результате исполнения расчетного/поставочного фьючерсного контракта (отражается в противоположную сторону для закрытия позиции в учете), 12 – не используется, 13 – не используется, 14 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 15 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, 16 – не используется, 17 – не является сделкой, операция по изменению позиции по фьючерсному контракту с текущей датой исполнения, базовым активом которого является данная иностранная валюта / ценная бумага / драгоценный металл, в количестве и по направлению, соответствующему переданному / полученному Профилю актива по иностранной валюте / ценной бумаге /драгоценному металлу (коллатеральный инструмент)/, 18 – для сделок, заключенных на основании Индикативных заявок, 19 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, заключенных на основании Индикативных заявок, 20 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, заключенных на основании Индикативных заявок, 21 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга при проведении процедуры кросс-дефолта, 22 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование, 23 – для сделок, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга, не исполнившего Обязательства по поставке по поставочным Срочным контрактам на драгоценные металлы, 24 – для Сделок, заключенных путем подачи поручения об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией, 25 – для Сделок, заключенных вследствие подачи Участником клиринга – Покупателем поручения об исполнении однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией, 26 – для исполнения однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией посредством заключения квартального фьючерсного контракта, 27 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие, 28 – для Сделок, заключенных на основании Заявки с указанием спреда «TAS» (опция Trade at Settlement).
var_marg_b	numeric(16,2)	Вариационная маржа покупателя по сделке (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
var_marg_s	numeric(16,2)	Вариационная маржа перевод продавца по сделке (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
user_sell	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Продавца
user_buy	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Покупателя
no_buy	numeric(19)	Номер заявки покупателя в торговой системе
no_sell	numeric(19)	Номер заявки продавца в торговой системе
fee_buy	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресной сделки покупателем (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*

Название поля	Тип поля	Описание поля
fee_sell	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресной сделки продавцом (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
date2	Date	Дата регистрации сделки
comm_buy	char(20)	Комментарий покупателя
comm_sell	char(20)	Комментарий продавца
fee_ns_b	numeric(16, 2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение адресной сделки покупателем (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_ns_s	numeric(16, 2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение адресной сделки продавцом (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
price_rur	numeric(16, 5)	Цена заключения фьючерсных контрактов (в рублях РФ)
ext_id_b	numeric(11)	Внешний номер покупателя.
ext_id_s	numeric(11)	Внешний номер продавца.
date_clr	date	Дата проведения клиринга. *Не заполняется в случае ДСВД*
repo_id	numeric(19)	Поле содержит id_deal другой части сделки для фьючерсных контрактов в календарном спреде. В иных случаях – значение '0'
fee_ex_b	numeric(16,2)	Биржевой сбор за заключение адресной / безадресной сделки покупателем (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_cc_b	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за заключение адресной / безадресной сделки покупателем (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_ex_s	numeric(16,2)	Биржевой сбор за заключение адресной / безадресной сделки продавцом (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_cc_s	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за заключение адресной / безадресной сделки продавцом (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
id_mult	numeric(19)	Признак технической сделки, являющейся частью связанной сделки, в данном поле проставляется идентификационный номер связанной сделки. Аналог полю id_deal_multileg в Plaza-2 шлюзе в таблице сделок. Для обычных сделок признак не указывается.
signs_buy	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Покупателя. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
signs_sell	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Продавца. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
counterparty	char(7)	Код контрагента по Сделке (Идентификатор Участника клиринга или код Брокерской фирмы, открытой в рамках Идентификатора Участника клиринга), заключенной на основании адресной Заявки. Для Сделок со значением '27' в полях type_buy/ type_sell указывается код 'CCNC' центрального контрагента (Клиринговый центр)
ncc_request_buy	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Покупатель): 0 – отсутствует, 1 – присутствует
ncc_request_sell	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Продавец): 0 – отсутствует, 1 – присутствует

Название поля	Тип поля	Описание поля
var_marg_b_settl_price	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи, связанная с изменением Расчетной цены по фьючерсному контракту (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
var_marg_b_swap_rate	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи, 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 (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
var_marg_s_settl_price	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи, связанная с изменением Расчетной цены по фьючерсному контракту (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
var_marg_s_swap_rate	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи, 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 (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
var_marg_b_index_div	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи с учетом дивидендных выплат по ценным бумагам, входящих в базу расчетов Индексов Московской Биржи, для однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией на Индексы Московской Биржи (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
var_marg_s_index_div	numeric(16,2)	Составляющая часть обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи с учетом дивидендных выплат по ценным бумагам, входящих в базу расчетов Индексов Московской Биржи, для однодневных фьючерсных контрактов с автопролонгацией на Индексы Московской Биржи (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*

Примечание:

1. Данные, формируемые по итогам клиринговых сессий, в отчете не отображаются (поля сохраняются, но будут пустые).

11.3. Отчет o04_trade_XXYY.csv

Информация об опционных сделках в ДСВД Брокерской фирмы и ее клиентов, где XXYY – код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *o04_trade_XXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
id_deal	numeric(19)	Идентификатор сделки в торговой системе
isin	char(25)	Уникальный код инструмента (опционного контракта)
price	numeric(16,5)	Цена сделки (пункты)
vol	numeric(10)	Количество инструментов в сделке (шт.)
kod_sell	char(7)	Код продавца
kod_buy	char(7)	Код покупателя
date	char(10)	Дата регистрации сделки
time	char(8)	Время сделки
type_buy	numeric(2)	Тип сделки Покупателя: 0 – безадресная сделка, 1 – возникла в результате экспирации опционов, 2 – адресная сделка/ или перевод позиций между разделами с одинаковыми идентификационными данными с признаком битовой маски 0x8 в шлюзе и уникальным ненулевым id в поле signs_buy, 3 – для опционных контрактов, заключенных по закрывающим и балансирующим сделкам с Добросовестным участником клиринга, 4 – возникла в результате истечения опциона без экспирации, 5 – для опционных контрактов, заключенных на основании Индикативных заявок,

Название поля	Тип поля	Описание поля
		6 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга при проведении процедуры кросс-дефолта, 7 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование 8 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие
type_sell	numeric(2)	Тип сделки Покупателя: 0 – безадресная сделка, 1 – возникла в результате экспирации опционов, 2 – адресная сделка/ или перевод позиций между разделами с одинаковыми идентификационными данными с признаком битовой маски 0x8 в шлюзе и уникальным ненулевым id в поле signs_sell, 3 – для опционных контрактов, заключенных по закрывающим и балансирующим сделкам с Добросовестным участником клиринга, 4 – возникла в результате истечения опциона без экспирации, 5 – для опционных контрактов, заключенных на основании Индикативных заявок, 6 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга при проведении процедуры кросс-дефолта, 7 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование 8 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие
user_buy	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Покупателя
user_sell	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Продавца
no_buy	numeric(19)	Номер заявки покупателя в торговой системе
no_sell	numeric(19)	Номер заявки продавца в торговой системе
fee_buy	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресной сделки покупателем (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_sell	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресной сделки продавцом (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
date2	date	Дата регистрации сделки
comm_buy	char(20)	Комментарий покупателя
comm_sell	char(20)	Комментарий продавца
fee_ns_b	numeric(16, 2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение адресной сделки покупателем (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_ns_s	numeric(16, 2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение адресной сделки продавцом (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
prem_buy	numeric(16, 2)	Премия покупателя (руб.)
prem_sell	numeric(16, 2)	Премия продавца (руб.)
price_rur	numeric(16, 5)	Цена сделки в руб.
ext_id_b	numeric(11)	Внешний номер покупателя.
ext_id_s	numeric(11)	Внешний номер продавца.
date_clr	date	Дата проведения клиринга. *Не заполняется в случае ДСВД*

Название поля	Тип поля	Описание поля
var_marg_b	numeric(16,5)	Вариационная маржа покупателя (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
var_marg_s	numeric(16,5)	Вариационная маржа продавца (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_ex_b	numeric(16,2)	Биржевой сбор за заключение адресной / безадресной сделки покупателем (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_cc_b	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за заключение адресной / безадресной сделки покупателем (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_ex_s	numeric(16,2)	Биржевой сбор за заключение адресной / безадресной сделки продавцом (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_cc_s	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за заключение адресной / безадресной сделки продавцом (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
signs_buy	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Покупателя. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
signs_sell	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Продавца. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
counterparty	char(7)	Код контрагента по Сделке (Идентификатор Участника клиринга или код Брокерской фирмы, открытой в рамках Идентификатора Участника клиринга), заключенной на основании адресной Заявки. Для Сделок со значением '8' в полях type_buy/ type_sell указывается код 'CCNC' центрального контрагента (Клиринговый центр)
ncc_request_buy	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Покупатель): 0 – отсутствует, 1 – присутствует
ncc_request_sell	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Продавец): 0 – отсутствует, 1 – присутствует
prem_buy_currency	numeric(16,2)	Обязательства Покупателя по уплате Премий по опционным контрактам (в иностранной валюте, в которой ведутся торги базисным активом) *Не заполняется в случае ДСВД*
prem_sell_currency	numeric(16,2)	Требования Продавца по уплате Премий по опционным контрактам (в иностранной валюте, в которой ведутся торги базисным активом) *Не заполняется в случае ДСВД*

Примечание:

1. Данные, формируемые по итогам клиринговых сессий, в отчете не отображаются (поля сохраняются, но будут пустые).
2. id_deal соответствует идентификатору сделки, выдаваемому шлюзовыми процедурами.
3. no_buy, no_sell – идентификаторы заявок, на основе которых заключена сделка. Данные идентификаторы соответствует идентификаторам заявок, выдаваемых шлюзовыми процедурами.
4. Поле date2 по смыслу аналогично полю date.

11.4. Отчет o04cl_trade_XXYYZZZ.csv

Информация об опционных сделках клиентов в ДСВД, где XXYYZZZ – код раздела. Файл формата csv.

Структура отчета *o04cl_trade_XXYYZZZ.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
id_deal	numeric(19)	Идентификатор сделки в торговой системе
isin	char(25)	Уникальный код инструмента (опционного контракта)
price	numeric(16,5)	Цена сделки (пункты)

Название поля	Тип поля	Описание поля
vol	numeric(10)	Количество инструментов в сделке (шт.)
kod_sell	char(7)	Код продавца
kod_buy	char(7)	Код покупателя
date	char(10)	Дата регистрации сделки
time	char(8)	Время сделки
type_buy	numeric(2)	Тип сделки Покупателя: 0 – безадресная сделка, 1 – возникла в результате экспирации опционов, 2 – адресная сделка/ или перевод позиций между разделами с одинаковыми идентификационными данными с признаком битовой маски 0x8 в шлюзе и уникальным ненулевым id в поле signs_buy, 3 – для опционных контрактов, заключенных по закрывающим и балансирующим сделкам с Добросовестным участником клиринга, 4 – возникла в результате истечения опциона без экспирации, 5 – для опционных контрактов, заключенных на основании Индикативных заявок, 6 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга при проведении процедуры кросс-дефолта, 7 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование 8 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие
type_sell	numeric(2)	Тип сделки Покупателя: 0 – безадресная сделка, 1 – возникла в результате экспирации опционов, 2 – адресная сделка/ или перевод позиций между разделами с одинаковыми идентификационными данными с признаком битовой маски 0x8 в шлюзе и уникальным ненулевым id в поле signs_sell, 3 – для опционных контрактов, заключенных по закрывающим и балансирующим сделкам с Добросовестным участником клиринга, 4 – возникла в результате истечения опциона без экспирации, 5 – для опционных контрактов, заключенных на основании Индикативных заявок, 6 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Участника клиринга при проведении процедуры кросс-дефолта, 7 – для опционных контрактов, заключенных при закрытии позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование 8 – для Сделок, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие
user_buy	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Покупателя
user_sell	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Продавца
no_buy	numeric(19)	Номер заявки покупателя в торговой системе
no_sell	numeric(19)	Номер заявки продавца в торговой системе
fee_buy	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресной сделки покупателем (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*

Название поля	Тип поля	Описание поля
fee_sell	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение безадресной сделки продавцом (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
date2	date	Дата регистрации сделки
comm_buy	char(20)	Комментарий покупателя
comm_sell	char(20)	Комментарий продавца
fee_ns_b	numeric(16, 2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение адресной сделки покупателем (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_ns_s	numeric(16, 2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за заключение адресной сделки продавцом (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
prem_buy	numeric(16, 2)	Премия покупателя (руб.)
prem_sell	numeric(16, 2)	Премия продавца (руб.)
price_rur	numeric(16, 5)	Цена сделки в руб.
ext_id_b	numeric(11)	Внешний номер покупателя.
ext_id_s	numeric(11)	Внешний номер продавца.
date_clr	date	Дата проведения клиринга. *Не заполняется в случае ДСВД*
var_marg_b	numeric(16,5)	Вариационная маржа покупателя (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
var_marg_s	numeric(16,5)	Вариационная маржа продавца (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_ex_b	numeric(16,2)	Биржевой сбор за заключение адресной / безадресной сделки покупателем (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_cc_b	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за заключение адресной / безадресной сделки покупателем (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_ex_s	numeric(16,2)	Биржевой сбор за заключение адресной / безадресной сделки продавцом (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_cc_s	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за заключение адресной / безадресной сделки продавцом (руб.) *Не заполняется в случае ДСВД*
signs_buy	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Покупателя. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
signs_sell	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Продавца. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
counterparty	char(7)	Код контрагента по Сделке (Идентификатор Участника клиринга или код Брокерской фирмы, открытой в рамках Идентификатора Участника клиринга), заключенной на основании адресной Заявки. Для Сделок со значением '8' в полях type_buy/ type_sell указывается код 'CCNC' центрального контрагента (Клиринговый центр)
ncc_request_buy	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Покупатель): 0 – отсутствует, 1 – присутствует
ncc_request_sell	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Продавец): 0 – отсутствует, 1 – присутствует
prem_buy_currency	numeric(16,2)	Обязательства Покупателя по уплате Премий по опционным контрактам (в иностранной валюте, в которой ведутся торги базисным активом) *Не заполняется в случае ДСВД*

Название поля	Тип поля	Описание поля
prem_sell_currency	numeric(16,2)	Требования Продавца по уплате Премий по опционным контрактам (в иностранной валюте, в которой ведутся торги базисным активом) *Не заполняется в случае ДСВД*

Примечание:

1. Данные, формируемые по итогам клиринговых сессий, в отчете не отображаются (поля сохраняются, но будут пустые).

11.5. Отчет multilegf04_trade_XXYY.csv

Информация о связанных сделках, заключенных в ДСВД Участником клиринга/ Брокерской фирмой и их клиентами. Файл формата csv.

Структура отчета *multilegf04_trade_XXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
id_deal	numeric(19)	Идентификационный номер сделки
isin	char(25)	Уникальный код инструмента связки
price1	numeric(16,5)	Цена первой части связанной сделки (в пунктах).
price	numeric(16,5)	Цена сделки (в пунктах).
vol	numeric(10)	Количество контрактов связки (в штуках)
rate	numeric(16,5)	Ставка. Используется для репо и пары сделок (в процентах годовых.
days	numeric(4)	Срок связки (в календарных днях). Используется для репо и пары сделок.
kod_sell	char(7)	Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке по связке, поданной Продавцом, на основании которой заключена связанная сделка
kod_rts_s	char(7)	Код продавца
kod_buy	char(7)	Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке по связке, поданной Покупателем, на основании которой заключена связанная сделка
kod_rts_b	char(7)	Код покупателя
date	char(10)	Дата регистрации связанной сделки
time	char(8)	Время регистрации связанной сделки
type_buy	numeric(2)	Тип связки Покупателя: 2 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки, 3 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании безадресной Заявки 4 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие
type_sell	numeric(2)	Тип связки Продавца: 2 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки, 3 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании безадресной Заявки 4 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие
signs_buy	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Покупателя. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
signs_sell	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Продавца. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
var_marg_b	numeric(16,2)	Вариационная маржа Покупателя по связанной сделке (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*

Название поля	Тип поля	Описание поля
var_marg_s	numeric(16,2)	Вариационная маржа Продавца по связанной сделке (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
user_sell	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Продавца по связанной сделке
user_buy	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Покупателя по связанной сделке
no_buy	numeric(19)	Идентификационный номер Заявки по связке, поданной Покупателем, на основании которой заключена связанная сделка
no_sell	numeric(19)	Идентификационный номер Заявки по связке, поданной Продавцом, на основании которой заключена связанная сделка
fee_buy	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_sell	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
date2	char(10)	Дата регистрации связанной сделки
comm_buy	char(20)	Комментарий в Заявке по связке, поданной Покупателем
comm_sell	char(20)	Комментарий в Заявке по связке, поданной Продавцом
fee_ns_b	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за связанную сделку, заключенную на основании адресной Заявки по связке, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_ns_s	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за связанную сделку, заключенную на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
price_rur1	numeric(16,5)	Цена первой части связанной сделки в рублях
price_rur	numeric(16,5)	Цена сделки в рублях
ext_id_b	numeric(11)	Дополнительный идентификационный номер, указанный в Заявке по связке, поданной Покупателем
ext_id_s	numeric(11)	Дополнительный идентификационный номер, указанный в Заявке по связке, поданной Продавцом
date_clr	date	Дата проведения клиринга *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_ex_b	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Покупателем (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_cc_b	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Покупателем (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_ex_s	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Продавцом (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_cc_s	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Продавцом (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
id_trade	numeric(19)	Идентификатор записи в таблице сделок, изменяющей позицию в дате поставки по первой части связки (первой сделки, зарегистрированной по результатам исполнения связки)
ncc_request_buy	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Покупатель): 0 – отсутствует, 1 – присутствует
ncc_request_sell	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Продавец): 0 – отсутствует, 1 – присутствует

Примечание:

1. Данные, формируемые по итогам клиринговых сессий, в отчете не отображаются (поля сохраняются, но будут пустые).

11.6. Отчет multilegf04cl_trade_XXYYZZZ.csv

Информация о связанных сделках клиентов в ДСВД, где XXYYZZZ – код раздела. Файл формата csv.

Структура отчета *multilegf04cl_trade_XXYYZZZ.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
id_deal	numeric(19)	Идентификационный номер сделки
isin	char(25)	Уникальный код инструмента связки
price1	numeric(16,5)	Цена первой части связанной сделки (в пунктах).
price	numeric(16,5)	Цена сделки (в пунктах).
vol	numeric(10)	Количество контрактов связки (в штуках)
rate	numeric(16,5)	Ставка. Используется для репо и пары сделок (в процентах годовых.
days	numeric(4)	Срок связки (в календарных днях). Используется для репо и пары сделок.
kod_sell	char(7)	Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке по связке, поданной Продавцом, на основании которой заключена связанная сделка
kod_rts_s	char(7)	Код продавца
kod_buy	char(7)	Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке по связке, поданной Покупателем, на основании которой заключена связанная сделка
kod_rts_b	char(7)	Код покупателя
date	char(10)	Дата регистрации связанной сделки
time	char(8)	Время регистрации связанной сделки
type_buy	numeric(2)	Тип связки Покупателя: 2 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки, 3 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании безадресной Заявки 4 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие
type_sell	numeric(2)	Тип связки Продавца: 2 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки, 3 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании безадресной Заявки 4 – для Связок с количеством Сделок равным 2, заключенных на основании адресной Заявки без указания контрагента, но с указанием уникального кода, выражающего взаимное согласие
signs_buy	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Покупателя. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
signs_sell	numeric(20)	Битовая маска признаков сделки Продавца. Полный аналог битовой маски признаков сделки в таблице сделок Plaza-2 шлюза (см. на ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf])
var_marg_b	numeric(16,2)	Вариационная маржа Покупателя по связанной сделке (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
var_marg_s	numeric(16,2)	Вариационная маржа Продавца по связанной сделке (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
user_sell	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Продавца по связанной сделке
user_buy	char(20)	Наименование логина (идентификатора) Покупателя по связанной сделке
no_buy	numeric(19)	Идентификационный номер Заявки по связке, поданной Покупателем, на основании которой заключена связанная сделка
no_sell	numeric(19)	Идентификационный номер Заявки по связке, поданной Продавцом, на основании которой заключена связанная сделка

Название поля	Тип поля	Описание поля
fee_buy	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_sell	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
date2	char(10)	Дата регистрации связанной сделки
comm_buy	char(20)	Комментарий в Заявке по связке, поданной Покупателем
comm_sell	char(20)	Комментарий в Заявке по связке, поданной Продавцом
fee_ns_b	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за связанную сделку, заключенную на основании адресной Заявки по связке, подлежащая уплате Покупателем (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_ns_s	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за связанную сделку, заключенную на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Продавцом (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
price_rur1	numeric(16,5)	Цена первой части связанной сделки в рублях
price_rur	numeric(16,5)	Цена сделки в рублях
ext_id_b	numeric(11)	Дополнительный идентификационный номер, указанный в Заявке по связке, поданной Покупателем
ext_id_s	numeric(11)	Дополнительный идентификационный номер, указанный в Заявке по связке, поданной Продавцом
date_clr	Date	Дата проведения клиринга *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_ex_b	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Покупателем (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_cc_b	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Покупателем (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_ex_s	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Продавцом (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
fee_cc_s	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Продавцом (в рублях РФ) *Не заполняется в случае ДСВД*
id_trade	numeric(19)	Идентификатор записи в таблице сделок, изменяющей позицию в дате поставки по первой части связки (первой сделки, зарегистрированной по результатам исполнения связки)
ncc_request_buy	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Покупатель): 0 – отсутствует, 1 – присутствует
ncc_request_sell	numeric(1)	Признак заключения Сделки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга (Продавец): 0 – отсутствует, 1 – присутствует

Примечание:

1. Данные, формируемые по итогам клиринговых сессий, в отчете не отображаются (поля сохраняются, но будут пустые).

11.7. Отчет fordlog_trade_XXYY.csv

Информация о принятых в ДСВД заявках по фьючесным контрактам по Брокерской фирме и ее клиентам, где XXYY – код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *fordlog_trade_XXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
N	i8	Порядковый номер выставленной заявки в пользовательской системе
id_ord	i8	Номер заявки в пользовательской системе, в случае айсберг заявки в этом поле будет номер всплывающей части айсберг-заявки

Название поля	Тип поля	Описание поля
sess_id	i4	Идентификатор торговой сессии
isin	char(25)	Код инструмента
amount	i8	Количество заявок в операции (используется значение из xamount)
amount_rest	i4	Оставшееся количество в заявке (используется значение из xamount_rest)
id_deal	numeric(19)	Идентификатор сделки по данной записи журнала заявок
xstatus	i8	Расширенный статус заявки
price	numeric(16,5)	Цена выставленной заявки
moment	datetime	Дата-время с точностью до наносекунд появления заявки
dir	i1	Направление заявки: 1 – покупка, 2 – продажа.
action	i1	Действие с заявкой: 0 – удаление, 1 – добавление, 2 - сведение в сделку.
remove_type	i4	Тип снятия/удаления/иная операция в отношении выставленной заявки: 0 – снятие заявки Участником торгов/или иная операция, 1 – удаление заявки администратором торгов по запросу Участника торгов, 2 – удаление заявки торговой системой.
deal_price	numeric(16,5)	Цена заключенной сделки по данной записи журнала заявок
client_code	char(7)	Код раздела клиринговых регистров
login_from	char(20)	Логин пользователя, поставившего заявку
comment	char(20)	Комментарий к заявке
ext_id	i4	Идентификатор заявки в пользовательской системе
broker_to	char(7)	Код раздела Брокерской фирмы, в адрес которой подана адресная заявка
broker_to_rts	char(20)	Код РТС Брокерской фирмы, в адрес которой подана адресная заявка. При выставлении адресной заявки без указания контрагента указывается код 'CCNC' центрального контрагента (Клиринговый центр)
broker_from_rts	char(20)	Код РТС Брокерской фирмы, от которой подана адресная заявка
date_exp	date	Дата истечения срока жизни многодневной заявки.
id_ord_first	i8	Номер первой заявки в последовательности при пере выставления заявки со сроком истечения
aspref	numeric(4)	Ссылка из таблицы user на мастер-логин Участника торгов
asp	char(20)	Логин Участника торгов из таблицы user (мастер-логин Участника)
private_amount	i8	Количество единиц инструмента в операции по Айсберг-заявке
private_amount_rest	i8	Оставшееся количество в Айсберг-заявке
private_order_id	i8	Номер Айсберг-заявки в системе
mm	i1	Признак заявки маркет-мейкера: 0 – обычная заявка, 1 – заявка, поданная в рамках выполнения обязательств маркет-мейкера
actualmm	i1	Проверка заявки маркет-мейкера:

Название поля	Тип поля	Описание поля
		0 – заявка не соответствует условиям выполнения обязательств маркет-мейкера по договору и/или регуляторным требованиям, 1 – заявка соответствует условиям выполнения обязательств маркет-мейкера по договору и/или регуляторным требованиям
match_ref	char(10)	Уникальное кодовое слово, выражающее взаимное согласие, для выставления двух встречных адресных заявок без указания контрагента
compliance_id	char(1)	Тип ввода заявки: • ' ' (пробел) или '' (пустая строка) – не заполнено/ не задано, • 'M' - Ручной ввод, • 'S' - В результате срабатывания условного поручения (стоп-лосс), • 'R' - В результате работы алгоритма-робота, • 'A' - В результате алгоритма автоследования, • 'D' - Закрытие позиции в результате не исполненного Маржинального требования.

Примечание:

1. Ссылка на спецификацию PLAZA II шлюз (ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf]).

11.8. Отчет oordlog_trade_XXYY.csv

Информация о принятых в ДСВД заявках по опционным контрактам по Брокерской фирме и ее клиентам, где XXYY – код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *oordlog_trade_XXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
N	i8	Порядковый номер выставленной заявки в пользовательской системе
id_ord	i8	Номер заявки в пользовательской системе, в случае айсберг заявки в этом поле будет номер всплывающей части айсберг-заявки
sess_id	i4	Идентификатор торговой сессии
isin	char(25)	Код инструмента
amount	i8	Количество заявок в операции (используется значение из xamount)
amount_rest	i4	Оставшееся количество в заявке (используется значение из xamount_rest)
id_deal	numeric(19)	Идентификатор сделки по данной записи журнала заявок
xstatus	i8	Расширенный статус заявки
price	numeric(16,5)	Цена выставленной заявки
moment	datetime	Дата-время с точностью до наносекунд появления заявки
dir	i1	Направление заявки: 1 – покупка, 2 – продажа.
action	i1	Действие с заявкой: 0 – удаление, 1 – добавление, 2 - сведение в сделку.
remove_type	i4	Тип снятия/удаления/иная операция в отношении выставленной заявки: 0 – снятие заявки Участником торгов/или иная операция,

Название поля	Тип поля	Описание поля
		1 – удаление заявки администратором торгов по запросу Участника торгов, 2 – удаление заявки торговой системой.
deal_price	numeric(16,5)	Цена заключенной сделки по данной записи журнала заявок
client_code	char(7)	Код раздела клиринговых регистров
login_from	char(20)	Логин пользователя, поставившего заявку
comment	char(20)	Комментарий к заявке
ext_id	i4	Идентификатор заявки в пользовательской системе
broker_to	char(7)	Код раздела Брокерской фирмы, в адрес которой подана адресная заявка
broker_to_rts	char(20)	Код РТС Брокерской фирмы, в адрес которой подана адресная заявка. При выставлении адресной заявки без указания контрагента указывается код 'CCNC' центрального контрагента (Клиринговый центр)
broker_from_rts	char(20)	Код РТС Брокерской фирмы, от которой подана адресная заявка
date_exp	date	Дата истечения срока жизни многодневной заявки.
id_ord_first	i8	Номер первой заявки в последовательности при пере выставления заявки со сроком истечения
aspref	numeric(4)	Ссылка из таблицы user на мастер-логин Участника торгов
asp	char(20)	Логин Участника торгов из таблицы user (мастер-логин Участника)
private_amount	i8	Количество единиц инструмента в операции по Айсберг-заявке
private_amount_rest	i8	Оставшееся количество в Айсберг-заявке
private_order_id	i8	Номер Айсберг-заявки в системе
mm	i1	Признак заявки маркет-мейкера: 0 – обычная заявка, 1 – заявка, поданная в рамках выполнения обязательств маркет-мейкера
actualmm	i1	Проверка заявки маркет-мейкера: 0 – заявка не соответствует условиям выполнения обязательств маркет-мейкера по договору и/или регуляторным требованиям, 1 – заявка соответствует условиям выполнения обязательств маркет-мейкера по договору и/или регуляторным требованиям
match_ref	char(10)	Уникальное кодовое слово, выражающее взаимное согласие, для выставления двух встречных адресных заявок без указания контрагента
compliance_id	char(1)	Тип ввода заявки: • ' ' (пробел) или '' (пустая строка) – не заполнено/ не задано, • 'M' - Ручной ввод, • 'S' - В результате срабатывания условного поручения (стоп-лосс), • 'R' - В результате работы алгоритма-робота, • 'A' - В результате алгоритма автосследования, • 'D' - Закрытие позиции в результате не исполненного Маржинального требования.

Примечание:

1. Ссылка на спецификацию PLAZA II шлюз (ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf]).

11.9. Отчет multilegordlog_trade_XXYY.csv

Лог действий по сведению и удалению в ДСВД заявок по связкам Участником клиринга (Участником торгов)/ Брокерской фирмой и их клиентами. Файл формата csv.

Структура отчета *multilegordlog_trade_XXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
numb_order	numeric(19)	Идентификационный номер Заявки по связке
isin	char(25)	Уникальный код инструмента связки
price	numeric(16,5)	Цена первой части Заявки по репо и пары сделок (в пунктах)
vol	numeric(10)	Количество контрактов в Заявке по связке (в штуках)
rate	numeric(16,5)	Ставка. Используется для репо и пары сделок (в процентах годовых) – не используется
days	numeric(4)	Срок связанной сделки (в календарных днях). Используется для репо и пары сделок.
rest_vol	numeric(10)	Количество контрактов в Заявке по связке, оставшееся в очереди после регистрации связанной сделки при частичном исполнении Заявки по связке
kod	char(7)	Код раздела клиринговых регистров по Идентификатору Участника клиринга / Брокерской фирмы / клиента
tip	numeric(1)	Тип Заявки: 1 – покупка, 2 – продажа
sost	numeric(1)	Действие с Заявкой по связке: 1 – объявление Заявки по связке, 2 – заключение связанной сделки на основании объявленной Заявки по связке, 0 – удаление Заявки по связке
(date)	char(10)	Дата действия с Заявкой по связке
(time)	char(8)	Время действия с Заявкой по связке
(user)	char(20)	Логин Участника торгов, выполнившего действие с Заявкой по связке
comment	char(20)	Комментарий в Заявке по связке
gate	numeric(1)	Признак использования Шлюза: 1 – действие с Заявкой по связке выполнено с использованием Шлюза, 0 – действие с Заявкой по связке выполнено без использования Шлюза
user_to	char(20)	Имя (наименование) Участника торгов, которому была адресована Заявка по связке (заполняется только для адресных заявок). При выставлении адресной заявки без указания контрагента указывается код 'CCNC' центрального контрагента (Клиринговый центр)
type	numeric(1)	Признак: 2 – адресная заявка на пару связанных сделок 3 – безадресная заявка на пару связанных сделок
date2	date	Дата действия с заявкой по связке
price_rur	numeric(16,5)	Цена первой части Заявки по репо и пары сделок (в рублях РФ).
ext_id	numeric(11)	Дополнительный идентификационный номер, указанный в Заявке по связке
date_exp	date	Дата окончания срока действия Заявки по связке
n_order1	numeric(19)	Идентификационный номер Заявки по связке при ее объявлении, до момента переноса Заявки по связке в следующие Торговые сессии
date_clr	date	Дата проведения клиринга – не используется
aspref	numeric(4)	Ссылка из таблицы user на мастер-логин Участника торгов
asp	char(20)	Логин Участника торгов из таблицы user (мастер-логин Участника)
ncc_request	numeric(1)	Признак выставления Заявки Клиринговым центром по запросу от Участника клиринга:

Название поля	Тип поля	Описание поля
		0 – отсутствует, 1 – присутствует
match_ref	char(10)	Уникальное кодовое слово, выражающее взаимное согласие, для выставления двух встречных адресных заявок без указания контрагента
compliance_id	char(1)	Тип ввода заявки: • ' ' (пробел) или '' (пустая строка) – не заполнено/ не задано, • 'M' - Ручной ввод, • 'S' - В результате срабатывания условного поручения (стоп-лосс), • 'R' - В результате работы алгоритма-робота, • 'A' - В результате алгоритма автоследования, • 'D' - Закрытие позиции в результате не исполненного Маржинального требования.

Примечание:

1. Ссылка на спецификацию PLAZA II шлюз (ftp://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf [https://ftp.moex.com/pub/ClientsAPI/Spectra/Docs/p2gate_ru.pdf]).

12. Пакет RFSYYYYMMDD.zip

Отчеты по сделкам RFS.

12.1. Отчет ind04_XXYY.csv

Информация о квазисделках Брокерской фирмы и её клиентов, где XXYY – код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *ind04_XXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
qdeal_id	numeric(20)	Идентификатор квазисделки
isin	char(25)	Уникальный код инструмента
qprice	numeric(16,5)	Цена квазисделки
qamount	numeric(10)	Количество инструментов в квазисделке
code	char(7)	Код раздела клиринговых регистров
qmoment	datetime	Дата-время заключения квазисделки
login_name	char(20)	Логин пользователя
quote_id	numeric(20)	Идентификатор индикативной котировки
comment	char(20)	Комментарий по квазисделке
ext_id	numeric(20)	Внешний номер квазисделки в пользовательской системе
date_clearing	datetime	Дата проведения клиринга
xstatus	numeric(20)	Статус квазисделки из битовой маски в соответствии Журнала котировок пользователя спецификации Шлюз Plaza-2 для OTC системы срочного рынка
active_side	numeric(1)	Направление пользователя, являющегося активной стороной: 1 – покупатель 2 – продавец
trading_mode	char(3)	Информация о режиме торгов, на основе которых были совершены квазисделки: – iqs – rfs
dir	char(4)	Принимает значение: – BUY – SELL

Примечание:

1. Предоставляется по итогам Клиринговой сессии в пакете отчетов RFSYYYYMMDD.zip, который подписывается сертификатом представителя ПАО Московская Биржа.

12.2. Отсчет indlink04_XXYY.csv

Информация о соответствии квазисделок фактически заключенным сделкам Брокерской фирмы и её клиентов, где XXYY – код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *indlink04_XXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
qdeal_id	numeric(20)	Идентификатор квазисделки
state	numeric(10)	Конечный статус квазисделки: 0 – квазисделка обрабатывается 1 – ожидается подтверждение от пассивной стороны 2 – подтверждение от пассивной стороны получено 3 – фактическая сделка не заключена по причине ошибки 4 – фактическая сделка заключена

Название поля	Тип поля	Описание поля
error_code	numeric(10)	Код ошибки в ОТС системе конечного статуса квазисделки: 1 – квазисделка не подтверждена 2 – ошибка при добавлении заявки для активной стороны 3 – ошибка при добавлении заявки для пассивной стороны 4 – заявка не найдена в Торговой системе 5 – таймаут сделки в Торговой системе 6 – Торговая система не доступна
spectra_error_code	numeric(10)	Код ошибки в Торговой системе конечного статуса квазисделки в соответствии со справочником кодов ошибок спецификации Шлюза SPECTRA Plaza-2и
isin	char(25)	Уникальный код инструмента
qprice	numeric(16,5)	Цена квазисделки
qamount	numeric(10)	Количество инструментов в квазисделке
code	char(7)	Код раздела клиринговых регистров
qmoment	datetime	Дата-время заключения квазисделки
login_name	char(20)	Логин пользователя
quote_id	numeric(20)	Идентификатор индикативной котировки
comment	char(20)	Комментарий по квазисделке
ext_id	numeric(20)	Внешний номер квазисделки в пользовательской системе
date_clearing	datetime	Дата проведения клиринга
active_side	numeric(1)	Направление пользователя, являющегося активной стороной: 1 – покупатель 2 – продавец
deal_id	numeric(20)	Идентификатор фактически заключенной сделки
price	numeric(16,5)	Цена фактически заключенной сделки
amount	numeric(10)	Объем фактически заключенной сделки
moment	datetime	Дата-время фактически заключенной сделки
trading_mode	char(3)	Информация о режиме торгов, на основе которых были совершены квазисделки: – iqs – rfs
dir	char(4)	Принимает значение: – BUY – SELL

Примечание:

1. Предоставляется по итогам Клиринговой сессии в пакете отчетов RFSYYYYMMDD.zip, который подписывается сертификатом представителя ПАО Московская Биржа.

12.3. Отсчет requests_XXYY.csv

Информация о котировках в запросах на ликвидность, выставленных по Брокерской фирме и её клиентам, где XXYY – код Брокерской фирмы. Файл формата csv.

Структура отчета *requests_XXYY.csv*:

Название поля	Тип поля	Описание поля
id_req	numeric(20)	Идентификатор запроса на ликвидность
sess_id	numeric(10)	Идентификатор торговой сессии
isin	char(25)	Уникальный код инструмента

Название поля	Тип поля	Описание поля
amount	numeric(20)	Количество котировок в запросе
dir	numeric(1)	Направление запроса: 1 – покупка 2 – продажа 3 – обе стороны
consumer_code	char(7)	Код раздела клиринговых регистров потребителя ликвидности (LC)
consumer_login	char(20)	Логин (идентификатор) потребителя ликвидности (LC)
provider_code	char(7)	Код провайдера (LP), который основан на коде раздела клиринговых регистров, которому был направлен запрос на ликвидность
public_consumer_cmnt	char(20)	Публичный комментарий потребителя ликвидности (LC)
private_consumer_cmnt	char(20)	Приватный комментарий потребителя ликвидности (LC)
time_start	datetime	Дата-время начала аукциона
time_end	datetime	Дата-время окончания аукциона
result	numeric(1)	Результат аукциона: 0 – поток пока не закрыт 1 – совершена сделка 2 – сделка не совершена по причине отсутствия средств у LC 3 – закрытие по запросу LC 4 – завершено по времени 5 – закрытие администратором торгов 6 – окончание торговой сессии

Примечание:

1. Предоставляется по итогам Клиринговой сессии в пакете отчетов RFSYYYYMMDD.zip, который подписывается сертификатом представителя ПАО Московская Биржа.