# Отчет об обязательствах/требованиях Участника клиринга (печатная форма)

# Отчет об обязательствах/требованиях (печатная форма)

|  |  |
| --- | --- |
| **Дата формирования отчета** |  |
| **Клиринговая организация (полное наименование НКО ЛЦК (АО))** |  |
| **Код Участника клиринга** |  |
| **Наименование Участника клиринга** |  |

**ФОНДОВАЯ СЕКЦИЯ**

Клиринговая сессия

|  |  |
| --- | --- |
| Идентификатор клиринговой сессии |  |
| Дата клиринга |  |
| Время клиринга |  |

Для каждого ТКР Участника клиринга (разделы 1,2,3):

|  |  |
| --- | --- |
| Код ТКР |  |

1. Обязательства, допущенные к клирингу

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Уникальный идентификатор сделки** | **Код ценной бумаги** | **Направленность сделки. Покупка (B) / продажа (S)** | **Дата регистрации сделки** | **Дата исполнения сделки** | **Цена за одну ценную бумагу, руб./%** | **НКД**  **на одну ценную бумагу,**  **руб.** | **НКД**  **на сделку,**  **руб.** | **Номинал облигации в руб.** | **Количество лотов в сделке** | **Лот** | **Количество ценных бумаг, шт.** | **Клиринговая комиссия, в рублях (справочно)** | **Торговая комиссия, в рублях**  **(справочно)** | **Обязательства/ требования по сделке по денежным средствам, руб. (-/+)** | **Обязательства/требования по сделке по ценным бумагам, шт.**  **(-/+)** | **Идентификатор контрагента** | **Краткий код клиента** | **Статус исполнения** |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

1. Обязательства, исключенные из клирингового пула

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Уникальный идентификатор сделки** | **Код ценной бумаги** | **Направленность сделки. Покупка (B) / продажа (S)** | **Дата регистрации сделки** | **Дата исполнения сделки** | **Цена за одну ценную бумагу, руб./%** | **НКД**  **на одну ценную бумагу,**  **руб.** | **НКД**  **на сделку,**  **руб.** | **Номинал облигации в руб.** | **Количество лотов в сделке** | **Лот** | **Количество ценных бумаг, шт.** | **Клиринговая комиссия, в рублях (справочно)** | **Торговая комиссия, в рублях**  **(справочно)** | **Обязательства/ требования по сделке по денежным средствам, руб. (-/+)** | **Обязательства/требования по сделке по ценным бумагам, шт.**  **(-/+)** | **Идентификатор контрагента** | **Краткий код клиента** | **Статус исполнения** |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

1. Сальдо обязательств/Сальдо требований для расчетов

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Сальдо обязательств/Сальдо требований, руб. (-/+)** |  | **Код ценной бумаги** | **Сальдо обязательств/Сальдо требований по ценной бумаге, шт. (-/+)** |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |

**СЕКЦИЯ ДЕНЕЖНОГО И ВАЛЮТНОГО РЫНКА**

Клиринговая сессия

|  |  |
| --- | --- |
| Идентификатор клиринговой сессии |  |
| Дата клиринга |  |
| Время клиринга |  |

Для каждого ТКР Участника клиринга (разделы 1,2,3):

|  |  |
| --- | --- |
| **Код ТКР** |  |

Сегмент рынка

**ВАЛЮТНЫЕ ИНСТРУМЕНТЫ**

1. Обязательства, допущенные к клирингу

| **Уникальный идентификатор сделки** | **Код инструмента/сделки** | **Идентификатор контрагента** | **Краткий код клиента** | **Направленность сделки. Покупка (B) / продажа (S)** | **Дата регистрации сделки** | **Дата исполнения сделки** | **Ед. валюты лота** | **Цена сделки в сопряженной валюте за единицу валюты лота** | **Количество лотов в сделке** | **Валюта лота** | **Сопряженная валюта** | **Стоимость сделки в валюте лота** | **Стоимость сделки в сопряженной валюте** | **Клиринговая комиссия в рублях (справочно)** | **Торговая комиссия в рублях**  **(справочно)** | **Обязательства/требования по сделке в валюте лота (-/+)** | **Обязательства/требования по сделке в сопряженной валюте (-/+)** | **Статус исполнения** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

2. Обязательства, исключенные из клирингового пула

| **Уникальный идентификатор сделки** | **Код инструмента/сделки** | **Идентификатор контрагента** | **Краткий код клиента** | **Направленность сделки. Покупка (B) / продажа (S)** | **Дата регистрации сделки** | **Дата исполнения сделки** | **Ед. валюты лота** | **Цена сделки в сопряженной валюте за единицу валюты лота** | **Количество лотов в сделке** | **Валюта лота** | **Сопряженная валюта** | **Стоимость сделки в валюте лота** | **Стоимость сделки в сопряженной валюте** | **Клиринговая комиссия в рублях (справочно)** | **Торговая комиссия в рублях**  **(справочно)** | **Обязательства/требования по сделке в валюте лота (-/+)** | **Обязательства/требования по сделке в сопряженной валюте (-/+)** | **Статус исполнения** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

3. Сальдо обязательств/Сальдо требований для расчетов

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Дата** | **Сальдо обязательств/Сальдо требований (-/+) в сопряженной валюте** |  |  | **Код валюты лота** | **Сальдо обязательств/Сальдо требований (-/+) в валюте лота** |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

Сегмент рынка

**ДЕПОЗИТЫ / КРЕДИТЫ**

1. Обязательства, допущенные к клирингу

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Уникальный идентификатор договора.** | **Код договора** | **Код инструмента** | **Наименование контрагента** | **Направленность договора. Покупка (B) / продажа (S)** | **Дата регистрации договора** | **Дата расчета** | **Дата возврата** | **Ставка, %** | **Стоимость договора. Указывается без учета комиссионного вознаграждения НКО ЛЦК (АО).** | **Клиринговая комиссия, в рублях (справочно)** | **Торговая комиссия, в рублях**  **(справочно)** | **Обязательства/требования по договору по денежным средствам, руб. (-/+)** | **Статус исполнения** |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

1. Обязательства, исключенные из клирингового пула

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Уникальный идентификатор договора.** | **Код договора** | **Код инструмента** | **Наименование контрагента** | **Направленность договора. Покупка (B) / продажа (S)** | **Дата регистрации договора** | **Дата расчета** | **Дата возврата** | **Ставка, %** | **Стоимость договора. Указывается без учета комиссионного вознаграждения НКО ЛЦК (АО).** | **Клиринговая комиссия, в рублях (справочно)** | **Торговая комиссия, в рублях**  **(справочно)** | **Обязательства/требования по договору по денежным средствам, руб. (-/+)** | **Статус исполнения** |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

1. Сальдо обязательств/Сальдо требований для расчетов

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Дата** | **Сальдо обязательств, руб.** | **Сальдо требований, руб.** |
|  |  |  |

Возврат депозитов / кредитов

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Уникальный идентификатор договора** | **Код договора** | **Наименование контрагента** | **Дата регистрации договора** | **Дата расчета** | **Дата возврата** | **Обязательства/требования по возврату, руб. (-/+)** | **Статус исполнения** |
|  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |

**Время формирования файла:**

**Уполномоченный сотрудник НКО ЛЦК (АО):**

# Отчет об обязательствах/требованиях Участника клиринга (формат отчета)

*Вид:*электронный документ

*Формат:* XML

*Наименование:* SPCEX\_DOC\_ KS\_TOTAL\_FIRMID\_LIABILITIES\_<ГГГГММДД>\_NNNNN.XML,

где <ГГГГММДД> - дата формирования файла,

<KS> - Клиринговая система,

< LIABILITIES > - Обязательства УК

<FIRMID > - Код УК,

<NNNNN> - номер файла по порядку

| **Название тегов** | **Название атрибутов** | **Описание** | **Обязательное** | **Тип** | **Размер** | **Десятичные знаки** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| SPCEX\_DOC |  | Корневой элемент XML документа | Да |  |  |  |
| DOCUMENT |  | Блок информации о документе | Да |  |  |  |
|  | AUTHOR | Автор документа (фамилия сотрудника) | Да | Character | 50 |  |
|  | DOC\_TIME | Время формирования файла ("13:47:28") | Да | Time |  |  |
|  | DOC\_DATE | Дата формирования файла ("28.02.2022") | Да | Date |  |  |
|  | DOC\_NAME | Название документа ("Отчет об обязательствах/ требованиях Участника клиринга") | Да | Character | 100 |  |
|  | OPER\_DATE | Дата операций | Да | Date |  |  |
|  | DOC\_TYPE | Тип документа ("KS\_FIRMID\_LIABILITIES") | Да | Character | 20 |  |
|  | DOC\_VER | Версия документа | Да | Character | 12 |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | DOC\_NUMBER | Наименование файла | Да | Character | 100 |  |
| /DOCUMENT |  | Завершение блока информации о документе |  |  |  |  |
| KS\_FIRMID\_LIABILITIES |  | Начало блока информации об обязательствах / требованиях УК |  |  |  |  |
|  | CLEARINGHOUSE | Клиринговая организация (полное наименование НКО ЛЦК (АО)) | Да | Character | 120 |  |
|  | FIRMID | Код Участника клиринга | Да | Character | 12 |  |
|  | FIRMNAME | Наименование Участника клиринга | Да | Character | 120 |  |
| MARKET |  | Блок рынка |  |  |  |  |
|  | MARKET | Рынок | Да | Character | 1 |  |
| SESSIONS |  | Клиринговые сессии (пул). Может быть 0 или несколько в течение дня. |  |  |  |  |
| SESSION |  | Клиринговая сессия (пул). |  |  |  |  |
|  | SESSION\_ID | Идентификатор клиринговой сессии | Да | Number | 10 |  |
|  | CLEARING\_DATE | Дата клиринга | Да | Date |  |  |
|  | CLEARING\_TIME | Время клиринга – это время проведения успешной сверки. | Да | Time |  |  |
| TKR |  | Группа ТКР УК |  |  |  |  |
|  | TRDACCID | Код ТКР | Да | Character | 12 |  |
|  | ACCOUNT | Денежный счет (в сопряженной валюте для валютных инструментов) | Да | Character | 35 |  |
|  | DEPO\_ACCOUNT | Счет депо | Нет | Character | 25 |  |
|  | CURRENCY | Идентификатор валюты расчётов (сопряженная валюта для валютных инструментов) | Да | Character | 3 |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
| ADMITTED\_TRADES |  | Допущенные к клирингу сделки (клиринговый пул) |  |  |  |  |
| TRADE |  | Информация по сделке |  |  |  |  |
|  | TR\_ID | Уникальный идентификатор сделки. | Да | Number | 11 |  |
|  | DEP\_AGR\_ID | Код договора формируется следующим образом:  <Код БИ>/<TradeDateTime>/<FirmId>/<TradeNum>,  где Код БИ – это Идентификатор договоров, TradeDateTime – текущая дата в формате ddmmyy, FirmId – Код Банка, TradeNum – номер сделки. | Нет | Character | 50 |  |
|  | SECURITYID | Код ценной бумаги/код БИ. | Да | Character | 12 |  |
|  | CPFIRMID | Идентификатор контрагента по сделке. | Нет | Character | 120 |  |
|  | RQ\_CLIENT\_CODE | Краткий код клиента | Нет | Character | ?? |  |
|  | TR\_BUYSELL | Направленность сделки. Покупка (B) / продажа (S) | Да | Character | 1 |  |
|  | TR\_DATE | Дата регистрации сделки | Да | Date |  |  |
|  | TR\_EXECDATE | Дата исполнения сделки | Да | Date |  |  |
|  | EXEC\_STATUS | Статусы: исполнен “Y”, не исполнен “N”, срок исполнения не наступил “W” | Нет | Character | 1 |  |
|  | REPAYM\_DATE | Только для СДВР. Дата возврата по депозиту/кредиту | Нет | Date |  |  |
|  | TR\_PRICE | Цена за одну ценную бумагу для ФС (руб. для акций, % для облигаций). Ставка для СДВР. | Да | Number | 10 | 4 |
|  | NOMINAL | Только для ФС. Номинал облигации в руб. | Нет | Number | 20 | 2 |
|  | LOT\_VALUE | Размер лота | Да | Number | 10 |  |
|  | TR\_LOT | Количество лотов в сделке | Да | Number | 10 |  |
|  | TR\_QUANTITY | Количество ценных бумаг/единиц валюты лота в штуках | Нет | Number | 20 |  |
|  | TR\_VALUE | Стоимость сделки (в сопряженной валюте для валютных инструментов). Указывается без учета комиссионного вознаграждения НКО ЛЦК (АО). | Да | Number | 20 | 2 |
|  | TR\_VALUE2 | Стоимость сделки в валюте лота для валютных инструментов. Указывается без учета комиссионного вознаграждения НКО ЛЦК (АО). | Нет | Number | 20 | 2 |
|  | LOT\_CURRENCY | Идентификатор валюты лота (только для валютных инструментов) | Нет | Character | 3 |  |
|  | LOT\_CURRENCY\_UNIT | Единиц валюты лота | Нет | Number | 20 |  |
|  | TR\_ACCRUEDINT | Только для ФС. Накопленный купонный доход на сделку, в рублях | Нет | Number | 20 | 2 |
|  | ACCRUEDINT | Только для ФС. Накопленный купонный доход на одну ценную бумагу, в рублях | Нет | Number | 20 | 2 |
|  | TR\_CLRCOMM | Клиринговая комиссия, в рублях | Нет | Number | 20 | 2 |
|  | TR\_EXHCOMM | Комиссия Биржи, в рублях | Нет | Number | 20 | 2 |
|  | CASH\_LIABILITY | Обязательства по сделке по денежным средствам, руб. | Да | Number | 20 | 2 |
|  | LOT\_CURRENCY\_ LIABILITY | Обязательства по сделке в валюте лота | Нет | Number | 20 | 2 |
|  | DEPO\_LIABILITY | Только для ФС. Обязательства по сделке по ценным бумагам, шт. | Нет | Number | 20 | 0 |
| /TRADE |  |  |  |  |  |  |
| /ADMITTED\_TRADES |  |  |  |  |  |  |
| EXCLUDED\_TRADES |  | Исключенные из пула сделки (необеспеченные) |  |  |  |  |
| TRADE |  |  |  |  |  |  |
|  | TR\_ID | Уникальный идентификатор сделки. | Да | Number | 11 |  |
|  | DEP\_AGR\_ID | Код договора формируется следующим образом:  <Код БИ>/<TradeDateTime>/<FirmId>/<TradeNum>,  где Код БИ – это Идентификатор договоров, TradeDateTime – текущая дата в формате ddmmyy, FirmId – Код Банка, TradeNum – номер сделки. | Нет | Character | 50 |  |
|  | SECURITYID | Код ценной бумаги/код БИ. | Да | Character | 12 |  |
|  | CPFIRMID | Идентификатор контрагента по сделке. | Нет | Character | 120 |  |
|  | RQ\_CLIENT\_CODE | Краткий код клиента | Нет | Character | ?? |  |
|  | TR\_BUYSELL | Направленность сделки. Покупка (B) / продажа (S) | Да | Character | 1 |  |
|  | TR\_DATE | Дата регистрации сделки | Да | Date |  |  |
|  | TR\_EXECDATE | Дата исполнения сделки | Да | Date |  |  |
|  | EXEC\_STATUS | Статусы: исполнен “Y”, не исполнен “N”, срок исполнения не наступил “W” | Нет | Character | 1 |  |
|  | REPAYM\_DATE | Только для СДВР. Дата возврата по депозиту/кредиту | Нет | Date |  |  |
|  | TR\_PRICE | Цена за одну ценную бумагу для ФС (руб. для акций, % для облигаций). Ставка для СДВР. | Да | Number | 10 | 4 |
|  | NOMINAL | Только для ФС. Номинал облигации в руб. | Нет | Number | 20 | 2 |
|  | LOT\_VALUE | Размер лота | Да | Number | 10 |  |
|  | TR\_LOT | Количество лотов в сделке | Да | Number | 10 |  |
|  | TR\_QUANTITY | Количество ценных бумаг/единиц валюты лота в штуках | Нет | Number | 20 |  |
|  | TR\_VALUE | Стоимость сделки (в сопряженной валюте для валютных инструментов). Указывается без учета комиссионного вознаграждения НКО ЛЦК (АО). | Да | Number | 20 | 2 |
|  | TR\_VALUE2 | Стоимость сделки в валюте лота для валютных инструментов. Указывается без учета комиссионного вознаграждения НКО ЛЦК (АО). | Нет | Number | 20 | 2 |
|  | LOT\_CURRENCY | Идентификатор валюты лота (только для валютных инструментов) | Нет | Character | 3 |  |
|  | LOT\_CURRENCY\_UNIT | Единиц валюты лота | Нет | Number | 20 |  |
|  | TR\_ACCRUEDINT | Только для ФС. Накопленный купонный доход на сделку, в рублях | Нет | Number | 20 | 2 |
|  | ACCRUEDINT | Только для ФС. Накопленный купонный доход на одну ценную бумагу, в рублях | Нет | Number | 20 | 2 |
|  | TR\_CLRCOMM | Клиринговая комиссия, в рублях | Нет | Number | 20 | 2 |
|  | TR\_EXHCOMM | Комиссия Биржи, в рублях | Нет | Number | 20 | 2 |
|  | CASH\_LIABILITY | Обязательства по сделке по денежным средствам, руб. | Да | Number | 20 | 2 |
|  | LOT\_CURRENCY\_ LIABILITY | Обязательства по сделке в валюте лота | Нет | Number | 20 | 2 |
|  | DEPO\_LIABILITY | Только для ФС. Обязательства по сделке по ценным бумагам, шт. | Нет | Number | 20 | 0 |
| /TRADE |  |  |  |  |  |  |
| /EXCLUDED\_TRADES |  |  |  |  |  |  |
| REPAYMENTS |  |  |  |  |  |  |
| TRADE |  |  |  |  |  |  |
|  | TR\_ID | Уникальный идентификатор сделки. | Да | Number | 11 |  |
|  | DEP\_AGR\_ID | Код договора формируется следующим образом:  <Код БИ>/<TradeDateTime>/<FirmId>/<TradeNum>,  где Код БИ – это Идентификатор договоров, TradeDateTime – текущая дата в формате ddmmyy, FirmId – Код Банка, TradeNum – номер сделки. | Нет | Character | 50 |  |
|  | FIRMNAME | Наименование контрагента по сделке. | Нет | Character | 120 |  |
|  | TR\_DATE | Дата регистрации сделки | Да | Date |  |  |
|  | TR\_EXECDATE | Дата исполнения сделки | Да | Date |  |  |
|  | REPAYM\_DATE | Только для СДВР. Дата возврата по депозиту/кредиту | Нет | Date |  |  |
|  | CASH\_LIABILITY | Обязательства по сделке по денежным средствам, руб. | Да | Number | 20 | 2 |
|  | EXEC\_STATUS | Статусы: исполнен “Y”, не исполнен “N”, срок исполнения не наступил “W” | Нет | Character | 1 |  |
| /TRADE |  |  |  |  |  |  |
| /REPAYMENTS |  |  |  |  |  |  |
| NETTO |  | Сальдо обязательств по сделкам пула в рублях |  |  |  |  |
|  | TR\_EXECDATE | Дата исполнения сделки | Да | Date |  |  |
|  | CASH\_NETTO | Сальдо обязательств, руб. | Да | Number | 20 | 2 |
|  | REQ\_NETTO | Сальдо требований, руб.  Только для депозитов. | Да | Number | 20 | 2 |
|  |  |  |  |  |  |  |
| CURRENCY\_LIABILITIES |  | Сальдо обязательств по сделкам пула в валютах лота |  |  |  |  |
|  | LOT\_CURRENCY | Идентификатор валюты лота (только для валютных инструментов) | Нет | Character | 3 |  |
|  | CURRENCY\_NETTO | Сальдо обязательств в валюте лота | Да | Number | 20 | 2 |
|  |  |  |  |  |  |  |
| /CURRENCY \_LIABILITIES |  |  |  |  |  |  |
| DEPO\_LIABILITIES |  | Сальдо обязательств по сделкам пула в ценных бумагах |  |  |  |  |
|  | SECURITYID | Код ценной бумаги | Нет | Character | 12 |  |
|  | DEPO\_NETTO | Сальдо обязательств по ценной бумаге, шт. | Нет | Number | 20 |  |
| /DEPO\_LIABILITIES |  |  |  |  |  |  |
| /NETTO |  |  |  |  |  |  |
| /TKR |  |  |  |  |  |  |
| /SESSION |  |  |  |  |  |  |
| /SESSIONS |  |  |  |  |  |  |
| / MARKET |  |  |  |  |  |  |
| /KS\_FIRMID\_LIABILITIES |  |  |  |  |  |  |
| /SPCEX\_DOC |  |  |  |  |  |  |