

Изменения в клиринговые отчеты на фондовом рынке:

1. Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (EQM06)

- меняется порядок заполнения поля Туре;
- поле Туре заполняется значениями 2, 6, 7, 9 только для Недобросовестного участника клиринга:

Действующее значение	Новое значение	Комментарий
1 – сделка РЕПО/ своп в случае неисполнения обязательств Участником Клиринга	1 - сделка РЕПО / две сделки купли-продажи / сделка своп в случае неисполнения обязательств Участником клиринга	Типы 1 и 2 объединяются в тип 1 (режимы TADM, NADM, SADM на ФР, режим AETS на ВР)
2 – сделка купли-продажи в случае неисполнения обязательств Участником Клиринга		
-	2 - закрывающая сделка в отношении Недобросовестного Участника клиринга на основании заявки, поданной НКЦ	Новый тип
3 - сделка РЕПО в случае неисполнения обязательств Клиринговым центром	3 - сделка РЕПО / две сделки купли-продажи / сделка своп в случае неисполнения обязательств Клиринговым центром	Типы 3 и 4 объединяются в тип 3 (режимы TADM, NADM, SADM на ФР, режим AETS на ВР)
4 - сделка купли-продажи в случае неисполнения обязательств Клиринговым центром		
-	4 – балансирующая сделка с Добросовестным участником клиринга (без подачи заявки)	Новый тип
5 – сделка РЕПО Клирингового центра	5 – сделка РЕПО Клирингового центра (донорская сделка РЕПО)	Без изменений
-	6 - закрывающая сделка в отношении Недобросовестного Участника клиринга в рамках процедуры кросс-дефолта	Новый тип
-	7 - закрывающая сделка в отношении Недобросовестного Участника клиринга в связи с неисполнением Маржинального требования	Новый тип
	9 - закрывающая сделка в отношении Недобросовестного Участника клиринга без подачи заявки	Новый тип

- в случае заключения участниками сделок в дополнительную торговую вечернюю сессию, такие сделки будут отражаться в одном из дополнительных отчетов EQM06/ EQM6D/ EQM6C, предоставляемых после 23:50.

2. Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (для номинальных держателей) (EQM6D)

- из отчета для номинальных держателей исключается информация о сделках с финансовыми инструментами, которые не подлежат депозитарному учету, т.е. о сделках урегулирования своп.

3. Отчет о комиссионных вознаграждениях (EQM15)

- в ноду RECORDS добавляется поле SettleDate – «Дата исполнения обязательств по уплате комиссии». Дата в поле «SettleDate» будет совпадать с датой в поле «ReportDate», за исключением TRANTYPE=191 (Штрафа за заключение закрывающих сделок). Для TRANTYPE=191 поле SettleDate будет заполняться Расчетным днем, следующим за датой «ReportDate». В дату списания TRANTYPE=191 не будет повторно включаться в EQM15;

- время предоставления EQM15 переносится с 20:30 на 23:50. (В 20:30 сейчас EQM15 отражается комиссия по сделкам, заключенным после 19:00 – сделкам урегулирования НКЦ). Время предоставления EQM15 в 19:00 по сделкам, заключенным до 19:00, не меняется. В EQM15 в 23:50 будет комиссия по сделкам, заключенным после 19:00 – сделкам участников в дополнительную торговую вечернюю сессию.

- Комиссия по сделкам урегулирования НКЦ отменяется с даты релиза.

4. Отчет о переданных профилях активов на фондовом рынке (EQM49)

- в ноду TCS добавляется поле MainTrdAcclId, которое для TCS = EQ будет отражать динамику профилей ценных бумаг в разрезе Торгово-клиринговых счетов (поле MAINTRDACCID из таблицы TRDACC).

5. Отчет об обязательствах по передаче/ требованиях по получению Дохода (EQM98)

- в ноду RECORDS добавляется обязательное поле SettleDate – «Дата исполнения обязательств по передаче Дохода», которое будет заполняться, начиная с Даты генерации сделок по передаче Дохода и по Дату выплаты включительно. Для Расчетного дня по валюте и для рублей SettleDate – это текущая дата, а для нерасчетного дня по валюте – это ближайшая расчетная в валюте передачи Дохода дата.

6. Отчет об обязательствах по Сделкам Т+ (EQM23)

- время формирования отчета EQM23 переносится на после 23:50. В случае выхода Расчетного кода из торгов в 19:00 отчет EQM23 будет предоставляться в соответствии с текущим порядком (~20:30).

7. Отчет об обеспечении (EQM99)

- из отчета исключается информация о денежных средствах, учитываемых на РК 1-го уровня;

- время предоставления EQM99 по РК Единого Пула возвращается на 20:30 (с текущего 23:50);

- отчет получает номер EQM99_C01;

- после появления РК 2-го/ РК 3-го уровня и ТКС 2-го / ТКС 3-го в рамках разделения статусов УК и УТ, после 23:50 будет предоставляться EQM99 с информацией о «виртуальном» обеспечении на таких РК/ТКС с номером EQM99_C02.

8. Отчета о премии (EQM97)

- время формирования переносится на 23:50.

Изменения в клиринговые отчеты на валютном рынке:

1. Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (ССХ43)

- в ноду RECORDS добавляется поле Type, по аналогии с одноименным отчетом фондового рынка EQM06, для отражения типа сделок, заключенных в целях урегулирования неисполнения обязательств. Принимает следующие значения:

- 1 – сделка своп в случае неисполнения обязательств Участником клиринга;
- 2 – закрывающая сделка в отношении Недобросовестного Участника клиринга на основании заявки, поданной НКЦ;
- 3 – сделка своп в случае неисполнения обязательств Клиринговым центром;
- 4 – балансирующая сделка с Добросовестным участником клиринга (без подачи заявки);
- 6 – закрывающая сделка в отношении Недобросовестного Участника клиринга в рамках процедуры кросс-дефолта;
- 7 – закрывающая сделка в отношении Недобросовестного Участника клиринга в связи с неисполнением Маржинального требования;
- 9 – закрывающая сделка в отношении Недобросовестного Участника клиринга без подачи заявки

2. Отчет о комиссионных вознаграждениях (ССХ10)

- в ноду RECORDS добавляется поле SettleDate – «Дата исполнения обязательств по уплате комиссии». Дата в поле «SettleDate» будет совпадать с датой в поле «ReportDate», за исключением TRANTYPE=191 (Штрафа за заключение закрывающих сделок). Для TRANTYPE=191 поле SettleDate будет заполняться Расчетным днем, следующим за датой «ReportDate». В дату списания TRANTYPE=191 не будет повторно включаться в ССХ10;
- из ноды SETTLE1 удаляется поле NccRealAccount.