Утверждено

приказом Генерального директора

АО «Центр передовых финансовых технологий»

от «17» октября 2024 года № 7

**ФОРМЫ ОТЧЕТОВ О ВНЕБИРЖЕВЫХ ДОГОВОРАХ**

**АО «Центр передовых финансовых технологий»**

Москва, 2024 г.

Оглавление

[Форматы XML документов 3](#_Toc181212948)

[Пролог XML документа 3](#_Toc181212949)

[Элементы XML документа 3](#_Toc181212950)

[Атрибуты элементов XML документа 4](#_Toc181212951)

[Условные обозначения 4](#_Toc181212952)

[Типы данных 4](#_Toc181212953)

[Документы ЭДО в формате XML 4](#_Toc181212954)

[Спецификация форматов отчетов 6](#_Toc181212955)

[TEH03 Реестр Внебиржевых договоров, переданных на клиринг 6](#_Toc181212956)

[TEH21 Статистические показатели по Внебиржевым договорам 12](#_Toc181212957)

[BE03. Реестр Внебиржевых договоров, переданных на клиринг 16](#_Toc181212958)

[BE21. Статистические показатели по Внебиржевым договорам 21](#_Toc181212959)

[Требования к формированию Имени файлов для электронного документооборота между клиентом и Техническим центром 24](#_Toc181212960)

# Форматы XML документов

Обмен информацией между клиентским и серверным приложениями происходит сообщениями в формате XML версии 1.0. Полная спецификация языка XML версии 1.0 приводится в документе Extensible Markup Language (XML) 1.0 (Second Edition), разработанном W3C и опубликованном в сети Интернет адресу [http://www.w3.org/TR/REC-xml.](http://www.w3.org/TR/REC-xml)

В главе приводится краткое описание структуры XML документа версии 1.0.

# Пролог XML документа

Пролог XML документа предназначен для описания глобальных параметров XML документа, а также для передачи инструкций программе обработки данного документа. Пролог может содержать несколько инструкций, каждая из которых начинается с последовательности символов **<?** и заканчивается последовательностью символов **?>** Первой строкой пролога всегда идёт объявление XML с указанием кодировки символов, используемых в документе.

*Пример пролога:*

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

<?xml-stylesheet type='text/xsl' href='form\_individual.xsl'?>

, где первая строка – это объявление XML с указанием используемой кодовой таблицы, вторая строка – инструкция программе

обработки сообщения.

**Ограничение**: кодировка документа должна быть исключительно “UTF-8”.

# Элементы XML документа

Каждый XML документ содержит один или несколько элементов, границы которых обозначаются либо парой начальный тэг (<elem>) - конечный тэг (</elem>), либо тэгом пустого элемента (<elem />), если элемент не имеет содержимого. Содержимым элемента называется текст между начальным и конечным тегами. Каждый элемент имеет определенный тип, который опознается по имени и называется "общим идентификатором" элемента. Тип элемента в конечном тэге должен соответствовать типу элемента в начальном тэге. Каждый элемент может иметь набор спецификаций атрибутов. Каждая спецификация атрибута имеет имя и значение. Имя атрибута в начальном тэге или тэге пустого элемента может присутствовать только один раз.

*Пример непустого элемента без атрибутов:*

<elem> содержание элемента </elem>

*Пример пустого элемента с двумя атрибутами:*

<elem attr1=”значение атрибута 1” attr2=”значение атрибута 2” />

Документ XML всегда содержит один единственный корневой элемент, который включает в себя любое число других элементов.

Каждый элемент может содержать любое количество других элементов. Такие документы называются дочерними элементами по отношению к данному элементу.

*Пример дочернего элемента:*

<parent>

<child> содержание дочернего элемента </child>

</parent>

# Атрибуты элементов XML документа

Каждый элемент может содержать любое количество атрибутов. Атрибуты предназначены для передачи дополнительной информации об элементе. Атрибуты могут располагаться только в начальных тегах и тегах пустых элементов сразу после имени элемента в виде пар атрибут – значение. Значения атрибутов не могут содержать символов левая угловая скобка (<), правая угловая скобка (>),амперсанд (&), апостроф (‘) и двойная кавычка (“). Данные символы кодируются последовательностями “&lt;”, “&gt;”, “&amp;”, “&apos;”, “&quot;” соответственно.

Пример пустого элемента с атрибутом:

<elem attr=”значение атрибута” />

# Условные обозначения

В таблицах, описывающих прикладные и служебные элементы, в колонке **M/O** символ **M** означает, что соответствующий атрибут или подэлемент является обязательным, а символ **O** – что необязательным. Если какой-либо элемент не указывается, то его атрибуты также не указываются, даже если помечены как обязательные.

В колонке **Rev** указывается номер версии спецификации отчетов, в котором введен в действие данный элемент/атрибут.

# Типы данных

|  |  |
| --- | --- |
| **Тип** | **Описание** |
| Integer | Целочисленное значение |
| Boolean | Логическое значение (True или False) |
| Numeric(M,N) | Вещественное значение с фиксированной точкой |
| Char | Один символ (символы кириллицы не допускаются) |
| String(M-N) | Строковое значение (символы кириллицы не допускаются)M-минимально допустимое число символов. Если не указано, то поле фиксированной длины N-максимально допустимое число символов |
| WString(M-N) | Строковое значение, включая символы кириллицыM-минимально допустимое число символов. Если не указано, то поле фиксированной длиныN-максимально допустимое число символов |
| Date | Дата. Строка в формате: DD-MM-YYYY |
| Time | Время. Строка в формате: ss:hh:mm |
| DateTime | Дата и время. Строка в формате: DD-MM-YYYY ss:hh:mm |

# Документы ЭДО в формате XML

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

Каждое сообщение ЭДО (включая отчеты BE) имеет следующую структуру

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

# Спецификация форматов отчетов

## TEH03 Реестр Внебиржевых договоров, переданных на клиринг

Формируется по итогам последнего периода времени, в течение которого могут направляться Оферты ОТС.

Для Внебиржевых договоров репо ОТС показываются обе части.

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Название элемента** | **Название атрибута** | **Описание** | **M/O** | **Тип** |
| RTS\_DOC |  | Корневой элемент (root element) XML документа. | М |  |
| DOC\_REQUISITES |  | Блок информации о документе: | М |  |
|  | DOC\_DATE | Дата формирования документа. | M | Date |
|  | DOC\_TIME | Время формирования документа. | M | Time |
|  | DOC\_NO | Уникальный учетный номер документа | M | String(0-20) |
|  | DOC\_TYPE\_ID | **REPORT** | M | String(0-20) |
|  | SENDER\_ID | Код отправителя в системе ЭДО: **CPFT** | M | String(3-7) |
|  | SENDER\_NAME | Краткое наименование отправителя. | О | WString(0-512) |
|  | RECEIVER\_ID | Код ЭДО получателя. | M | String(3-7) |
|  | REMARKS | Текст примечания к документу. Документ, не содержащий информации содержит текст «На отчетную дату данных нет». | О | WString(0-120) |
| /DOC\_REQUISITES |  |  | M |  |
| REPORT |  | Блок данных отчета: | M |  |
| DOC\_INFO |  |  |  |  |
|  | ReportLang | RU/ EN | M | String(0-2) |
|  | ReportCode | **TEH03** | M | String(0-20) |
|  | ReportDate | Дата отчета. | M | Date |
|  | ReportDesc | Описание отчета. | O | WString(0-128) |
|  | ReportVersion | Версия формата отчета. | O | String(1-3) |
|  | Weekday | День недели для даты отчета. | O | WString(0-20) |
|  | FirmId | Идентификатор Участника клиринга. | M | String(0-16) |
|  | FirmName | Наименование Участника клиринга. | M | WString(0-120) |
|  | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
|  | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
|  | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC\_INFO |  |  |  |  |
| CLRACC |  | Блок данных по ТКС. | M |  |
|  | ClrAccCode | Код ТКС. | M | String(0-12) |
| SUBCLRACC |  | Блок данных по подразделу ТКС | M |  |
|  | SubClrAccCode | Код подраздела ТКС | O | String(0-16) |
| CURRENCY |  | Блок данных о ценной бумаге | M |  |
|  | CurrencyId | Валюта номинала | M | String(0-12) |
|  | CurrencyName | Наименование валюты цены. | O | WString(0-30) |
| BOARD |  | Блок данных по группе инструментов ОТС: | M |  |
|  | BoardId | Идентификатор инструментов ОТС:**OTC** - Инструменты ОТС. | M | String(0-16) |
|  | BoardName | Наименование инструментов ОТС:* Инструменты ОТС.
 | O | WString(0-128) |
| SETTLEDATE |  | Блок данных по дате расчётов: | M |  |
|  | SettleDate | Фактическая дата расчётов (дата исполнения). | M | Date |
| SECURITY |  | Блок данных по инструменту: | M |  |
|  | SecurityId | Идентификатор инструмента. | M | String(0-32) |
|  | SecShortName | Краткое наименование инструмента. | M | WString(0-256) |
|  | ISIN | Международный идентификатор инструмента. | O | String(0-32) |
|  | RegNumber | Государственный регистрационный номер. | O | WString(0-64) |
|  | FaceValue | Номинал. | O | Numeric(28,8) |
|  | SecCurrencyId | Валюта номинала. | O | String(0-12) |
|  | SecurityType | Категория ЦБ:1. - Акции обыкновенные.
2. - Акции привилегированные.
3. Пай открытого ПИФ.

104 - Пай закрытого ПИФ. 105 - ETF.1. - RDR.
2. - ADR.
3. - GDR.
4. - Пай интервального ПИФ.
5. – Ипотечный Вексель (Mortgage Note).

201 - Государственные Облигации.202 - Муниципальные Облигации.203 – Облигации Центрального Банка. 204 - Корпоративные Облигации.205 – Облигации Кредитной Организации. 206 – Биржевые Облигации. | O | Integer |
|  | PriceType | CASH - цена указана в валюте расчетов.PERC - цена указана в процентах от номинала. | M | String(0-4) |
| RECORDS |  | Блок данных по Внебиржевому договору. | M |  |
|  | RecNo | Номер по порядку в отчете. | M | Integer |
|  | TradeNo | Номер договора в Программном обеспечении. | M | Integer |
|  | TradeNoExtra | Дополнительный номер Внебиржевого договора. | O | Integer |
|  | TradeDate | Дата регистрации Внебиржевого договора. | M | Date |
|  | TradeTime | Время регистрации Внебиржевого договора в Программном обеспечении. | M | Time |
|  | PrimaryOrderID | Идентификатор Оферты ОТС, присвоенныйПрограммным обеспечением. | O | Integer |
|  | OrderID | Дополнительный идентификатор Оферты ОТС. | O | Integer |
|  | OrderType | Тип Заявки: •    рыночная Заявка (MARKET) = 1.•    лимитная Заявка (LIMIT) = 2.•    адресная Заявка (NEGOTIATED) = 103.•    Заявка дополнительной ликвидности заявка (OUT-OF-BOOK) = 104.•    Заявка аукциона закрытия (CLOSING\_AUCTION)= 123.•    Оффсетная Заявка (CLOSING\_OFFSET) = 124.•    Котировочная Заявка (PROTO\_RFQ\_INITIATE) = 125.•    Не котировочная Заявка (PROTO\_RFQ\_CONFIRM)= 126 | O | Integer |
|  | UserId | Логин из Оферты ОТС. | O | String(0-16) |
|  | Comment | Комментарий. | O | WString(0-64) |
|  | BuySell | Направленность Оферты ОТС (покупка (**B**) / продажа (**S**)). | M | Char |
|  | SettleCode | Код срока расчетов | O | String(0-16) |
|  | TradeType | Тип Внебиржевого договора:**T** – заключен на основании Оферты ОТС без указанияИдентификатора Участника клиринга, присвоенный Участнику клиринга, который может направить связанную Оферту ОТС. **N** – заключен на основании Оферты ОТС с указаниемИдентификатора Участника клиринга, присвоенный Участнику клиринга, который может направить связанную Оферту ОТС.**D** – заключен без подачи Оферты ОТС. | O | Char |
|  | TradeInstrumentType | Тип торгового инструмента:3 – инструменты с частичным обеспечением 4 – Внебиржевой договор репо ОТС5 – связанные договоры купли-продажи9 – инструменты с полным обеспечением | O | Integer |
|  | TradeModeId | Режим заключения договоров (номер режима):* 13 – Заключение Внебиржевых договоров с передачей на клиринг
 | O | Integer |
|  | TradeModeName | Наименование режима заключения Внебиржевыхдоговоров:* Заключение Внебиржевых договоров с передачей на клиринг.
 | O | WString(0-128) |
|  | Decimals | Число значимых знаков после запятой в ценах | O | Integer |
|  | Price | Цена за единицу инструмента. | M | Numeric(28,8) |
|  | Quantity | Объём договора, в лотах. | M | Numeric(28,8) |
|  | Value | Объём договора, в валюте цены. | M | Numeric(28,8) |
|  | Amount | Обязательство по денежным средствам, в валюте расчетов. | O | Numeric(28,8) |
|  | Balance | Обязательство по ценным бумагам. | M | Numeric(28,8) |
|  | ClientDetails | ИНН или № паспорта клиента или иной код. | O | WString(0-256) |
|  | CcpCode | Код Центрального Контрагента. | O | String(0-16) |
|  | CPFirmId | Идентификатор контрагента. | O | String(0-16) |
|  | CPFirmShortName | Краткое наименование контрагента. | O | WString(0-256) |
|  | OtcCodeInitiator | Идентификатор Участника клиринга, присвоенный Участнику клиринга, который может направить Оферту ОТС. | O | String(0-16) |
|  | OtcCodeConfirmator | Идентификатор Участника клиринга, присвоенный Участнику клиринга, который может направить связанную Оферту ОТС. | O | String(0-16) |
|  | ClientCode | Краткий код клиента или клиента клиента участника клиринга | O | WString(0-16) |
|  | AccInt | Накопленный купонный доход, рассчитанный в соответствии с количеством актива договора, в валюте цены. | O | Numeric(28,8) |
|  | Price2 | Цена второй части Внебиржевого договора репо ОТС | O | Numeric(28,8) |
|  | RepoRate | Ставка Внебиржевого договора репо ОТС | O |  Numeric(28,8) |
|  | RepoPart | Часть Внебиржевого договора репо ОТС1. – первая часть Внебиржевого договора договора репо ОТС
2. – вторая часть Внебиржевого договора договора репо

ОТС | O | Integer |
|  | RepoPeriod | Срок Внебиржевого договора репо ОТС в календарных днях | O | Integer |
|  | Type | Тип Внебиржевого договора, заключенного в целях урегулирования неисполнения обязательств или исполнения обязательств по договорам с частичным обеспечением:1. – договор Внебиржевого договора репо ОТС в случае неисполнения обязательств Участником клиринга;
2. договор купли-продажи в случае неисполнения обязательств Участником клиринга;
3. – договор репо в случае неисполнения обязательств Клиринговым центром;
4. – договор купли-продажи в случае неисполнения обязательств Клиринговым центром;
5. – договор репо, заключенный Клиринговым центром с целью привлечения активов для урегулирования неисполнения обязательств;

6– договор купли-продажи, заключенный Клиринговым центром с целью принудительного закрытия позиции Участника клиринга; | O | Integer |
|  | StampDuty  | Эквивалент транзакционного налога | O | Numeric(28,8) |
|  | StampDutyPrice  | Цена закрытия, использованная в расчете эквивалента Транзакционного налога по сделке | O | Numeric(28,8) |
| /RECORDS |  |  | M |  |
| /BOARD |  |  | M |  |
| /SECURITY |  |  | M |  |
| /SETTLEDATE |  |  | M |  |
| /CURRENCY |  |  | M |  |
| /SUBCLRACC |  |  | M |  |
| /CLRACC |  |  | M |  |
| /REPORT |  |  | M |  |
| /RTS\_DOC |  |  | M |  |

## TEH21 Статистические показатели по Внебиржевым договорам

Формируется по итогам последнего периода времени, в течение которого могут направляться Оферты ОТС

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Название элемента** | **Название атрибута** | **Описание** | **M/O** | **Тип** |
| RTS\_DOC |  | Корневой элемент (root element) XML документа. | М |  |
| DOC\_REQUISITES |  | Блок информации о документе: | М |  |
|  | DOC\_DATE | Дата формирования документа. | M | Date |
|  | DOC\_TIME | Время формирования документа. | M | Time |
|  | DOC\_NO | Уникальный учетный номер документа в системе ЭДО. | M | String(0-20) |
|  | DOC\_TYPE\_ID | REPORT | M | String(0-20) |
|  | SENDER\_ID | Код отправителя в системе ЭДО:**CPFT** | M | String(3-7) |
|  | SENDER\_NAME | Краткое наименование отправителя. | О | WString(0-512) |
|  | RECEIVER\_ID | Код ЭДО получателя. | M | String(3-7) |
|  | REMARKS | Текст примечания к документу. | О | WString(0-120) |
| /DOC\_REQUISITES |  |  | M |  |
| REPORT |  |  |  |  |
| DOC\_INFO |  | Блок данных отчета: | M |  |
|  | ReportLang | RU/ EN | M | String(0-2) |
|  | ReportCode | TEH21 | M | String(0-20) |
|  | TradeDate | Дата отчета. | M | Date |
|  | ReportDesc | Описание отчета. | O | WString(0-512) |
|  | ReportVersion | Версия формата отчета. | O | String(1-3) |
|  | Weekday | День недели для даты отчета. | O | WString(0-20) |
|  | Volume | Номер тома отчета | O | Integer |
|  | VolumeTotal | Всего томов в отчете | O | Integer |
|  | ReportNumber | Сквозной номер отчета, единый для всех томов отчета | O | String(0-20) |
| /DOC\_INFO |  |  |  |  |
| BOARD |  | Блок данных об Инструментах ОТС | M |  |
|  | BoardId | Идентификатор группы инструментов:**OTC** - Инструменты ОТС. | M | String(0-16) |
|  | BoardName | Наименование блока инструментов ОТС. | M | WString(0-128) |
| SECURITY |  | Блок данных о ценной бумаге: |  |  |
|  | SecurityId | Идентификатор (код) инструмента. | M | String(0-32) |
|  | SecShortName | Краткое наименование инструмента. | M | WString(0-256) |
|  | ISIN | Международный идентификатор инструмента (ISIN). | O | String(0-32) |
|  | RegNumber | Государственный регистрационный номер выпуска. | O | WString(0-64) |
|  | FaceValue | Номинал. | O | Numeric(28,8) |
|  | SecCurrencyId | Валюта номинала инструмента. | O | String(0-12) |
|  | SecurityType | Вид и тип ЦБ:* Акции обыкновенные.
* Акции привилегированные.
* Пай открытого ПИФ.
* Пай закрытого ПИФ.
* ETF.
* RDR.
* ADR.
* GDR.
* Пай интервального ПИФ.
* Ипотечный Вексель.
* Государственные Облигации.
* Муниципальные Облигации.
* Облигации Центрального Банка.
* Корпоративные Облигации.
* Облигации Кредитной Организации.
* Биржевые Облигации.
 | O | WString(0-128) |
|  | IssuerName | Наименование эмитента. | O | WString(0-512) |
|  | IssuerDetails | ИНН эмитента (управляющей компании). | O | String(0-256) |
|  | Decimal | Число значимых знаков после запятой в ценах. | O | Integer |
|  | CurrencyId | Валюта номинала | M | String(0-12 |
|  | CurrencyName | Наименование валюты цены. | O | String(0-30) |
|  | AccruedInterest | Для облигаций - НКД на дату отчета. | O | Numeric(28,8) |
| TRADE\_PERIOD |  | Блок данных о о периоде передачи оферт ОТС: | M |  |
|  | TradePeriod | Торговая сессия:* MAIN – Основная торговая сессия.
* EVE – Дополнительная вечерняя торговая сессия.
* MORN – Дополнительная утренняя торговая сессия.
 | M | String(0-4) |
| MARKET\_TRADE |  | Статистические показатели о договорах, заключенных на основании оферты ОТС без указания Идентификатора Участника клиринга, присвоенный Участнику клиринга, который может направить связанную Оферту ОТС: | M |  |
|  | SettType | Код срока расчетов | M | String(0-4) |
|  | TradeMode | Идентификатор порядка заключения договоров | M | WString(0-128) |
|  | PeriodTotalAmount | Общее количество ценных бумаг по заключенным Внебиржевым договорам, шт. | O | Numeric(28,8) |
|  | PeriodTotalVolume | Объём договоров (в валюте цены) | O | Numeric(28,8) |
|  | PeriodTotalCount | Общее количество заключенных Внебиржевых договоров, шт. | O | Numeric(28,8) |
|  | PeriodOpenPrice | Цена первого договора в валюте цены | O | Numeric(28,8) |
|  | PeriodOpenVolume | Объем первого договора в валюте цены | O | Numeric(28,8) |
|  | PeriodLastPrice | Цена последнего договора в валюте цены | O | Numeric(28,8) |
|  | PeriodLastVolume | Объем последнего договора в валюте цены | O | Numeric(28,8) |
|  | PeriodMaxDealPrice | Максимальная цена договора за период | O | Numeric(28,8) |
|  | PeriodMinDealPrice | Минимальная цена договора за период | O | Numeric(28,8) |
|  | PeriodWAPrice | Средневзвешенная цена, валюта цены. | O | Numeric(28,8) |
| /MARKET\_TRADE |  |  |  |  |
| ADDRESS\_TRADE |  | Статистические показатели о договорах, заключенных на основании оферты ОТС с указанием Идентификатора Участника клиринга, присвоенный Участнику клиринга,который может направить связанную Оферту ОТС: | M |  |
|  | SettType | Код срока расчетов | M | String(0-4) |
|  | TradeMode | Идентификатор порядка заключения договоров | M | WString(0-128) |
|  | AddressPeriodTotalAmount | Общее количество ценных бумаг по заключенным Внебиржевым договорам, шт. | O | Numeric(28,8) |
|  | AddressPeriodTotalVolume | Общий объём Внебиржевых договоров, валюта цены | O | Numeric(28,8) |
|  | AddressPeriodTotalCount | Общее количество заключенных Внебиржевых договоров, шт. | O | Numeric(28,8) |
|  | AddressPeriodOpenPrice | Цена первого договора в валюте цены | O | Numeric(28,8) |
|  | AddressPeriodOpenVolume | Объем первого договора в валюте цены | O | Numeric(28,8) |
|  | AddressPeriodLastPrice | Цена последнего договора в валюте цены | O | Numeric(28,8) |
|  | AddressPeriodLastVolume | Объем последнего договора в валюте цены | O | Numeric(28,8) |
|  | AddressPeriodMaxDealPrice | Максимальная цена договора за период | O | Numeric(28,8) |
|  | AddressPeriodMinDealPrice | Минимальная цена договора за период | O | Numeric(28,8) |
|  | AddressPeriodWAPrice | Средневзвешенная цена, валюта цены. | O | Numeric(28,8) |
| /ADDRESS\_TRADE |  |  |  |  |
| /TRADE\_PERIOD |  |  |  |  |
| RESULT |  | Блок данных об итоговых ценах: | M |  |
|  | TotalAmount | Общее количество ценных бумаг по заключенным Внебиржевым договорам, шт. | O | Numeric(28,8) |
|  | TotalVolume | Общий объём Внебиржевых договоров , валюта цены. | O | Numeric(28,8) |
|  | TotalDealCount  | Общее число Внебиржевых договоров за день, заключенных на основании оферт ОТС без указания Идентификатора Участника клиринга, присвоенного Участнику клиринга, который может направить связанную Оферту ОТС | O | Numeric(20,0) |
|  | MaxDealPrice | Максимальная цена договора за день | O | Numeric(28,8) |
|  | MinDealPrice | Минимальная цена договора за день | O | Numeric(28,8) |
|  | ClosePrice | Цена закрытия дня валюта цены. | O | Numeric(28,8) |
|  | PrevClose | Цена закрытия предыдущего дня, валюта цены. | O | Numeric(28,8) |
|  | TrendClose | Изменение цены закрытия дня по сравнению с ценой закрытия предыдущего дня, %. | O | Numeric(28,8) |
|  | WAPrice | Средневзвешенная цена, валюта цены. | O | Numeric(28,8)  |
|  | ClearingPrice | Расчетная цена, предоставленная Клиринговой организацией. | O | Numeric(28,8) |
| /RESULT |  |  |  |  |
| /SECURITY |  |  |  |  |
| /BOARD |  |  |  |  |
| /REPORT |  |  |  |  |

## BE03. Реестр Внебиржевых договоров, переданных на клиринг

* Формируется по итогам последнего периода времени, в течение которого могут направляться Оферты ОТС
* Для Внебиржевых договоров репо ОТС показываются обе части

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Название элемента** | **Название атрибута** | **Описание** | **M/O** | **Тип** |
| RTS\_DOC |  | Корневой элемент (root element) XML документа. | М |  |
| DOC\_REQUISITES |  | Блок информации о документе: | М |  |
|  | DOC\_DATE | Дата формирования документа. | M | Date |
|  | DOC\_TIME | Время формирования документа. | M | Time |
|  | DOC\_NO | Уникальный учетный номер документа | M | String(0-20) |
|  | DOC\_TYPE\_ID | Всегда **BE03.** | M | String(0-20) |
|  | SENDER\_ID | Код отправителя в системе ЭДО (**CPFT**). | M | String(3-7) |
|  | SENDER\_NAME | Краткое наименование отправителя. | О | WString(0-120) |
|  | RECEIVER\_ID | Код ЭДО получателя. | M | String(3-7) |
|  | REMARKS | Текст примечания к документу. Документ, несодержащий информации содержит текст «На отчетную дату данных нет». | О | WString(0-120) |
| /DOC\_REQUISITES |  |  | M |  |
| BE03 |  | Блок данных отчета: | M |  |
|  | ReportDate | Дата отчета. | M | Date |
|  | ReportDesc | Описание отчета. | O | WString(0-128) |
|  | ReportVersion | Версия формата отчета. | O | String(1-3) |
|  | Weekday | День недели для даты отчета. | O | WString(0-20) |
|  | FirmId | Идентификатор Участника клиринга. | M | String(0-16) |
|  | FirmName | Наименование Участника клиринга. | M | WString(0-120) |
|  | FirmINN | ИНН Участника клиринга. | O | String(0-12) |
| CLRACC |  | Блок данных по ТКС. | M |  |
|  | ClrAccCode | Код ТКС. | M | String(0-12) |
| CURRENCY |  | Блок данных о ценной бумаге | M |  |
|  | CurrencyId | Валюта номинала | M | String(0-4) |
|  | CurrencyName | Наименование валюты цены. | O | WString(0-30) |
| BOARD |  | Блок данных по группе инструментов ОТС: | M |  |
|  | BoardId | Идентификатор инструментов ОТС:**OTC** - Инструменты ОТС. | M | String(0-15) |
|  | BoardType | Номер инструментов ОТС:**7** - Инструменты ОТС. | O | Integer |
|  | BoardName | Наименование инструментов ОТС:* Инструменты ОТС.
 | O | WString(0-30) |
| SETTLEDATE |  | Блок данных по дате расчётов: | M |  |
|  | SettleDate | Фактическая дата расчётов (дата исполнения). | M | Date |
| SECURITY |  | Блок данных по инструменту: | M |  |
|  | SecurityId | Идентификатор инструмента. | M | String(0-32) |
|  | SecShortName | Краткое наименование инструмента. | M | WString(0-64) |
|  | ISIN | Международный идентификатор инструмента. | O | String(0-20) |
|  | RegNumber | Государственный регистрационный номер. | O | WString(0-64) |
|  | FaceValue | Номинал. | O | Numeric(20,2) |
|  | SecCurrencyId | Валюта номинала. | O | String(0-3) |
|  | SecurityType | Категория ЦБ:1. - Акции обыкновенные.
2. - Акции привилегированные. 103 - Пай открытого ПИФ.

104 - Пай закрытого ПИФ. 105 - ETF.1. - RDR.
2. - ADR.
3. - GDR.
4. - Пай интервального ПИФ.
5. – Ипотечный Вексель (Mortgage Note).

201 - Государственные Облигации. 202 - Муниципальные Облигации.203 – Облигации Центрального Банка. 204 - Корпоративные Облигации.205 – Облигации Кредитной Организации. 206 – Биржевые Облигации. | O | Integer |
|  | PriceType | CASH - цена указана в валюте расчетов.PERC - цена указана в процентах от номинала. | M | String(0-4) |
| RECORDS |  | Блок данных по Внебиржевому договору. | M |  |
|  | RecNo | Номер по порядку в отчете. | M | Integer |
|  | TradeNo | Номер договора в Программном обеспечении. | M | Integer |
|  | TradeNoExtra | Дополнительный номер Внебиржевого договора. | M | Integer |
|  | TradeDate | Дата регистрации Внебиржевого договора. | M | Date |
|  | TradeTime | Время регистрации Внебиржевого договора вПрограммном обеспечении. | M | Time |
|  | PrimaryOrderID | Идентификатор Оферты ОТС, присвоенныйПрограммным обеспечением. | O | Integer |
|  | OrderID | Дополнительный идентификатор Оферты ОТС. | O | Integer |
|  | UserId | Логин из Оферты ОТС. | O | String(0-16) |
|  | Comment | Комментарий. | O | WString(0-64) |
|  | BuySell | Направленность Оферты ОТС (покупка (**B**) / продажа (**S**)). | M | Char |
|  | SettleCode | Код срока расчетов-Е. | O | String(0-12) |
|  | TradeType | Тип Внебиржевого договора:**T** – заключен на основании Оферты ОТС без указанияИдентификатора Участника клиринга, присвоенный Участнику клиринга, который может направить связанную Оферту ОТС. **N** – заключен на основании Оферты ОТС с указаниемИдентификатора Участника клиринга, присвоенный Участнику клиринга, который может направить связанную Оферту ОТС.**D** – заключен без подачи Оферты ОТС. | O | Char |
|  | TradeInstrumentType | Тип торгового инструмента:3 – инструменты с частичным обеспечением 4 – Внебиржевой договор репо ОТС5 – связанные договоры купли-продажи 9 – инструменты с полным обеспечением | M | Integer |
|  | TradeModeId | Режим заключения договоров (номер режима):* 13 – Заключение Внебиржевых договоров с передачей на клиринг
 | M | Integer |
|  | TradeModeName | Наименование режима заключения Внебиржевых | M | WString(0-64) |
|  |  | договоров:* Заключение Внебиржевых договоров с передачей на клиринг.
 |  |  |
|  | Decimals | Число значимых знаков после запятой в ценах | O | Integer |
|  | Price | Цена за единицу инструмента. | M | Numeric(20,6) |
|  | Quantity | Объём договора, в лотах. | M | Numeric(20,0) |
|  | Value | Объём договора, в валюте цены. | M | Numeric(20,2) |
|  | Amount | Обязательство по денежным средствам, в валютерасчетов. | O | Numeric(20,2) |
|  | Balance | Обязательство по ценным бумагам. | M | Numeric(20,0) |
|  | ClientDetails | ИНН или № паспорта клиента или иной код. | O | WString(0-41) |
|  | CcpCode | Код Центрального Контрагента. | O | String(0-16) |
|  | CCPShortName | Идентификатор Центрального Контрагента. | O | WString(0-256) |
|  | CCPDetails | ИНН Центрального Контрагента. | O | String(0-12) |
|  | CPFirmId | Идентификатор контрагента. | O | String(0-16) |
|  | CPFirmShortName | Краткое наименование контрагента. | O | WString(0-256) |
|  | CPFirmDetails | ИНН контрагента (для договоров, заключенных на основании оферты ОТС с указанием Идентификатора Участника клиринга, присвоенный Участнику клиринга,который может направить связанную Оферту ОТС) | O | String(0-12) |
|  | OtcCodeInitiator | Идентификатор Участника клиринга, присвоенный Участнику клиринга, который может направить ОфертуОТС. | O | String(0-16) |
|  | OtcCodeConfirmator | Идентификатор Участника клиринга, присвоенныйУчастнику клиринга, который может направить связанную Оферту ОТС. | O | String(0-16) |
|  | ClientCode | Краткий код клиента или клиента клиента участникаклиринга | O | WString(0-16) |
|  | AccInt | Накопленный купонный доход, рассчитанный в соответствии с количеством актива договора, в валютецены. | O | Numeric(20,2) |
|  | Price2 | Цена второй части Внебиржевого договора репо ОТС | O | Numeric(20,6) |
|  | RepoRate | Ставка Внебиржевого договора репо ОТС | O | Integer |
|  | RepoPart | Часть Внебиржевого договора репо ОТС1. – первая часть Внебиржевого договора договора репо ОТС
2. – вторая часть Внебиржевого договора договора репо

ОТС | O | Integer |
|  | RepoPeriod | Срок Внебиржевого договора репо ОТС в календарныхднях | O | Integer |
|  | Type | Тип Внебиржевого договора, заключенного в целях урегулирования неисполнения обязательств или исполнения обязательств по договорам с частичным обеспечением:1. – договор Внебиржевого договора репо ОТС в случае неисполнения обязательств Участником клиринга;
2. – договор купли-продажи в случае неисполнения обязательств

Участником клиринга;1. – договор репо в случае неисполнения обязательств Клиринговым центром;
2. – договор купли-продажи в случае неисполнения обязательств Клиринговым центром;
3. – договор репо, заключенный Клиринговым центром с целью привлечения активов для урегулирования неисполнения обязательств; **6** – договор купли-продажи, заключенный Клиринговым центром с целью принудительного закрытия позиции Участника клиринга;
 | O | Integer |
|  | StampDuty  | Эквивалент транзакционного налога | O | Numeric(20,2) |
|  | StampDutyPrice  | Цена закрытия, использованная в расчете эквивалента Транзакционного налога по сделке | O | Numeric(20,8) |
| /RECORDS |  |  | M |  |
| /BOARD |  |  | M |  |
| /SECURITY |  |  | M |  |
| /SETTLEDATE |  |  | M |  |
| /CURRENCY |  |  | M |  |
| /SUBCLRACC |  |  | M |  |
| /CLRACC |  |  | M |  |
| /BE03 |  |  | M |  |
| /RTS\_DOC |  |  | M |  |

## BE21. Статистические показатели по Внебиржевым договорам

* Формируется по итогам последнего периода времени, в течение которого могут направляться Оферты ОТС

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Название элемента** | **Название атрибута** | **Описание** | **M/O** | **Тип** |
| RTS\_DOC |  | Корневой элемент (root element) XML документа. | М |  |
| DOC\_REQUISITES |  | Блок информации о документе: | М |  |
|  | DOC\_DATE | Дата формирования документа. | M | Date |
|  | DOC\_TIME | Время формирования документа. | M | Time |
|  | DOC\_NO | Уникальный учетный номер документа в системе ЭДО. | M | String(0-20) |
|  | DOC\_TYPE\_ID | Всегда BE21. | M | String(0-20) |
|  | SENDER\_ID | Код отправителя в системе ЭДО (**CPFT**). | M | String(3-7) |
|  | SENDER\_NAME | Краткое наименование отправителя. | О | WString(0-120) |
|  | RECEIVER\_ID | Код ЭДО РТС получателя. | M | String(3-7) |
|  | REMARKS | Текст примечания к документу. | О | WString(0-120) |
| /DOC\_REQUISITES |  |  | M |  |
| BE21 |  | Блок данных отчета: | M |  |
|  | TradeDate | Дата отчета. | M | Date |
|  | ReportDesc | Описание отчета. | O | WString(0-128) |
|  | ReportVersion | Версия формата отчета. | O | String(1-3) |
|  | Weekday | День недели для даты отчета. | O | WString(0-20) |
| BOARD |  | Блок данных о Инструментов ОТС | M |  |
|  | BoardId | Идентификатор группы инструментов:**OTC** - Инструменты ОТС. | M | String(0-15) |
|  | BoardType | Номер группы инструментов:**8 -** Инструменты ОТС. | M | Integer |
|  | BoardName | Наименование блока инструментов ОТС. | M | WString(0-64) |
| SECURITY |  | Блок данных о ценной бумаге: |  |  |
|  | SecurityId | Идентификатор (код) инструмента. | M | String(0-32) |
|  | SecShortName | Краткое наименование инструмента. | M | WString(0-64) |
|  | ISIN | Международный идентификатор инструмента (ISIN). | O | String(0-20) |
|  | RegNumber | Государственный регистрационный номер выпуска. | O | WString(0-64) |
|  | FaceValue | Номинал. | O | Numeric(20,2) |
|  | SecCurrencyId | Валюта номинала инструмента. | O | String(0-3) |
|  | SecurityType | Вид и тип ЦБ:* Акции обыкновенные.
* Акции привилегированные.
* Пай открытого ПИФ.
* Пай закрытого ПИФ.
* ETF.
 | O | WString(0-128) |
|  |  | * RDR.
* ADR.
* GDR.
* Пай интервального ПИФ.
* Ипотечный Вексель.
* Государственные Облигации.
* Муниципальные Облигации.
* Облигации Центрального Банка.
* Корпоративные Облигации.
* Облигации Кредитной Организации.
* Биржевые Облигации.
 |  |  |
|  | IssuerName | Наименование эмитента. | O | WString(0-255) |
|  | IssuerDetails | ИНН эмитента (управлящей компании). | O | String(0-32) |
|  | Decimal | Число значимых знаков после запятой в ценах. | O | Integer |
|  | CurrencyId | Валюта номинала | M | String(3) |
|  | CurrencyName | Наименование валюты цены. | O | String(0-32) |
|  | AccruedInterest | Для облигаций - НКД на дату отчета. | O | Numeric(20,2) |
| TRADE\_PERIOD |  | Блок данных о о периоде передачи оферт ОТС: | M |  |
| MARKET\_TRADE |  | Статистические показатели о договорах, заключенных на основании оферты ОТС без указания Идентификатора Участника клиринга, присвоенный Участнику клиринга,который может направить связанную Оферту ОТС: | M |  |
|  | SettType | Код срока расчетов | M | String(0-4) |
|  | TradeMode | Идентификатор порядка заключения договоров | M | WString(0-32) |
|  | PeriodTotalAmount | Общее количество ценных бумаг по заключеннымВнебиржевым договорам, шт. | M | Numeric(20,0) |
|  | PeriodTotalVolume | Объём договоров (в валюте цены) | M | Numeric(20,2) |
|  | PeriodTotalCount | Общее количество заключенных Внебиржевыхдоговоров, шт. | M | Numeric(20,0) |
|  | PeriodOpenPrice | Цена первого договора в валюте цены | M | Numeric(20,2) |
|  | PeriodOpenVolume | Объем первого договора в валюте цены | M | Numeric(20,2) |
|  | PeriodLastPrice | Цена последнего договора в валюте цены | M | Numeric(20,2) |
|  | PeriodLastVolume | Объем последнего договора в валюте цены | M | Numeric(20,2) |
|  | PeriodMaxDealPrice | Минимальная цена договора за период | O | Numeric(20,2) |
|  | PeriodMinDealPrice | Максимальная цена договора за период | O | Numeric(20,2) |
|  | PeriodWAPrice | Среневзвешенная цена, валюта цены. | M | Numeric(20,2) |
| /MARKET\_TRADE |  |  |  |  |
| ADDRESS\_TRADE |  | Статистические показатели о договорах, заключенных на основании оферты ОТС с указанием Идентификатора Участника клиринга, присвоенный Участнику клиринга,который может направить связанную Оферту ОТС: | M |  |
|  | SettType | Код срока расчетов | M | String(0-4) |
|  | TradeMode | Идентификатор порядка заключения договоров | M | WString(0-32) |
|  | AddressPeriodTotalAmount | Общее количество ценных бумаг по заключеннымВнебиржевым договорам, шт. | M | Numeric(20,0) |
|  | AddressPeriodTotalVolume | Общий объём Внебиржевых договоров, валюта цены | M | Numeric(20,2) |
|  | AddressPeriodTotalCount | Общее количество заключенных Внебиржевыхдоговоров, шт. | M | Numeric(20,0) |
|  | AddressPeriodOpenPrice | Цена первого договора в валюте цены | M | Numeric(20,2) |
|  | AddressPeriodOpenVolume | Объем первого договора в валюте цены | M | Numeric(20,2) |
|  | AddressPeriodLastPrice | Цена последнего договора в валюте цены | M | Numeric(20,2) |
|  | AddressPeriodLastVolume | Объем последнего договора в валюте цены | M | Numeric(20,2) |
|  | AddressPeriodMaxDealPrice | Минимальная цена договора за период | O | Numeric(20,2) |
|  | AddressPeriodMinDealPrice | Максимальная цена договора за период | O | Numeric(20,2) |
|  | AddressPeriodWAPrice | Среневзвешенная цена, валюта цены. | M | Numeric(20,2) |
| /ADDRESS\_TRADE |  |  |  |  |
| /TRADE\_PERIOD |  |  |  |  |
| RESULT |  | Блок данных об итоговых ценах: | M |  |
|  | TotalAmount | Общее количество ценных бумаг по заключеннымВнебиржевым договорам, шт. | O | Numeric(20,0) |
|  | TotalVolume | Общий объём Внебиржевых договоров , валюта цены. | O | Numeric(20,2) |
|  | TotalDealCount \* | Общее число Внебиржевых договоров за день, заключенных на основании оферт ОТС без указания Идентификатора Участника клиринга, присвоенного Участнику клиринга, который может направитьсвязанную Оферту ОТС | O | Numeric(20,0) |
|  | MaxDealPrice | Минимальная цена договора за день | O | Numeric(20,2) |
|  | MinDealPrice | Максимальная цена договора за день | O | Numeric(20,2) |
|  | ClosePrice | Цена закрытия дня валюта цены. | M | Numeric(20,2) |
|  | PrevClose | Цена закрытия предыдущего дня, валюта цены. | O | Numeric(20,2) |
|  | TrendClose | Изменение цены закрытия дня по сравнению с ценойзакрытия предыдущего дня, %. | O | Numeric(20,2) |
|  | WAPrice | Средневзвешенная цена, валюта цены. | O | Numeric(20,2) |
|  | ClearingPrice | Расчетная цена, предоставленная Клиринговойорганизацией. | O | Numeric(20,4) |
| /RESULT |  |  |  |  |
| /SECURITY |  |  |  |  |
| /BOARD |  |  |  |  |
| /BE21 |  |  |  |  |

# Требования к формированию Имени файлов для электронного документооборота между клиентом и Техническим центром

 Технический центр CPFT использует адрес ЭДО XXX\_REPORT, где XXX уникальный набор символов идентифицирующий Организатора торгов

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Наименование Документа (Вид документа)** | **Маска/Префикс для документа от АО «Центр передовых финансовых технологий»** | **Пояснения** |
| **Отчеты по Внебиржевым договорам:** TEH03 Реестр внебиржевых договоров, переданных на клиринг.TEH21 Статистические показатели по Внебиржевым договорам | **TEH\_ГГГГ-ММ-ДД** | Архив с отчетами |
| Дополнительная рассылка (при необходимости) | TEH\_REPORT\_<YYYYMMDD> | Архив с отчетами |
| **Отчеты по Внебиржевым договорам:**BE03 Реестр внебиржевых договоров, переданных на клиринг.BE21 Статистические показатели по Внебиржевым договорам | BE\_ГГГГ-ММ-ДД | Архив с отчетами |
| Дополнительная рассылка (при необходимости) | BE\_REPORT\_<YYYYMMDD> | Архив с отчетами |