**Торговые и клиринговые отчеты рынка депозитов**

Этот документ содержит краткое описание торговых и клиринговых xml-отчётов, которые будут рассылаться участникам рынка депозитов.

Полное описание структуры XML отчётов и сопутствующая техническая информация (XSD-схемы, XSLT-стили и XML-примеры для разработчиков) доступны на сайте Московской Биржи:

Торговые отчеты: <http://moex.com/s267>

Клиринговые отчеты: <http://moex.com/s334>

Базовые сведения о работе с XML отчётами Московской Биржи доступны по ссылке "Порядок работы с XML-отчётами" на вышеуказанных страницах.

**Торговые отчёты:**

Всем Участникам торгов со статусом "Депонент" по итогам каждого торгового дня рассылаются следующие торговые отчеты:

1. SEM02D: "Выписка из реестра заявок на заключение депозитных договоров".

2. SEM03D: "Выписка из реестра предложений". Рассылается по итогам сведения заявок в день формирования отчета.

3. SEM04D: "Выписка из реестра сделок по депозитным договорам". Включает информацию только по тем сделкам, по первым частям которых в день формирования отчета произошли успешные расчеты.

**Клиринговые отчёты:**

1. EQM4D: Отчет о требованиях и обязательствах по депозитным договорам.

Отчет формируется по итогам клиринговой сессии в 20:00.

В отчете отражается следующая информация:

- в дату заключения депозитных договоров отражается сумма по фактически заключенным депозитным договорам (отрицательное значение), являющаяся обязательством по внесению депозита;

- по всем датам исполнения отражаются суммы, подлежащие возврату по заключенным депозитным договорам, являющиеся требованием по возврату депозита.

2. EQM35: Уведомление об обязательствах по уплате отступного.

В случае возникновения у участника рынка депозитов обязательств по уплате отступного – уведомление высылается до 19:15 дня начисления отступного. Обязательства отражаются в отчете для каждой неисполненной технической заявки / заявки с кодом Y0/Y1, при этом в поле Systemref передается номер неисполненной заявки.

3. EQM06 (6B, 6C, 6D): Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг:

Правила заполнения поля InfType для участников рынка депозитов приведено в описании структуры отчетов.

4. EQM99: Отчет об обеспечении:

Для участников рынка депозитов возможны следующие существующие типы операций:

- "1" - внесение / возврат обеспечения через НРД или НКЦ;

- "2" - внесение / возврат обеспечения через Клиринговую систему Участником клиринга;

- "10" - обязательства по уплате Комиссионного вознаграждения за организацию торгов;

- "11" - обязательства по уплате клиринговой комиссии;

- "12" - обязательства по уплате Вознаграждения за предоставление ИТС;

- "13" - обязательства по уплате пеней за наличие непогашенной Задолженности.

- "26" - внесение / возврат денежных средств в депозит/ из депозита;

- "27" - комиссионное вознаграждение за клиринговую услугу по предоставлению возможности заключения депозитного договора;

- "28" - отступное за отказ от заключения депозитного договора.

5. EQM15: Отчет по обязательствам Участника клиринга по комиссионному вознаграждению.

6. EQM14: Отчет о Маржинальных требованиях.

7. EQM20: Отчет о Торгово-клиринговых счетах:

Участнику рынка депозитов предоставляется отчет EQM20, в котором отражается информация о денежной позиции – Расчетном коде (BankAccType всегда имеет тип S) и ТКС.

8. EQM92: Отчет о гарантийных фондах:

- Участнику рынка депозитов, имеющему Категорию Б, предоставляется EQM92, в котором указывается требуемый размер взноса в Гарантийный фонд на фондовом рынке и информация об обеспечении, внесенном в гарантийный фонд (рубли, иностранная валюта).

9. EQM93: Отчет об Обеспечении под стресс:

- Участнику рынка депозитов, имеющему Категорию Б, может предоставляться EQM93 в случае возникновения требования по внесению Обеспечения под стресс.

10. CCX99: Отчет о движении денежных средств.