

# Изменения клиринговых отчетов срочного рынка (1)

Название отчета	Суть изменений
<ul style="list-style-type: none"><li>Отчет об обязательствах по сделкам <b>fposXXYY.csv</b>.</li><li>Отчет об обязательствах по опционным контрактам <b>oposXXYY.csv</b>.</li><li>Отчет о позициях по инструментам <b>riskposXX00.csv</b>.</li> <li>Отчет об иностранной валюте и ценных бумагах, предоставленных в качестве Средств гарантийного обеспечения <b>moncbXX00.csv</b>.</li> <li>Отчет о денежных средствах в рублях, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Средствами гарантийного обеспечения <b>monXX00.csv</b>.</li> <li>Предварительный отчет о денежных средствах в рублях РФ, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Средствами гарантийного обеспечения <b>daymonXX00.csv</b>.</li></ul>	<p>Исключается информация об обязательствах на разделах регистра учета позиций, имеющих код Идентификатора Участника клиринга (код 'RF') и добавляется информация о суммарных обязательствах, учитываемых на разделах регистра учета позиций в рамках одного Расчетного кода (код 'RK').</p> <p>Исключается информация об иностранной валюте / ценных бумагах, учитываемых на всех разделах денежного регистра / депо регистра обеспечения Расчетной фирмы ('RF') и добавляется информация об иностранной валюте / ценных бумагах, учитываемых на разделах в рамках одного Расчетного кода ('RK').</p> <p>Исключается уровень Расчетной фирмы ('RF') и соответствующая данному уровню информация</p> <p>Исключается уровень Расчетной фирмы ('RF') и соответствующая данному уровню информация</p>
<ul style="list-style-type: none"><li>Сводная финансовая ведомость <b>F14_XX00.xls</b>.</li></ul>	<p>Исключается сводная информация по денежным регистрам и регистрам обеспечения Расчетной фирмы:</p> <ul style="list-style-type: none"><li>- «Итого по денежному регистру обеспечения»;</li><li>- «Итого по депо регистру обеспечения».</li></ul>

# Изменения клиринговых отчетов срочного рынка (2)

Название отчета	Суть изменений
<ul style="list-style-type: none"><li>Отчет об обязательствах по сделкам <b>fposXXYY.csv</b>.</li><li>Отчет об обязательствах по опционным контрактам <b>oposXXYY.csv</b>.</li><li>Отчет о заключенных сделках <b>f04_XXYY.csv</b>.</li> <li>Отчет о заключенных опционных контрактах <b>o04_XXYY.csv</b>.</li><li>Отчет о разделах клиринговых регистров <b>clientsXX00.csv</b>.</li> <li>Отчет о позициях по инструментам <b>riskposXXYY.csv</b>.</li></ul>	<p>Добавляется новое поле «var_marg_prom» - вариационная маржа по Сделкам по итогам дневной клиринговой сессии (в рублях РФ).</p> <p>В поле «<b>type</b>» добавляются новые виды сделок:</p> <p>17 - не является сделкой, операция по изменению позиции по фьючерсному контракту с текущей датой исполнения, базовым активом которого является данная иностранная валюта / ценная бумага, в количестве и по направлению, соответствующему переданному / полученному профилю актива по иностранной валюте / ценной бумаге;</p> <p>18 – для сделок, заключенных на основании индикативных заявок;</p> <p>19 – первая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, заключенных на основании индикативных заявок;</p> <p>20 – вторая сделка для фьючерсных контрактов в календарном спреде, заключенных на основании индикативных заявок</p> <p>5 – для опционных контрактов, заключенных на основании индикативных заявок</p> <p>Поле «margin_type» переименовано в «margin_type_rk». Добавлены поля:</p> <ul style="list-style-type: none"><li>«margin_type_bf» - информация о действующих правилах расчета Гарантийного обеспечения по Брокерской фирме (3 – полунеттинг, 4 – неттинг);</li><li>«cal_spread_type» - правило учета календарных спредов для брокерской фирмы (3 – полунеттинг, 4 – неттинг).</li></ul> <p>В поле «<b>type</b>» добавляется новый тип инструмента 'K' – позиция по фьючерсному контракту с текущей датой исполнения, базовым активом которого является данная иностранная валюта / ценная бумага, в количестве и по направлению, соответствующему переданному / полученному Профилю актива по иностранной валюте / ценной бумаге)</p>