

Отчеты

1. Отчет об имуществе, внесенном в имущественные пулы

НКЦ формирует «Отчет об имуществе, внесенном в имущественные пулы» EQM45 и направляет Участнику клиринга после проведения утренней клиринговой сессии. Отчет содержит информацию о ТКС ИП Участника клиринга, входящих в их состав Расчетных кодах и субсчетах депо, и о ТКС Т+, связанных с ТКС ИП. По каждому ТКС ИП отчет включает в себя:

- информацию об активах, внесенных Участником клиринга в имущественный пул, включая их количество и оценочную стоимость;
- номинальную стоимость выданных КСУ;
- информацию о наличии и величине Маржинального требования по пулу.

2. Отчет о нормативной стоимости КСУ

Для всех участников пула формируется «Отчет о нормативной стоимости клиринговых сертификатов участия» EQM46.

Отчет содержит по каждому клиринговому пулу следующую информацию:

- об общей номинальной стоимости всех выданных КСУ;
- величину дисконта (Н) по клиринговым сертификатам участия.

3. Отражение в клиринговых отчетах обязательств по сделкам РЕПО с КСУ

В отчете «Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг» EQM06 отражается информация о сделках РЕПО с КСУ.

В «Отчете об Итоговых нетто-обязательствах / нетто-требованиях» EQM13 и «Отчете об обязательствах по Сделкам с частичным обеспечением» EQM23 обязательства по сделкам РЕПО с КСУ учитываются в составе нетто-обязательств по Сделкам Т+.

В «Отчете об Обеспечении» EQM99 по торговым разделам Т+ отражаются новые операции «выдача / погашение КСУ» (код операции 22), операции по внесению и выдаче имущества из имущественного пула в разрезе Расчетных кодов имущественного пула и субсчетов депо соответствуют кодам операций 1,2,4:

- 1 – внесение / возврат обеспечения через НРД или НКЦ;
- 2 – внесение / возврат обеспечения через Клиринговую систему Участником клиринга;
- 2 – внесение / возврат обеспечения через Клиринговую систему по инициативе Клирингового центра при исполнении обязательств.

4. Отражение в торговых отчетах обязательств по сделкам РЕПО с КСУ

По торговым отчетам сделки РЕПО с КСУ попадают в выписку из реестра заявок SEM02 и в выписку из реестра сделок SEM03.

5. Отчетность НРД

Название отчета	Формат	Канал передачи
«По результатам подбора» (в ответ на поручение 18/get)	Ответ веб-сервиса REST на запрос order.get в формате xml. Формат описан в Технических рекомендациях НРД по веб-сервису REST	Web-service
MS18G	Будет приведен в Спецификациях ЭДО НРД. Стандартный: dbf+rpt.	ЭДО (эл.почта), Отчет зашифрован на ключах получателя
MS101, переводы по результатам подбора	Приведен Спецификациях ЭДО НРД . Приложение №3. Стандартный: dbf+rpt.	ЭДО (эл.почта), Отчет зашифрован на ключах получателя
MS18M, отчет по поручению на маркирование		
Форма AS090, информация по открытым субсчетам		
MS140 – переводы по результатам торговой сессии		
GS001 – отчет по результатам ошибочного подбора		
IS40K (код операции 40, вид запроса К), IS41K (код операции 41, вид запроса К) - стандартные отчеты об остатках ценных бумаг на субсчетах депо, переданных в имущественный пул		