**I Изменения в клиринговые отчеты на фондовом рынке**

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

- меняется порядок заполнения поля Type.

- поле Type 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, заключенные с 19:00 до 23:50, будут отражаться в дополнительных EQM06/ EQM6D/ EQM6C, предоставляемых после 23:50;

- в ноду RECORDS отчетов EQM06/ EQM6C/ EQM6D в рамках проекта Сделки РЕПО с Банком России по плавающим ставкам добавляются поля:

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| RepoRate | Ставка РЕПО / Величина отклонения от индикативной ставки, в процентах | Нет | Number | 20 | 6 |
| RateType | Признак сделки РЕПО: «FIX» - сделка РЕПО в режиме «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», «FLOATING» - сделка РЕПО в режиме «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка» | Нет | Character | 8 |  |
| Benchmark | Код индикативной ставки (допустимое значение «RREFKEYR» - ключевая ставка Банка России) | Нет | Character | 8 |  |
| BenchmarkRate | Размер индикативной ставки, в процентах | Нет | Number | 20 | 6 |
| CurRepoRate | Текущее значение ставки РЕПО, в процентах (RepoRate+ BenchmarkRate) | Нет | Number | 20 | 6 |
| RepoSum | Сумма по сделке РЕПО, заключенной в режиме «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка», с учетом накопленного процентного дохода, в валюте расчетов | Нет | Number | 20 | 2 |

1. **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. сделки урегулирования своп.

1. **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 FeeType=191 (соответствует TRANTYPE=191 Штраф за заключение закрывающих сделок). Для FeeType=191 поле SettleDate будет заполняться Расчетным днем, следующим за датой «ReportDate». В дату списания FeeType =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\_С01 в 19:00 по сделкам, заключенным до 19:00, не меняется. В EQM15\_С03 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.

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

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

1. **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 передачи 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).

1. **Отчет об обязательствах по Сделкам Т+ (EQM23)**

- время формирования отчета EQM23 переносится на после 23:50 (EQM23\_003). В случае выхода Расчетного кода из торгов в 19:00 отчет EQM23\_002 будет предоставляться в соответствии с текущим порядком (~20:30).

1. **Отчет об обеспечении (EQM99)**

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

- из отчета исключаются поля ClearingCenterId, ClearingCenterName, ClosingBalanceTime;

- время предоставления EQM99 по РК Единого пула будут 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.

1. **Отчета о премии (EQM97)**

- время формирования переносится на 23:50.

1. **Требование о погашении задолженности (EQM22)**

- отменяется предоставление данного отчета. Информация о задолженности содержится в Отчете о движении денежных средств ССХ99.

1. **Уведомление о минимальном размере Обеспечения под стресс (ССХ94)**

- вводится информационный отчет-уведомление о рассчитанном значении Обеспечения под стресс, которое будет действовать с указанной в уведомлении даты.

(*В настоящее время участникам по ЭДО рассылается информационное сообщение о рассчитанном значении Обеспечения под стресс, оно будет заменено на xml-формат ССХ94, порядок предоставления сохранятся – по вторникам за 5 рабочих дней до даты действия нового значения Обеспечения под стресс*).

**II Изменения в клиринговые отчеты на валютном рынке**

1. **Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (EQM43)**

- 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

1. **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 CommisType=191 (соответствует TRANTYPE=191 Штраф за заключение закрывающих сделок). Для TRANTYPE=191 поле SettleDate будет заполняться Расчетным днем, следующим за датой «ReportDate». В дату списания CommisType=191 не будет повторно включаться в ССХ10.

1. **Требование о погашении задолженности (EQM22)**

- отменяется предоставление данного отчета. Информация о задолженности содержится в Отчете о движении денежных средств ССХ99.

**III Изменения в клиринговые отчеты на всех рынках**

1. **Отчет о движении денежных средств ССХ99**

- в ноду ENTRY добавляется необязательное поле Time – время операции, которое заполняется временем исполнения операции по списанию и/или зачислению денежных средств по счетам НКЦ.