

КЛИРИНГОВЫЕ ОТЧЕТЫ

Принципы и порядок формирования основных клиринговых отчетов фондового и валютного рынков

EQM06, CCX43
EQM13, CCX04
EQM84, CCX84

CCX98, EQM20 (EQM20A), CCX20 (CCX20A), EQM28
EQM30, CCX19
EQM92, EQM93, CCX94, EQM94
CCX12, EQM12
CCX11, EQM14

Управление продвижения и информационной поддержки клиринговых услуг:
Константин Кропанцев, ps@moex.com

Система отчетов Группы МБ



Группы отчетов фондового и валютного рынков

Об идентификаторах и регистрах		
Отчет о Клиринговых идентификаторах	EQM30	CCX19
Отчет о Торгово-клиринговых счетах	EQM20	CCX20
Отчет о Торгово-клиринговых счетах 2-го и 3-го уровня	EQM20A	CCX20A
Отчет о дополнительных торговых разделах, открытых для проведения операций Участниками клиринга	EQM28 (для ном. держателей)	x
Уведомление (Отчет) о замене торгово-клирингового счета	EQM12	CCX12

Об обеспечении, имуществе и профилях активов		
Отчет об оценке обеспечения	EQM84	CCX84
Отчет об обеспечении	EQM99	CCX89
Отчет об имуществе, внесенном в имущественные пулы	EQM45	x
Отчет о нормативной стоимости клиринговых сертификатов участия	EQM46	x
Отчет о переданных профилях активов на фондовом (валютном) рынке	EQM49	CCX49
Информация о размере Обеспечения, задолженности и Едином лимите	EQM184R	CCX184R

Об обязательствах		
Отчет об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях	EQM13	CCX04, CCX4A, CCX4P
Отчет об Итоговых нетто-обязательствах, которые будут прекращены	EQM91	CCX91
Отчет о маржинальных требованиях	EQM14	CCX11
Отчет об обязательствах по передаче/требованиях по получению Дохода	EQM98/ EQM98R	x
Отчет об обязательствах по Сделкам T+	EQM23	
Отчет о требованиях/ обязательствах	x	CCX37
Отчет об обязательствах по ПФИ	x	CCX17/ CCX17R
Уведомление о курсе изменения валюты исполнения обязательств	EQM100	CCX100
Отчет о требованиях / обязательствах с измененной валютой исполнения	EQM101	CCX101

О сделках, предложениях и расчетных ценах		
Клиринговый отчет	x	CCX03, CCX3A
Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг	EQM06/ EQM06P/ EQM06R EQM63 (для Участника торгов) EQM6C (по сделкам клиентов) EQM6D (для ном. держателей)	CCX43/ CCX43R, CCX43P
Выписка из протокола исполнения сделок, обязательств по внесению компенсационных взносов и уплате отступного	EQM05	x
Выписка из реестра неисполненных и расторгнутых сделок	EQM08	x
Отчет о сделках, Дата исполнения которых перенесена	x	CCX14
Отчет о сделках своп	x	CCX90
Выписка из реестра Предложений	EQM2T	CCX122
Выписка из реестра Внебиржевых сделок	EQM3T	CCX123
Выписка из реестра незарегистрированных Предложений	x	CCX124
Выписка из реестра Аукционов RFS	x	CCX125
Отчет о расчетных ценах	x	CCX18

О различных начислениях и списаниях		
Отчет о комиссионных вознаграждениях	EQM15	CCX10
Выписка из протокола внесения компенсационных взносов и исполнения обязательств по уплате отступного	EQM24	x
Уведомление об обязательствах по уплате отступного	EQM35	x
Отчет о премии	EQM97	CCX197
Отчет о начисленных и выплаченных процентах по депозитным договорам	CCX26	x
Отчет об изменении суммы депозита	EQM85	x

Описания структуры на сайтах НКЦ и МБ

[НКЦ | Формы и форматы документов и отчетов \(nationalclearingcentre.ru\)](https://nationalclearingcentre.ru)

MOEX НАЦИОНАЛЬНЫЙ КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР

Зачисление денежных средств Клиринговый терминал Московская Биржа НРД Карта сайта Eng

О нас Клиринг Управление рисками Казначейство Новости Международное сотрудничество Обратная связь

Главная / Клиринг / Документы / Формы и форматы документов и отчетов

ФОРМЫ И ФОРМАТЫ ДОКУМЕНТОВ И ОТЧЕТОВ

Часть I. Общая часть

- Утвержденный документ в формате PDF
- Формы для скачивания

Часть II. Формы и форматы документов и отчетов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов

- Утвержденный документ в формате PDF
- Формы для скачивания

Часть III. Формы и форматы документов и отчетов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов

- Утвержденный документ в формате PDF
- Формы для скачивания

Часть IV. Формы и форматы документов и отчетов на срочном рынке

- Утвержденный документ в формате PDF
- Формы для скачивания

Часть V. Формы и форматы документов и отчетов на товарном рынке

- Утвержденный документ в формате PDF
- Формы для скачивания

Часть VI. Формы и форматы документов и отчетов на рынке Стандартизированных ПФИ

- Утвержденный документ в формате PDF
- Формы для скачивания

[Торговые и клиринговые XML-отчеты \(moex.com\)](https://fs.moex.com/files/1075)

ФР: <https://fs.moex.com/files/951>

БР: <https://fs.moex.com/files/1075>

MOEX МОСКОВСКАЯ БИРЖА

Направления

Ru / En

Продукты и услуги Биржевая информация Документы Обучение Медиа

Файловая библиотека Московской Биржи

Структура торговых и клиринговых XML-отчётов на валютном рынке

Новая редакция

Вступает в силу: 13.02.2023

Структура торговых и клиринговых XML-отчётов на валютном рынке (zip, 79 Кб)

Действующая редакция

Действует: с 30.01.2023 по 12.02.2023

Структура торговых и клиринговых XML-отчётов на валютном рынке (zip, 84 Кб)

Утратили силу

Период действия: с 10.10.2022 по 29.01.2023

Структура торговых и клиринговых XML-отчётов на валютном рынке (zip, 80 Кб)

Варианты представления

Структура XML-файла

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа	Да			
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе	Да			
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Нет	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
/DOC_REQUISITES			Да			
EQM46		Блок данных отчета	Да			
	ReportDate	Дата, за которую сформирован отчет	Да	Date		
POOL		Блок данных по имущественным пулам				
	PoolCode	Код имущественного пула	Да	Character	12	0
	PoolName	Наименование имущественного пула	Да	Character	0-128	0
RECORDS		Блок данных о нормативной стоимости КСУ				
	CPCNomValueSum	Общая номинальная стоимость выданных клиринговых сертификатов участия, в рублях	Да	Number	20	2
	HValue	Величина дисконта (H) по клиринговым сертификатам участия	Нет	Number	20	2
/RECORDS						
/POOL						
/EQM46						
/MICEX_DOC						

1. XML-файл

```

1 <?xml version="1.0" encoding="windows-1251" ?>
2 <?xml-stylesheet type="text/xsl" href="C:\MICEX\XSLT\EQM46_12122017.xslt" ?>
3 <?xml-stylesheet type="text/xsl" href="
4 http://ftp.moex.com/pub/Reports/Equities/XSLT/EQM46_12122017.xslt" ?>
5 <MICEX_DOC xsi:noNamespaceSchemaLocation="C:\MICEX\XSD\EQM46_01032017.xsd" xmlns:xsi="
6 http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance">
7   <DOC_REQUISITES DOC_DATE="2022-11-01" DOC_TIME="10:01:49" DOC_NO="
8     DOC_TYPE_ID="EQM46" SENDER_ID="
9     " RECEIVER_ID="MM0000100000"/>
10   <EQM46 ReportDate="2022-11-01">
11     <POOL PoolCode="GCBONDS" PoolName="Имущественный пул «GC Bonds»: все
12     облигации, принимаемые НКЦ в обеспечение по сделкам РЕПО с ЦК или Т+, включая
13     ОФЗ">
14       <RECORDS CPCNomValueSum="1366130739268" HValue="0.07"/>
15     </POOL>
16     <POOL PoolCode="GCEXPANDED" PoolName="Имущественный пул «GC Expanded»: ценные
17     бумаги, не принимаемые НКЦ в обеспечение по сделкам РЕПО с ЦК">
18       <RECORDS CPCNomValueSum="280116323089" HValue="0.6"/>
19     </POOL>
20     <POOL PoolCode="GCSHARES" PoolName="Имущественный пул «GC Shares»: все акции,
21     принимаемые НКЦ в обеспечение по сделкам РЕПО с ЦК или Т+ ">
22       <RECORDS CPCNomValueSum="27457935541" HValue="0.35"/>
23     </POOL>
24   </EQM46>
25 </MICEX_DOC>
  
```

3. «Бумажный» формат (файл, открытый с применением стиля)

Исх. №: 023667388/EQ от 01.11.2022

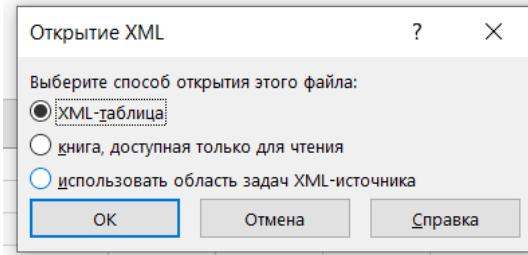
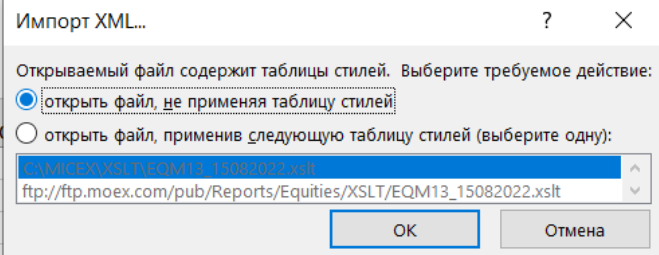
EQM46

Небанковская кредитная организация-центральный контрагент
«Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество)

Отчет о нормативной стоимости клиринговых сертификатов участия

Дата отчета: 01.11.2022

Наименование имущественного пула	Общая номинальная стоимость выданных КСУ	Величина дисконта (H) по клиринговым сертификатам участия
Имущественный пул «GC Bonds»: все облигации, принимаемые НКЦ в обеспечение по сделкам РЕПО с ЦК или Т+, включая ОФЗ	1,366,130,739,268.00	0.07
Имущественный пул «GC Expanded»: ценные бумаги, не принимаемые НКЦ в обеспечение по сделкам РЕПО с ЦК	280,116,323,089.00	0.60
Имущественный пул «GC Shares»: все акции, принимаемые НКЦ в обеспечение по сделкам РЕПО с ЦК или Т+	27,457,935,541.00	0.35



2. XML-таблица (файл, открытый без стиля)

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M
	DOC_DATE	DOC_TIME	DOC_NO	DOC_TYPE_ID	SENDER_ID	SENDER_NAME	RECEIVER_ID	REMARKS	ReportDate	PoolCode	PoolName	CPCNomValueSum	HValue
1	01.11.2022	10:01:49	023667388/EQ	EQM46	MC0888800000		MM0000100000		01.11.2022	GCBONDS	Имущественный пул «GC Bonds»: все облигации, принимаемые НКЦ в обеспе	1,36613E+12	0,07
2	01.11.2022	10:01:49	023667388/EQ	EQM46	MC0888800000		MM0000100000		01.11.2022	GCEXPANDED	Имущественный пул «GC Expanded»: ценные бумаги, не принимаемые НКЦ в	2,80116E+11	0,6
3	01.11.2022	10:01:49	023667388/EQ	EQM46	MC0888800000		MM0000100000		01.11.2022	GCSHARES	Имущественный пул «GC Shares»: все акции, принимаемые НКЦ в обеспечен	27457935541	0,35

Не следует настраивать автоматизацию импорта отчетов на суффиксы в имени XML-файлов

Важно!

Пользователям отчетов **не следует настраивать автоматизацию импорта отчетов на суффиксы** в имени файла, т.к. суффиксы являются частью внутренних настроек системы формирования отчетов и могут меняться без уведомления.

Суффикс в имени файла

Структура имен XML-файла с отчетным документом имеет вид:
FFFFFF_TTTT_SSS_DDMMYY_NNNNNNNN.RRR, где:

- **FFFFFF** – первые 7 символов идентификатора организации – адресата (либо MM00001 для электронных документов, предназначенных для всех организаций, например, для биржевой информации);
- **TTTT** – код отчета (например «EQM06» для Выписки из реестра сделок, принятых в клиринг);
- **SSS** – технологический идентификатор процедуры формирования отчета (**суффикс**);
- **DDMMYY** – дата, за которую подготовлен отчетный документ;
- **NNNNNNNN** – уникальный номер электронного документа в Подсистеме ЭДО НКЦ (DOC_NO);
- **RRR** = xml.p7s.zip.p7e - сложное расширение файла, состоящее из цепочки расширений, означающее последовательность действий по расшифровке (p7e), разархивированию (zip) и снятию цифровой подписи (p7s), необходимых для получения исходного XML-файла.

Выписки из реестра сделок, принятых в клиринг:

- EQM06 – на фондовом рынке
- ССХ43 – на валютном рынке

EQM06 – Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (на фондовом рынке)

Основной элемент отчета – сделка, заключенная от лица Участника или НКЦ.

Сделки группируются в разрезе параметров. Последовательность уровней группировки:

1. Расчетный код

2. Валюта расчетов

3. Тип информации*

4. Тип клиринга

5. Клиринговая сессия

6. Дата расчетов

7. Тип инструмента в сделке

8. Режим торгов

9. Данные по ценной бумаге / инструменту

ClearingType	Тип клиринга. Возможные значения: M - клиринг по итогам торгов R - клиринг в ходе торгов по нескольким сделкам S - клиринг в ходе торгов по одной сделке C - клиринг по Сделкам T+ E - клиринг НКО АО НРД)
--------------	---

Session	Номер клиринговой сессии: 1 - клиринговая сессия в 16:00, 17:30 2 - клиринговая сессия в 19:00, 19:30 3 - клиринговая сессия в 20:30 0 - для сделок с клирингом в ходе торгов. Если сделка не исполнена, исполняется в другой день или отменена – поле не заполняется.
---------	---

InstrType	Тип инструмента в сделке: C - сделка с валютой, S - сделка с ценной бумагой
-----------	---

SecurityId	Идентификатор ценной бумаги / инструмента
ISIN	Международный идентификатор ценной бумаги
SecShortName	Краткое наименование ценной бумаги / инструмента
PriceType	Тип цены (PERC - процент от номинала, CASH - в валюте расчетов)

* - см. слайды 10 – 13

EQM06. Тип информации (InfType) (1/4)

Параметр **Тип информации (InfType)** отражает различные характеристики сделки, предусмотрены следующие значения:

«1» – Исполненные сделки/депозитные договоры/кредитные договоры **предыдущих дней**

«2» – Исполненные сделки/депозитные договоры/кредитные договоры **текущего дня**

«3» – Сделки/ кредитные договоры/ депозитные договоры, **подлежащие исполнению**

«4» – Неисполненные и расторгнутые сделки / неисполненные кредитные договоры / **незаключенные депозитные договоры**

Для депозитов

«5» – Заявки на заключение депозитных договоров, внесенные в реестр предложений (**намерения**) / Заявления на изменение суммы депозита

«6» – Сделки/ кредитные договоры/ депозитные договоры, подлежащие исполнению, **с измененными параметрами**

«7» – **Объединенные** заявки на заключение депозитных договоров, внесенные в реестр предложений

При портабилити

«8» и «9» – Сделки, обязательства по которым были переведены от Базового Участника клиринга («8») и к Участнику клиринга-реципиенту («9») в ходе процедуры Перевода обязательств и Обеспечения (портабилити)

EQM06. Тип информации (InfType) (2/4)

В печатной форме блоки InfType отображаются как таблицы с соответствующими подзаголовками:

InfType="5" Заявки на заключение депозитных договоров, внесенные в реестр предложений / Заявления на изменение суммы депозита:

SettleDate Дата исполнения: 02.11.2022

№ п/п	Номер заявки	Часть заявки	Дата заключения	Направленность	Код расчетов	Объем заявки (в юань)	Процентная ставка	Номер депозитного договора*	Комиссия за организацию торгов	Комиссия за клиринг	Обязательство / требование по денежным средствам	ТКС	Код клиента	Контрагент	Изменение срока исполнения обязательств по сделке
RecNo	TradeNo	RepoPart	TradeDate	BuySell	SettleCode	Value	DepoRate	DepoTradeNo	ExchComm	ClrComm	Amount	TrdAcclId	ClientCode	CPFirmId CPFirmShortName	EarlySettleStatus
3	5550000001	2	01.11.2022	S	Y0/Y1D	21,491,852.64	0.3000000				21,491,852.64	000000012345		MC0888800000 НКО НКЦ (АО)	Her

BoardName ДЕПОЗИТЫ с ЦК 1 день (CNY)

* - указывается для Заявлений на изменение суммы депозита.

Дата исполнения: 01.11.2022

№ п/п	Номер заявки	Часть заявки	Дата заключения	Направленность	Код расчетов	Объем заявки (в юань)	Процентная ставка	Номер депозитного договора*	Комиссия за организацию торгов	Комиссия за клиринг	Обязательство / требование по денежным средствам	ТКС	Код клиента	Контрагент	Изменение срока исполнения обязательств по сделке
ДЕПОЗИТЫ с ЦК 1 день (CNY)															
4	5550000001	1	01.11.2022	B	Y0/Y1D	21,491,676.00	0.3000000		241.01	562.19	-21,491,676.00	000000012345		MC0888800000 НКО НКЦ (АО)	Her

* - указывается для Заявлений на изменение суммы депозита.

- В InfType="5" показывается Заявка на заключение депозита (намерение) – сделка с 2-мя частями, и уникальным номером.
- Комиссия взимается при исполнении заявки (намерения) на заключение депозита.
- Первая и вторая части сделки намерения отражаются в разных блоках, т.к. у них отличаются даты исполнения.
- В дату исполнения первой части у Участника показано обязательство по денежным средствам (со знаком минус). В **дату исполнения второй части показано требование, включающее проценты по депозиту** (при условии заключения депозита на всю сумму намерения).

- На основании намерения в процессе клиринга заключается депозитный договор с номером, отличным от номера заявки (намерения).
- Если у Участника клиринга (категории «Б», с возможностью заключать сделки с частичным обеспечением) к моменту клиринга сумма обеспечения была меньше суммы намерения, то депозитный договор заключится на сумму намерения за вычетом комиссий. Остаток намерения будет показан в блоке InfType="4" – **незаключенные** депозитные договоры.
- Если на следующий расчетный день Участник пополнит обеспечение (на минимальную сумму [Намерение] + [Комиссии] – [Депозит-1]), то на основании того же самого намерения заключится другой депозитный договор (Депозит-2), с другим номером.

EQM06. Тип информации (InfType) (3/4)

InfType="5" Заявки на заключение депозитных договоров, внесенные в реестр предложений / Заявления на изменение суммы депозита:

SettleDate Дата исполнения: 02.11.2022

№ п/п	Номер заявки	Часть заявки	Дата заключения	Направленность	Код расчетов	Объем заявки (в юань)	Процентная ставка	Номер депозитного договора*	Комиссия за организацию торгов	Комиссия за клиринг	Обязательство / требование по денежным средствам
-------	--------------	--------------	-----------------	----------------	--------------	-----------------------	-------------------	-----------------------------	--------------------------------	---------------------	--

BoardName ДЕПОЗИТЫ с ЦК 1 день (CNY)

RecNo	TradeNo	RepoPart	TradeDate	BuySell	SettleCode	Value	DepoRate	DepoTradeNo	ExchComm	ClrComm	Amount
3	5550000001	2	01.11.2022	S	Y0Y1D	21,491,852.64	0.3000000				21,491,852.64

* - указывается для Заявлений на изменение суммы депозита.

Дата исполнения: 01.11.2022

№ п/п	Номер заявки	Часть заявки	Дата заключения	Направленность	Код расчетов	Объем заявки (в юань)	Процентная ставка	Номер депозитного договора*	Комиссия за организацию торгов	Комиссия за клиринг	Обязательство / требование по денежным средствам
-------	--------------	--------------	-----------------	----------------	--------------	-----------------------	-------------------	-----------------------------	--------------------------------	---------------------	--

ДЕПОЗИТЫ с ЦК 1 день (CNY)

RecNo	TradeNo	RepoPart	TradeDate	BuySell	SettleCode	Value	DepoRate	DepoTradeNo	ExchComm	ClrComm	Amount
4	5550000001	1	01.11.2022	B	Y0Y1D	21,491,676.00	0.3000000		241.01	562.19	-21,491,676.00

* - указывается для Заявлений на изменение суммы депозита.

- В блоках InfType = «2» и «3» описываются сделки депозитного договора
- У сделок, фактически исполненных в отчетный день, заполняются время исполнения и расчетов

Номер заявки (намерения)

Валюта расчётов: CNY, юань

InfType="2" Исполненные сделки/ депозитные договоры/ кредитные договоры текущего дня:

Сделки T+:

Фактическая дата исполнения: 01.11.2022

№ п/п	Номер сделки/ заявки/ депозитного договора/ кредитного договора	Часть сделки/ заявки/ депозитного договора/ кредитного договора	Дата заключения	Направленность	Код расчетов	Срок сделки РЕПО/ кредитного договора	Объем сделки/ заявки/ депозитного договора/ кредитного договора, в валюте расчетов	Комиссия за организацию торгов	Комиссия за клиринг	НКД на дату исполнения	Сумма процентов дохода и компенсационных взносов по ДС	Сумма компенсационных взносов по ЦБ	Обязательство/ требование по денежным средствам	Сумма процентов по кредитному договору, в валюте расчетов	Ставка РЕПО/ процентная ставка	Обязательство/ требование по ЦБ	ТКС	Код клиента	Контрагент	Цена выкупа	Код раздела/ номер заявки	Величина отступного (в юань)	Номер отчета на исполн./ поручения на отказ	Время исполнения	Время расчетов	Изменение срока исполнения обязательства по сделке
-------	---	---	-----------------	----------------	--------------	---------------------------------------	--	--------------------------------	---------------------	------------------------	--	-------------------------------------	---	---	--------------------------------	---------------------------------	-----	-------------	------------	-------------	---------------------------	------------------------------	---	------------------	----------------	--

ДЕПОЗИТЫ с ЦК 1 день (CNY)

RecNo	TradeNo	RepoPart	TradeDate	BuySell	SettleCode	Value	DepoRate	DepoTradeNo	ExchComm	ClrComm	Amount
1	6780000002	1	01.11.2022	S	Y0Y1	21,491,676.00					-21,491,676.00

SystemRef

InfType="3" Сделки/ депозитные договоры/ кредитные договоры, подлежащие исполнению:

Дата исполнения: 02.11.2022

№ п/п	Номер сделки/ заявки/ депозитного договора/ кредитного договора	Часть сделки/ заявки/ депозитного договора/ кредитного договора	Дата заключения	Направленность	Код расчетов	Срок сделки РЕПО/ кредитного договора	Объем сделки/ заявки/ депозитного договора/ кредитного договора, в валюте расчетов	Комиссия за организацию торгов	Комиссия за клиринг	НКД на дату исполнения	Сумма процентов дохода и компенсационных взносов по ДС	Сумма компенсационных взносов по ЦБ	Обязательство/ требование по денежным средствам	Сумма процентов по кредитному договору, в валюте расчетов	Ставка РЕПО/ процентная ставка	Обязательство/ требование по ЦБ	ТКС	Код клиента	Контрагент	Цена выкупа	Код раздела/ номер заявки	Величина отступного (в юань)	Номер отчета на исполн./ поручения на отказ	Время исполнения	Время расчетов	Изменение срока исполнения обязательства по сделке
-------	---	---	-----------------	----------------	--------------	---------------------------------------	--	--------------------------------	---------------------	------------------------	--	-------------------------------------	---	---	--------------------------------	---------------------------------	-----	-------------	------------	-------------	---------------------------	------------------------------	---	------------------	----------------	--

ДЕПОЗИТЫ с ЦК 1 день (CNY)

RecNo	TradeNo	RepoPart	TradeDate	BuySell	SettleCode	Value	DepoRate	DepoTradeNo	ExchComm	ClrComm	Amount
2	6780000002	2	01.11.2022	S	Y0Y1	21,491,852.64					21,491,852.64

EQM06. Тип информации (InfType) (4/4)

В отчете за дату исполнения второй части депозита сделка (2-я часть) будет показана в блоке InfType="1":

Расчетный код: 12345
Валюта расчётов: CNY, юань

Отчет за 02.11.2022

InfType="1" **Исполненные сделки/ депозитные договоры/ кредитные договоры предыдущих дней:**

Сделки T+:
Номер клиринговой сессии: 2
Фактическая дата исполнения: 02.11.2022

№ п/п	Номер сделки/ заявки/ депозитного договора/ кредитного договора	Часть сделки/ заявки/ депозитного договора/ кредитного договора	Дата заключения	Направленность	Код расчетов	Срок сделки/ РЕПО/ кредитного договора	Цена	Кол-во	Объем сделки/ заявки/ депозитного договора/ кредитного договора, в валюте расчетов	Комиссия за организацию торгов	Комиссия за клиринг	НКД на дату исполнения	Сумма купонного дохода и компенсационных взносов по ДС	Сумма компенсационных взносов по ЦБ	Обязательство/ требование по денежным средствам	Сумма процентов по кредитному договору, в валюте расчетов	Ставка РЕПО/ процентная ставка	Обязательство/ требование по ЦБ	ТКС	Код клиента	Контрагент	Цена выкупа	Код раздела/ номер заявки	Величина отступного (в юань)	Номер отчета на исполн./ поручения на отказ	Время исполнения	Время расчетов	Изменение срока исполнения обязательств по сделке
ДЕПОЗИТЫ с ЦК 1 день (CNY)																												
1	6780000002	2	01.11.2022	S	Y0/Y1				21,491,852.64					21,491,852.64				00000012345	MC0888	0.30	5550000001				19:25:21	19:31:12	Нет	

В печатной форме не всегда видны все параметры отчета, полная информация передается в исходном XML-файле:

```
<SETTLE ExtSettleCode="14515">
  <CURRENCY CurrencyId="CNY" CurrencyName="юань">
    <INFATYPE InfType="1">
      <CLEARINGTYPE ClearingType="C">
        <SESSION Session="2">
          <SETTLEDATE SettleDate="2022-11-02">
            <INSTRTRADE InstrType="S">
              <BOARD BoardId="TDPY" BoardName="ДЕПОЗИТЫ с ЦК 1 день (CNY)">
                <SECURITY>
                  <RECORDS RecNo="1" TradeNo="6780000002" TradeDate="2022-11-01" TradeTime="19:36:25" BuySell="S" SettleCode="Y0/Y1" Decimals="7" Value="21491852.64" DepoRate="0.3" Amount="21491852.64" TrdAccId="000000012345" CPFirmId="5550000001" CPFirmShortName="НКО НКЦ (АО)" RepoPart="2" ReportTime="19:25:21" SettleTime="19:31:12" DueDate="2022-11-02" SystemRef="5550000001" EarlySettleStatus="0" RateType="FIX" />
                </SECURITY>
              </BOARD>
            </INSTRTRADE>
          </SETTLEDATE>
        </SESSION>
      </CLEARINGTYPE>
    </INFATYPE>
  </CURRENCY>
</SETTLE>
```

- Время исполнения (ReportTime) – время изменения текущих и плановых позиций после исполнения обязательств в Торгово-клиринговой системе
- Время расчетов (SettleTime) – время изменения входящих позиций после расчетов в НРД (время передачи ценных бумаг в НРД), время окончания клиринговой сессии, в которую попали остальные сделки (событие «Clearing end» в шлюзовом интерфейсе).

EQM06. Время формирования

В расчетный день формируется несколько отчетов:

~ **18:00** (_001*) – включает сделки, заключенные до 16:00, рассчитанные в первую клиринговую сессию;

~ **20:00** (_002*) – включает сделки первой и второй клиринговых сессий, а также сделки с измененными в дату отчета параметрами (InfType="6")

↑
или
↓

~ **20:30** (_003*) – формируется в случае, если на момент формирования списка добросовестных участников у участника недостаточно средств для исполнения; содержит сделки переноса обязательств, заключенные НКЦ;

~ **0:30** (_004*) – только сделки, заключенные участником в вечернюю сессию (после 19:00)

* - на суффиксы в имени файла отчета не следует настраивать автоматическую обработку

ССХ43 – Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (на валютном рынке)

- Содержит информацию о всех сделках, заключенных на валютном рынке и рынке драгметаллов, включая сделки НКЦ по переносу и закрытию позиций (для не единопольных РК).
Если РК единопольный (ExtSettleCodeUnifiedPool = "Y"), то сделки по переносу отражаются в отчете фондового рынка EQM06.
- Включает сделки, заключенные и/или исполненные в отчетную дату.
- Параметры группировки данных о сделках:
 1. Расчетный код
 2. Дата расчетов
 3. Валютная пара
- Формируется в ~0:30 следующего дня.

ССХ43 – Пример отчета, открытый с применением стиля

Расчетный код: **12345**

Расчетный код Единого пула: **Нет**

Дата исполнения обязательств: **01.11.2022**

Наименование валюты лота/ драгоценного металла: **Доллар США**

Наименование сопряженной валюты: **Российский рубль**

Номер сделки	Дата заключения сделки	Время заключ. сделки	Инструмент	Тип сделки	Направление	Объем в валюте лота, в ед. валюты/ в граммах	Объем сделки в сопряженной валюте	Курс	Комиссионное вознаграждение		Код ТКС	Код клиента	Номер Предложения
									за клиринговое обслуживание	за организацию торгов			
500000067	31.10.2022	10:10:51	USDRUB_TOM	К/П	К	50,000.00	-3,088,125.00	61.7625			MB5432112345		21234567800
...					
500002382	31.10.2022	17:52:48	USDRUB_TOM	К/П	К	50,000.00	-3,087,625.00	61.3525			MB5432112345		21234567811
510003021	01.11.2022	14:51:18	USDRUB_TOD	Своп	К	5,000,000.00	-307,045,000.00	61.4090	959.52	882.75	MB5432112345		21234567822
510003239	01.11.2022	15:03:42	USDRUB_TOD	Своп	К	2,000,000.00	-122,818,000.00	61.4090	383.81	353.10	MB5432112345		21234567833

Итого покупка: **28,209,000.00** **-1,736,260,722.50**

Итого продажа: **-16,250,000.00** **996,683,510.00**

Наименование валюты лота/ драгоценного металла: **Казахстанский тенге**

Наименование сопряженной валюты: **Российский рубль**

Номер сделки	Дата заключения сделки	Время заключ. сделки	Инструмент	Тип сделки	Направление	Объем в валюте лота, в ед. валюты/ в граммах	Объем сделки в сопряженной валюте	Курс	Комиссионное вознаграждение		Код ТКС	Код клиента	Номер Предложения
									за клиринговое обслуживание	за организацию торгов			
510003280	01.11.2022	15:27:02	KZTRUB_TOM	К/П	К	1,500,000.00	-199,800.00	13.3200	0.01	0.01	MB5432112345		21234567890

Итого покупка: **1,500,000.00** **-199,800.00**

Итого продажа: **0.00** **0.00**

Отчеты об Итоговых нетто-обязательствах / нетто-требованиях:

- ССХ04 (4Р, 4А) – на валютном рынке
- EQM13 – на фондовом рынке

ССХ04 – Отчет об Итоговых нетто (-обязательствах/ -требованиях)

Отчет показывает размер обязательств (по каждому расчетному коду в разрезе валют), которые должны быть исполнены участником в отчетном дне до наступления cut-off time по валюте.

Выдержка из описания структуры ССХ04:

CCX04	Блок данных отчета	Обяз-ть
ReportDate	Дата, за которую сформирован отчет	Да
ClearingFirmId	Идентификатор Участника клиринга	Да
ClearingFirmName	Наименование Участника клиринга	Да
ClearingFirmNameEN	Наименование Участника клиринга (английское)	Нет
SETTLE	Блок информации по расчетному коду	
ExtSettleCode	Расчетный код Участника клиринга	Да
ExtSettleCodeUnifiedPool	Признак Расчетного кода Единого пула («Y» - да, «N» - нет)	Нет
CURRENCY	Блок информации по валюте	
NccRealAccount	Номер Счета обеспечения	Нет
CurrencyId	Идентификатор валюты /драгоценного металла	Да
NettoSum	Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование	Да
RECORDS	Блок данных по обязательствам	
DataType	Тип обязательств: FX_OBLIG – по сделкам с наступившей датой исполнения; FX_FEE – по уплате комиссионного вознаграждения; FX_VM – по уплате вариационной маржи; FX_DEBT – по уплате Задолженности; FX_PEN – штрафы, пени, неустойки; PR_NETTOSUM – Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование из предыдущего отчета; SETTL_OBLIG – по сделкам, заключаемым в целях урегулирования неисполненных обязательств (по сделкам урегулирования).	Нет
	Debit	Да
	Credit	Да
/RECORDS		
/CURRENCY		
/SETTLE		
/CCX04		

- Один из основных параметров отчета – **Тип обязательств (DataType)**, с предусмотренными вариантами значений (см. описание структуры отчета)
- По отдельному типу указываются либо нетто-обязательство участника (**Debit**), либо его нетто-требование (**Credit**). Итоговое значение (**NettoSum**) указывается с учетом знака (обязательства участника – с минусом)

Расчетный код: **12345**

Расчетный код Единого пула: **Нет**

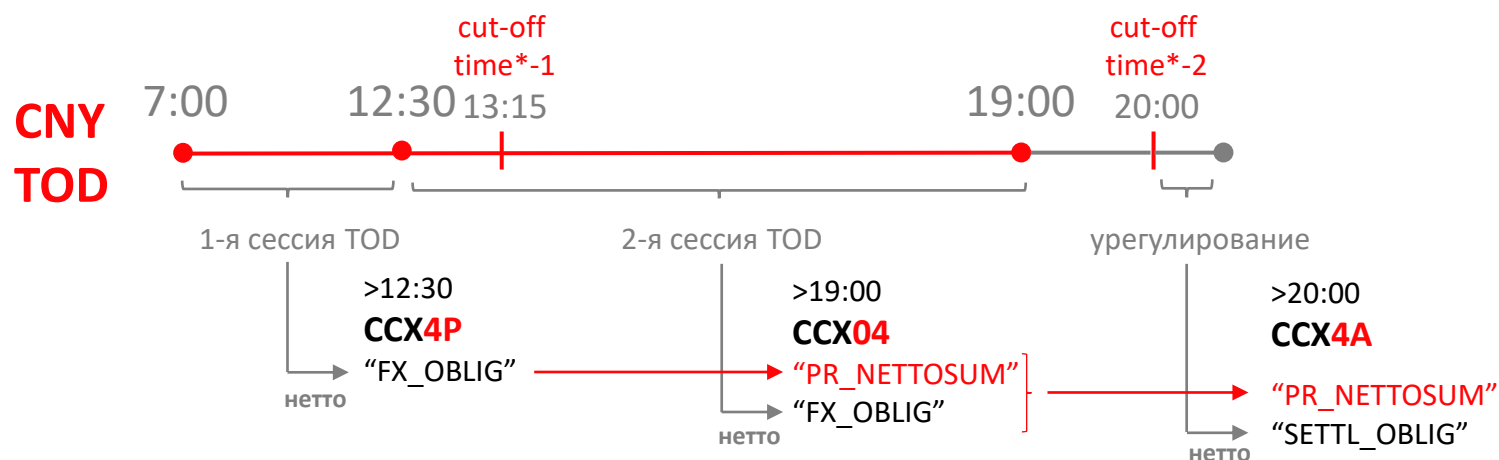
Код валюты/драгоценного металла: **CNY**

Тип обязательства	Обязательство	Требование
Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование из предыдущего отчета	0.00	350,000.00
Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование:	0.00	350,000.00

Код валюты/драгоценного металла: **RUB**

Тип обязательства	Обязательство	Требование
по уплате комиссионного вознаграждения	608.68	0.00
по сделкам с наступившей датой исполнения	0.00	81,147,800.00
Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование:	0.00	81,147,191.32

В течение дня может быть сформировано несколько отчетов ССХ4:



Предварительные отчеты ССХ4Р формируются после 11:00, 12:30 и 15:15 – по валютам, торги с расчетами TOD которыми заканчиваются раньше 19:00. Данные о нетто- обязательствах/требованиях будут указаны в DataType = FX_OBLIG.

Итоговый отчет ССХ04 формируется после окончания торгов с расчетами TOD в 19:00 на валютном рынке в целом. Содержит информацию **по всем** валютам, по сделкам с которыми **в отчетный день** рассчитаны с нетто-обязательства/требования.

Если по какой-то валюте днем был сформирован предварительный отчет, то в итоговом отчете значение итогового нетто из предварительного отчета будет указано в DataType = PR_NETTOSUM.

Если НКЦ заключал сделки для переноса обязательств участника, то формируется **ССХ4А – по сделкам переноса**. Сумма нетто по сделкам урегулирования будет указана в параметре DataType = SETTL_OBLIG.

Особенность:

По CNY и НКД торги с расчетами TOD разделены на 2 сессии: первая – НКД до 11:00, CNY до 12:30 и вторая – с 11:00 и 12:30 до 19:00. Если в первую сессию были сделки (и/или рассчитаны обязательства /требования с исполнением до cut-off time-1), нетто по сделкам первой сессии будет указано:

- в предварительном отчете – в DataType = FX_OBLIG,
- в итоговом отчете – в DataType = PR_NETTOSUM.

* - регламентное время исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам

ССХ04 – Примеры отчетов в формате XML

ССХ4P_C11 – предварительный, после 12:30

```
<DOC_REQUISITES DOC_DATE="2023-02-06" DOC_TIME="12:33:49" DOC_NO=" " DOC_TYPE_ID="ССХ4P" />
<CCX04 ReportDate="2023-02-06" ClearingFirmId="MB5432100000" ClearingFirmName="ПАО ПРИМЕР" ClearingFirmCode=" " />
<SETTLE ExtSettleCode="12345" ExtSettleCodeUnifiedPool="N">
  <CURRENCY CurrencyId="BYN" NccRealAccount="12345" NettoSum="30000">
    <RECORDS DataType="FX_OBLIG" Debit="0" Credit="30000" />
  </CURRENCY>
  <CURRENCY CurrencyId="CNY" NccRealAccount="12345" NettoSum="47133517.52">
    <RECORDS DataType="FX_OBLIG" Debit="0" Credit="47133517.52" />
  </CURRENCY>
</SETTLE>
</CCX04>
```

ССХ04_C99 – итоговый, после 19:00

```
<DOC_REQUISITES DOC_DATE="2023-02-06" DOC_TIME="19:08:25" DOC_NO=" " DOC_TYPE_ID="ССХ04" />
<CCX04 ReportDate="2023-02-06" ClearingFirmId="MB5432100000" ClearingFirmName="ПАО ПРИМЕР" ClearingFirmCode=" " />
<SETTLE ExtSettleCode="12345" ExtSettleCodeUnifiedPool="N">
  <CURRENCY CurrencyId="BYN" NccRealAccount="12345" NettoSum="30000">
    <RECORDS DataType="PR_NETTOSUM" Debit="0" Credit="30000" />
  </CURRENCY>
  <CURRENCY CurrencyId="CNY" NccRealAccount="12345" NettoSum="37233517.52">
    <RECORDS DataType="FX_OBLIG" Debit="9900000" Credit="0" />
    <RECORDS DataType="PR_NETTOSUM" Debit="0" Credit="47133517.52" />
  </CURRENCY>
  <CURRENCY CurrencyId="EUR" NccRealAccount="12345" NettoSum="-387000">
    <RECORDS DataType="PR_NETTOSUM" Debit="387000" Credit="0" />
  </CURRENCY>
  <CURRENCY CurrencyId="RUB" NccRealAccount="12345" NettoSum="-947758641.61">
    <RECORDS DataType="FX_FEE" Debit="153501.71" Credit="0" />
    <RECORDS DataType="FX_OBLIG" Debit="947605139.9" Credit="0" />
  </CURRENCY>
  <CURRENCY CurrencyId="USD" NccRealAccount="12345" NettoSum="8303621.91">
    <RECORDS DataType="FX_OBLIG" Debit="0" Credit="8303621.91" />
  </CURRENCY>
</SETTLE>
</CCX04>
```

ССХ4P_C77 – предварительный, после 15:15

```
<DOC_REQUISITES DOC_DATE="2023-02-06" DOC_TIME="15:22:36" DOC_NO=" " DOC_TYPE_ID="ССХ4P" />
<CCX04 ReportDate="2023-02-06" ClearingFirmId="MB5432100000" ClearingFirmName="ПАО ПРИМЕР" ClearingFirmCode=" " />
<SETTLE ExtSettleCode="12345" ExtSettleCodeUnifiedPool="N">
  <CURRENCY CurrencyId="EUR" NccRealAccount="12345" NettoSum="-387000">
    <RECORDS DataType="FX_OBLIG" Debit="387000" Credit="0" />
  </CURRENCY>
</SETTLE>
</CCX04>
```

ССХ4A_A0 – по сделкам переноса, после 20:00

```
<DOC_REQUISITES DOC_DATE="2023-02-06" DOC_TIME="20:22:04" DOC_NO=" " DOC_TYPE_ID="ССХ4A" />
<CCX4A ReportDate="2023-02-06" ClearingFirmId="MB5432100000" ClearingFirmName="ПАО ПРИМЕР" ClearingFirmCode=" " />
<SETTLE ExtSettleCode="12345" ExtSettleCodeUnifiedPool="N">
  <CURRENCY CurrencyId="CNY" NccRealAccount="12345" NettoSum="45033521.14">
    <RECORDS DataType="PR_NETTOSUM" Debit="0" Credit="37233517.52"/>
    <RECORDS DataType="SETTL_OBLIG" Debit="0" Credit="7800003.62"/>
  </CURRENCY>
  <CURRENCY CurrencyId="USD" NccRealAccount="12345" NettoSum="7159571.91">
    <RECORDS DataType="PR_NETTOSUM" Debit="0" Credit="8303621.91"/>
    <RECORDS DataType="SETTL_OBLIG" Debit="1144050" Credit="0"/>
  </CURRENCY>
</SETTLE>
</CCX4A>
```

На **суффиксы** в имени файла отчета не следует настраивать автоматическую обработку

EQM13 – Отчет об Итоговых нетто (-обязательствах /-требованиях)

Отчет показывает размер обязательств, которые должны быть исполнены участником в отчетном дне до наступления cut-off time:

EQM13 по
денежной позиции
(«по деньгам»)
PosType = «C»

EQM13 по
депозитарным разделам
(«по бумагам»)
PosType = «S»

- Один из основных параметров отчета – **Тип обязательств (Data Type)**, с предусмотренными вариантами значений.
- По отдельному типу указываются либо нетто-обязательство участника (**Debit**), либо его нетто-требование (**Credit**).
Итоговое значение (**NettoSum**) указывается с учетом знака (обязательства участника – с минусом)

У расчетных кодов единого пула (РК ЕП) обязательства исполняются с РК ФР, поэтому Тип обязательств (Data Type) отчета EQM13 предусматривает значения и для других рынков.

Значения поля «Тип обязательств (Data Type)» отчета EQM13:

общие	PR_NETTOSUM - Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование из предыдущего отчета; SETTL_OBLIG – по сделкам урегулирования;
на фондовом рынке	SEC_M - по Сделкам Т+ с наступившей датой исполнения; SEC_M_FEE - по уплате комиссионного вознаграждения на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов; SEC_M_DEBT – по уплате Задолженности на фондовом рынке; SEC_M_PEN – штрафы, пени, неустойки на фондовом рынке;
на рынке депозитов	DEPO_RETURN – требования по возврату депозитов; DEPO_INTENTION – намерения заключить депозитные договора; DEPO_FACT_SUM – фактически размещенные в депозит суммы; DEPO_WITHDRAWAL - требования по частичному выводу средств из депозита; DEPO_REPLENISHMENT - обязательства по пополнению депозитов с частично выведенной суммой; DEPO_F_REPLENISHMENT - фактически пополненные суммы; DEPO_FACT_RETURN - фактические требования по возврату депозитов (с учетом неисполненных пополнений); PR_DEPO_NETTOSUM - Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование из предыдущего отчета;
на валютном рынке	FX_OBLIG – по сделкам с наступившей датой исполнения на валютном рынке и рынке драгоценных металлов; FX_VM – по уплате вариационной маржи на валютном рынке и рынке драгоценных металлов; FX_FEE - по уплате комиссионного вознаграждения на валютном рынке и рынке драгоценных металлов; FX_PEN - штрафы, пени, неустойки на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
на срочном рынке	DERIV_VM - по уплате вариационной маржи на срочном рынке; DERIV_FEE - по уплате сборов и комиссионного вознаграждения на срочном рынке; DERIV_PEN - штрафы, пени, неустойки на срочном рынке;
на рынке СПФИ	OTC_VM - по уплате вариационной маржи на рынке Стандартизированных ПФИ; OTC_TVM - по уплате накопленной вариационной маржи на рынке Стандартизированных ПФИ (расчеты по вариационной марже при смене валюты вариационной маржи); OTC_DM - по уплате депозитной маржи на рынке Стандартизированных ПФИ; OTC_ITDM - по уплате процентов на накопленную депозитную маржу на рынке Стандартизированных ПФИ; OTC_VFSUM- по уплате Плавающей суммы/ Фиксированной суммы на рынке Стандартизированных ПФИ (процентный платеж); OTC_OSUM- по уплате Номинальной суммы (Суммы первоначального платежа) на рынке Стандартизированных ПФИ); OTC_CSUM- по уплате Номинальной суммы (Суммы окончательного платежа) на рынке Стандартизированных ПФИ; OTC_SUM- по уплате суммы Платежа на рынке Стандартизированных ПФИ (расчеты по форварду); OTC_PAY - по уплате Премии по опциону на рынке Стандартизированных ПФИ; OTC_AUC - по внесению / получению платы за заключение Аукционных договоров (Дополнительный платеж); OTC_AGRPAY - из Соглашений об изменении условий Договора СПФИ/ из Соглашений о досрочном прекращении Договора СПФИ; OTC_FEE - по уплате комиссионного вознаграждения на рынке Стандартизированных ПФИ.

В течение дня формируется несколько отчетов EQM13

«по бумагам»



«по деньгам»

>11:00 EQM13_001	>12:30 EQM13_011	>15:15 EQM13_002	>19:00 EQM13_007 или EQM13_008	< 20:00	>20:00 EQM13_009
AMD	AED	CAD	AUD		Депозиты (фактически размещенные суммы и требования по возврату),
AZN	BYN	GBP	CNY 12:30 – 19:00		Сделки доп. сессии (в т.ч. урегулирования «по деньгам»)
EGP	CHF	EUR	HKD 11:00 – 19:00		
HKD <11:00	CNY <12:30		RUB		
KGS	KZT		USD		
TJS	TRY		JPY		
UZS	ZAR		Драг. металлы		

EQM13 – Пример отчетов «по деньгам» в формате XML

EQM13_001 – «по деньгам» после 11:00

```
<SETTLE ExtSettleCode="01234">
  <POSTYPES PosType="C">
    <GROUP BankAccId="01234">
      <CURRENCY CurrencyId="AMD" CurrencyName="Армянский драм" NettoSum="-10460000">
        <RECORDS DataType="FX_OBLIG" Debit="10460000" Credit="0"/>
      </CURRENCY>
      <CURRENCY CurrencyId="HKD" CurrencyName="Гонконгский доллар" NettoSum="6026.2">
        <RECORDS DataType="FX_OBLIG" Debit="0" Credit="6026.2"/>
      </CURRENCY>
    </GROUP>
  </POSTYPES>
</SETTLE>
```

EQM13 «по деньгам» не делятся на предварительные и итоговый. Отчеты с итоговыми нетто формируются один раз – по завершении торгов валютой с расчетами TOD.

В последующих отчетах нет данных из предыдущих отчетов, за исключением следующих ситуаций:

- нетто по сделкам первых сессий с расчетами TOD по CNY и HKD;
- нетто по сделкам урегулирования;
- комиссия по депозитам.

В этих случаях значение итогового нетто из ранее сформированного отчета будет указано в последующем отчете в DataType = PR_NETTOSUM.

EQM13_011 – «по деньгам» после 12:30

```
<SETTLE ExtSettleCode="01234">
  <POSTYPES PosType="C">
    <GROUP BankAccId="01234">
      <CURRENCY CurrencyId="CNY" CurrencyName="юань" NettoSum="9436996.46">
        <RECORDS DataType="SEC_M" Debit="0" Credit="29635722.56"/>
        <RECORDS DataType="FX_OBLIG" Debit="20198726.1" Credit="0"/>
      </CURRENCY>
      <CURRENCY CurrencyId="KZT" CurrencyName="Казахстанский тенге" NettoSum="144010">
        <RECORDS DataType="FX_OBLIG" Debit="0" Credit="144010"/>
      </CURRENCY>
    </GROUP>
  </POSTYPES>
</SETTLE>
```

EQM13_007 – «по деньгам» после 19:00

```
<SETTLE ExtSettleCode="01234">
  <POSTYPES PosType="C">
    <GROUP BankAccId="01234">
      <CURRENCY CurrencyId="CNY" CurrencyName="юань" NettoSum="-7789063.95">
        <RECORDS DataType="PR_NETTOSUM" Debit="0" Credit="9436996.46"/>
        <RECORDS DataType="SEC_M" Debit="0" Credit="5173939.59"/>
        <RECORDS DataType="FX_OBLIG" Debit="22400000" Credit="0"/>
      </CURRENCY>
      <CURRENCY CurrencyId="RUR" CurrencyName="рубль" NettoSum="-1069671270.29">
        <RECORDS DataType="SEC_M" Debit="0" Credit="2225011088.92"/>
        <RECORDS DataType="SEC_M_FEE" Debit="70703.63" Credit="0"/>
        <RECORDS DataType="FX_FEE" Debit="322148.67" Credit="0"/>
        <RECORDS DataType="DERIV_VM" Debit="2630000" Credit="0"/>
        <RECORDS DataType="FX_OBLIG" Debit="3291659506.91" Credit="0"/>
      </CURRENCY>
      <CURRENCY CurrencyId="USD" CurrencyName="долл. США" NettoSum="482733.97">
        <RECORDS DataType="SEC_M" Debit="50984141.95" Credit="0"/>
        <RECORDS DataType="FX_OBLIG" Debit="0" Credit="51466875.92"/>
      </CURRENCY>
    </GROUP>
  </POSTYPES>
</SETTLE>
```

EQM13_002 – «по деньгам» после 15:15

```
<SETTLE ExtSettleCode="01234">
  <POSTYPES PosType="C">
    <GROUP BankAccId="01234">
      <CURRENCY CurrencyId="EUR" CurrencyName="евро" NettoSum="-435237.28">
        <RECORDS DataType="SEC_M" Debit="999162.89" Credit="0"/>
        <RECORDS DataType="FX_OBLIG" Debit="0" Credit="563925.61"/>
      </CURRENCY>
    </GROUP>
  </POSTYPES>
</SETTLE>
```

На **суффиксы** в имени файла отчета не следует настраивать автоматическую обработку

EQM13 – Пример отчетов «по бумагам» в формате XML

EQM13_003 – «по бумагам» после 16:00 (сделки до 16:00)

+ EQM13_004 до 17:30 (если были сделки урегулирования)

```
<SETTLE ExtSettleCode="01234">
  <POSTYPES PosType="S">
    <GROUP GuarDepUnitId="36MC0012900000F00" TrdAccId="S01+00000F00">
      <CURRENCY SecurityId="RU000A0JW4Z1" SecShortName="КCY обл." ISIN="RU000A0JW4Z1" NettoSum="-800584000">
        <RECORDS DataType="SEC_M" Debit="800584000" Credit="0"/>
      </CURRENCY>
      <CURRENCY SecurityId="RU000A0JWKG5" SecShortName="КCY акц." ISIN="RU000A0JWKG5" NettoSum="-322570000">
      </CURRENCY>
      <CURRENCY SecurityId="RU000A0ZZTL5" SecShortName="ФПК 1P-05" ISIN="RU000A0ZZTL5" NettoSum="-1">
      </CURRENCY>
      <CURRENCY SecurityId="RU000A103AT8" SecShortName="Атомэнпр01" ISIN="RU000A103AT8" NettoSum="-59">
      </CURRENCY>
      <CURRENCY SecurityId="RU000A103M10" SecShortName="БалтЛиэБП4" ISIN="RU000A103M10" NettoSum="-2071">
      </CURRENCY>
      <CURRENCY SecurityId="RU000A105MP6" SecShortName="Дф 2P-01" ISIN="RU000A105MP6" NettoSum="-200000">
      </CURRENCY>
      <CURRENCY SecurityId="RU000A105RG4" SecShortName="ГазКЗ-26Д" ISIN="RU000A105RG4" NettoSum="4000">
      </CURRENCY>
      <CURRENCY SecurityId="SU29006RMFS2" SecShortName="ОФЗ 29006" ISIN="RU000A0JV4L2" NettoSum="732760">
        <RECORDS DataType="SEC_M" Debit="0" Credit="732760"/>
      </CURRENCY>
      <CURRENCY SecurityId="SU29014RMFS6" SecShortName="ОФЗ 29014" ISIN="RU000A101N52" NettoSum="278">
      </CURRENCY>
      <CURRENCY SecurityId="SU52001RMFS3" SecShortName="ОФЗ 52001" ISIN="RU000A0JVMH1" NettoSum="3288">
      </CURRENCY>
      <CURRENCY SecurityId="SU52002RMFS1" SecShortName="ОФЗ 52002" ISIN="RU000A0ZY226" NettoSum="1000713">
        <RECORDS DataType="SEC_M" Debit="0" Credit="1000713"/>
      </CURRENCY>
    </GROUP>
  </POSTYPES>
</SETTLE>
```

cut-off time

Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам по сделкам, заключенным до 16:00 Даты исполнения – 17:00 Даты исполнения

EQM13_005 – «по бумагам» после 19:00 (сделки с 16:00 до 19:00)

+ EQM13_006 до 19:30 (если были сделки урегулирования)

```
<SETTLE ExtSettleCode="01234">
  <POSTYPES PosType="S">
    <GROUP GuarDepUnitId="36MC0012900000F00" TrdAccId="S01+00000F00">
      <CURRENCY SecurityId="RU000A0JW4Z1" SecShortName="КCY обл." ISIN="RU000A0JW4Z1" NettoSum="243424000">
        <RECORDS DataType="SEC_M" Debit="0" Credit="243424000"/>
      </CURRENCY>
      <CURRENCY SecurityId="SU29006RMFS2" SecShortName="ОФЗ 29006" ISIN="RU000A0JV4L2" NettoSum="-5246">
        <RECORDS DataType="SEC_M" Debit="5246" Credit="0"/>
      </CURRENCY>
      <CURRENCY SecurityId="SU52002RMFS1" SecShortName="ОФЗ 52002" ISIN="RU000A0ZY226" NettoSum="-5667">
        <RECORDS DataType="SEC_M" Debit="5667" Credit="0"/>
      </CURRENCY>
    </GROUP>
  </POSTYPES>
</SETTLE>
```

cut-off time

Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам по сделкам, заключенным до 19:00 Даты исполнения – 20:00 Даты исполнения

На **суффиксы** в имени файла отчета не следует настраивать автоматическую обработку

Отчеты об оценке обеспечения:

- EQM84 – на фондовом рынке
- ССХ84 – на валютном рынке

EQM84 - Отчет об оценке обеспечения

Показывает стоимость обеспечения на расчетных кодах и ТКС с учетом риск-параметров:

- приема в обеспечение (принимается / принимается в размере лимита / не принимается);
- нижних границ [рыночного риска](#).

Если актив не принимается в обеспечение (в примере – все ц.б. кроме Роснфт1P1), или принимается в размере лимита 0% (в примере EUR и USD), то оценочная стоимость такого актива равна нулю.

При отсутствии открытых позиций Стоимость обеспечения, доступного для вывода, совпадает с размером Единого лимита. В примере часть ц.б., не принимаемых в обеспечение, участвуют в сделках РЕПО, рублевые требования по которым увеличивают Единый лимит.

Обычно формируется до 1:00 след. расчетного дня

Подробнее о расчете Единого лимита:

[НКЦ | Принципы расчета Единого лимита](#)

[НКЦ | Методики контроля рисков в ТКС всех рынков](#)

EQM84

Отчет об оценке Обеспечения

Дата отчета: 16.01.2023

Наименование Участника клиринга: "ПРИМЕР" АО

Идентификатор Участника клиринга: MC0012300000

Расчетный код: 01234

Идентификатор валюты / ценной бумаги / драгоценного металла	Наименование валюты / ценной бумаги / драгоценного металла	Номер Счета обеспечения / Торгово- клиринговый счет	Размер Обеспечения	Размер Обеспечения, недоступного для вывода	Оценочная стоимость актива, руб.
RU000A0JX132	Роснфт1P1	S01+00000F00	953,120		822,599,747.20
RU000A0JXPG2	ГТЛК 1P-04	S01+00000F00	86,832		0.00
RU000A0ZYNY4	ГТЛК 1P-07	S01+00000F00	399,750		0.00
RU000A101TT2	РЖД 1Б-01	S01+00000F00	200,000		0.00
RU000A1026C1	ПИК К 1P3	S01+00000F00	388,428		0.00
RU000A105R39	ВТБКС4-379	S01+00000F00	1,500,000		0.00
RU000A105R88	ВТБКС4-380	S01+00000F00	1,400,000		0.00
CNY	CNY	47405156790000	10,068,505.51		94,362,688.09
EUR	евро	47405978790000	60,458.76		0.00
RUR	руб.	30420810691000	26,922,042.12		26,922,042.12
USD	долл. США	47405840190000	5,862,321.78		0.00
Общая стоимость Обеспечения, руб.					943,884,477.41
Стоимость Обеспечения, доступного для вывода, руб.					943,884,477.41
Стоимость Обеспечения, недоступного для вывода, руб.					0.00
Единый лимит					2,735,720,022.08

ССХ84 - Отчет об оценке обеспечения

Показывает стоимость обеспечения на расчетных кодах для целей расчета нормативов ликвидности Н2, Н3 с учетом риск-параметров:

- приема в обеспечение (принимается / принимается в размере лимита / не принимается);
- нижних [рыночных ценовых границ](#).

Если валюта/драгоценный металл не принимается в обеспечение или принимается в размере лимита 0% (в примере – EUR и USD), то оценочная стоимость такого актива равна нулю.

При отсутствии открытых позиций Стоимость обеспечения, доступного для вывода, совпадает с размером Единого лимита.

Обычно формируется до 1:00 след. расчетного дня

Подробнее о расчете Единого лимита:

[НКЦ | Принципы расчета Единого лимита](#)

[НКЦ | Методики контроля рисков в ТКС всех рынков](#)

Исх. №: 012345678/СС от 02.11.2022 00:25:10

НКО НКЦ (АО)

ССХ84

ОТЧЕТ ОБ ОЦЕНКЕ ОБЕСПЕЧЕНИЯ

Дата, за которую сформирован отчет: 01.11.2022

Идентификатор Участника клиринга: MB5432100000

Наименование Участника клиринга: ПРИМЕР

Расчетный код: 12345

Код валюты/ драгоценного металла	Наименование валюты/ драгоценного металла	Количество/ сумма актива, внесенного в качестве Обеспечения	Количество/ сумма актива, недоступного для вывода	Стоимость Обеспечения, руб.
USD	Доллар США	4,759,658.87	0.00	0.00
EUR	Евро	4,366,000.00	0.00	0.00
CNY	Китайский юань	136,161,094.67	0.00	1,023,648,683.72
RUB	Российский рубль	588,497.05	0.00	588,497.05
Общая стоимость Обеспечения, руб.				1,024,237,180.77
Стоимость Обеспечения, доступного для вывода, руб.				1,024,237,180.77
Стоимость Обеспечения, недоступного для вывода, руб.				0.00
Единый лимит				1,028,323,154.15

Отчеты о Расчетных кодах и Торгово-клиринговых счетах:

- ССХ98 – о РК и реквизитах УК
- EQM20, EQM20A – о ТКС на фондовом рынке
- ССХ20, ССХ20A – о ТКС на валютном рынке

ССХ98 – Отчет о Расчетных кодах и реквизитах Участника клиринга

ОТЧЕТ О РАСЧЕТНЫХ КОДАХ И РЕКВИЗИТАХ УЧАСТНИКА КЛИРИНГА

Регистрационный код Участника

клиринга: MB1234500000

Основной Расчетный код Участника клиринга:

Перечень Расчетных кодов Участника клиринга.

Расчетный код	88888
Тип расчетного кода	Собственные средства
Вид расчетного кода	Стандартный
Реквизиты счета	основные
BIC	БИК Банка 044555666
REG_BNAME1	Наименование Банка ПАО "БАНК"
CORR_ACC	Корреспондентский счет 30101810145250000588
ACC_CREDIT	Номер счета получателя 30424810800000000002
INN	ИНН получателя
REG_NAME1	Наименование получателя средств АО "УЧАСТНИК"
Реквизиты счета	основные
CURRENCY	Код валюты CNY
F58A_ACC	Коррсчет Бенефициара /3010915620000000171
F58A_BIC	SWIFT BIC Бенефициара BANKRUMM
Расчетный код	11111
Тип расчетного кода	Собственные средства
Вид расчетного кода	Коллективное клиринговое обеспечение
Расчетный код	55555
Тип расчетного кода	Средства клиентов
Вид расчетного кода	Стандартный
Расчетный код	66666
Тип расчетного кода	Собственные средства
Вид расчетного кода	Пул «GC Bonds»
Расчетный код	77777
Тип расчетного кода	Собственные средства
Вид расчетного кода	Пул «GC Expanded»
Расчетный код	33333
Тип расчетного кода	Собственные средства
Вид расчетного кода	Обеспечение под риски концентрации
Расчетный код	22222
Тип расчетного кода	Собственные средства
Вид расчетного кода	Обеспечение под стресс

Содержит информацию о Расчетных кодах и банковские реквизиты счетов для возврата обеспечения, привязанных к этим РК.

Формируется по запросу Участника клиринга:

- в виде отчета – по Запросу отчета о Расчетных кодах ([формат CODEINFORQ](#), Запрос создается* при помощи собственного ПО: подписанный и зашифрованный файл .txt.p7a необходимо направить на адрес frnkc@ex.micex.ru);

- в виде выгрузки через Клиринговый терминал («Счета обеспечения»).

Тип Расчетного кода (TYPE):

S - для учета собственных средств;

L - для учета средств клиентов;

D - для учета средств, переданных в доверительное управление.

Вид Расчетного кода (KIND):

O – Стандартный

I – Обеспечение под риски концентрации

F – Коллективное клиринговое обеспечение

G – Обеспечение под стресс

B – Пул «GC Bonds»

X – Пул «GC Shares»

E – Пул «GC Expanded»

U – Пул «OFZ»

M – Пул «GC METAL»

D – Депозит Deposit

Z – Расчетный код для учета обеспечения под налоги РФ

Признак основных реквизитов (SING_MAIN):

Y - основные

N – дополнительные

ССХ20 – Отчет о торгово-клиринговых счетах (на валютном рынке)

Содержит информацию о Расчетных кодах, ТКС и идентификационных данных клиентов в случае их указания при регистрации ТКС. Формируются ежедневно около 0:00.

Изменения отдельным параметром не выделяются.

ССХ20

ОТЧЕТ О ТОРГОВО-КЛИРИНГОВЫХ СЧЕТАХ

Расчетный код	Модель использования Расчетного кода	Признак Расчетного кода Единого пула	Тип Расчетного кода	Торгово-клиринговый счет	Расчетный код обособленного клиента	Идентификационные данные (ИНН или № паспорта клиента (клиента субброкера))	Расчетный код для списания комиссионных вознаграждений	Взимается оборотная часть комиссионного вознаграждения	Соответствие Расчетному коду для списания оборотной части комиссионного вознаграждения
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
ExtSettleCode	BankAccModelType	ExtSettleCodeUnified Pool	ExtSettleCodeType	TrdAcclId	SegrClientCode	Details, SubDetails	CommPaymentAcc	TaxPaymentAcc	TaxPaymentAcclink
11111	Расчетный код Участника клиринга, совпадающего в одном лице с Участником торгов	Да	для учета средств клиентов	MB1234511111	Нет		Нет	Нет	
Идентификатор валюты	Номера Счета обеспечения								
11	12								
CurrencyId	NccRealAccount								
AED	47405784490000011111								
AMD	47405051990000011111								
BYN	47405933490000011111								
CHF	47405756790000011111								
CNY	47405156390000011111								
EUR	47405978390000011111								
GBP	47405826390000011111								
HKD	47405344490000011111								
JPY	47405392390000011111								
KGS	47405417990000011111								
KZT	47405398190000011111								
RUB	30420102910000011111								
TJS	47405972590000011111								
TRY	47405949390000011111								
USD	47405840790000011111								
UZS	47405860990000011111								
ZAR	47405710590000011111								

1. РК из 5 цифр
2. Юридическая модель, варианты:
 - «1» - Расчетный код Участника клиринга, совпадающего в одном лице с Участником торгов;
 - «2» - Расчетный код для заключения сделок от имени и в интересах Участника клиринга;
 - «3» - Расчетный код Клирингового брокера
3. РК ЕП, варианты: «Y» - Да / «N» - Нет
4. Тип РК, варианты:
 - «S» - для учета собственных средств;
 - «L» - для учета средств клиентов;
 - «D» - для учета средств, переданных в доверительное управление
5. Номер ТКС в привязке к РК.

ССХ20А – Отчет о торгово-клиринговых счетах 2-го и 3-го уровня (на валютном рынке)

Содержит информацию о Расчетных кодах, ТКС и идентификационных данных клиентов в случае их указания при регистрации ТКС. Формируются ежедневно около 0:00.

Изменения отдельным параметром не выделяются.

Версия отчета для Участника клиринга

ССХ20А

(в случае ReportType="CLEARING"):

ОТЧЕТ О ТОРГОВО-КЛИРИНГОВЫХ СЧЕТАХ

Блок информации по расчетному коду 1-го уровня (*SETTLE12*)

Блок информации по расчетному коду 2-го уровня (*SETTLE23*)

Блок информации по расчетному коду 3-го уровня (*SETTLE3*)

ТКС старой нумерации

ТКС новой нумерации

Расчетный код 1-го уровня	Торгово-клиринговый счет 1-го уровня			
1 <i>ExtSettleCode</i>	2 <i>TrdAcclId</i>			
77777	MB1234577777			
Расчетный код 2-го уровня	Торгово-клиринговый счет 2-го уровня	Идентификационные данные клиента/ Идентификатор Участника торгов	Наименование Участника торгов	Оказание услуг по ведению клиринговых регистров 3-го уровня по запросу Участника торгов
3 <i>ExtSettleCode</i>	4 <i>TrdAcclId</i>	5 <i>Details, SubDetails</i>	6 <i>TrdFirmName</i>	7 <i>ClearingFirmClient</i>
M27777700001	M27777700001			Нет
M27777700002	M27777700002			Нет
M27777700003	M27777700003			Нет
M27777700004	M27777700004			Нет
M27777700005	S200000007M8			Нет
M27777700006	S20000000BB7			Нет
M27777700007	S200000012DC			Нет

Расчетный код 3-го уровня	Торгово-клиринговый счет 3-го уровня	Идентификационные данные клиента	Дата открытия Торгово клирингового счета 3-го уровня
8 <i>ExtSettleCode</i>	9 <i>TrdAcclId</i>	10 <i>Details, SubDetails</i>	11 <i>OpenDate</i>

1. PK 1-го уровня из 5 цифр

2. ТКС 1-го уровня

3. PK 2-го уровня

4. ТКС 2-го уровня

5. Details - ИНН или № паспорта клиента участника клиринга
SubDetails - ИНН или № паспорта клиента субброкера

6. Наименование участника торгов

7. ClearingFirmClient : «Y» - Да / «N» - Нет

Также существуют атрибуты, не выведенные в бумажную форму:
OpenDate - Дата открытия Торгово-клирингового счета

Формы для Участника клиринга (ReportType=«CLEARING») и Участника торгов (ReportType=«TRADE») отличаются

ССХ20А – Отчет о торгово-клиринговых счетах 2-го и 3-го уровня (на валютном рынке)

Блок информации по расчетному коду 1-го уровня (**SETTLE12**) в отчет для Участника **торгов** **не включается**

Версия отчета для Участника **торгов**

ССХ20А

(в случае ReportType="TRADE"):

ОТЧЕТ О ТОРГОВО-КЛИРИНГОВЫХ СЧЕТАХ

Блок информации по расчетному коду 2-го уровня (**SETTLE23**)

Расчетный код 2-го уровня	Торгово-клиринговый счет 2-го уровня	Идентификационные данные клиента/ Идентификатор Участника торгов	Наименование Участника торгов	Оказание услуг по ведению клиринговых регистров 3-го уровня по запросу Участника торгов	Раскрытие Участнику клиринга информации о клиентах
3 <i>ExtSettleCode</i>	4 <i>TrdAcclId</i>	5 <i>Details, SubDetails</i>	6 <i>TrdFirmName</i>	7 <i>ClearingFirmClient</i>	8 <i>ClientInfo</i>
M27777700001	M27777700001			Нет	
M27777700002	M27777700002			Нет	
M27777700003	M27777700003			Нет	
M27777700004	M27777700004			Нет	
M27777700005	S200000007M8			Нет	
M27777700006	S20000000BB7			Нет	
M27777700007	S200000012DC			Нет	

ТКС старой нумерации

ТКС новой нумерации

Блок информации по расчетному коду 3-го уровня (**SETTLE3**)

Расчетный код 2-го уровня	Торгово-клиринговый счет 2-го уровня		
1 <i>ExtSettleCode</i>	2 <i>TrdAcclId</i>		
M27777700002	M27777700002		
Расчетный код 3-го уровня	Торгово-клиринговый счет 3-го уровня	Идентификационные данные клиента	Дата открытия Торгово клирингового счета 3-го уровня
8 <i>ExtSettleCode</i>	9 <i>TrdAcclId</i>	10 <i>Details, SubDetails</i>	11 <i>OpenDate</i>

1. PK 1-го уровня из 5 цифр
2. ТКС 1-го уровня
3. PK 2-го уровня
4. ТКС 2-го уровня

5. Details - ИНН или № паспорта клиента участника клиринга
SubDetails - ИНН или № паспорта клиента субброкера
6. Наименование участника торгов
7. ClearingFirmClient : «Y» - Да / «N» - Нет

Также существуют атрибуты, не выведенные в бумажную форму:
OpenDate - Дата открытия Торгово-клирингового счета

Формы для Участника клиринга (ReportType=«CLEARING») и Участника торгов (ReportType=«TRADE») отличаются.

EQM20 – Отчет о торгово-клиринговых счетах (на фондовом рынке)

Содержит информацию о Расчетных кодах, ТКС и идентификационных данных клиентов в случае их указания при регистрации ТКС. Формируются: ежедневно около 0:00 (EQM20_00Т), а также в случае изменений – до 9:00 (EQM20_001).

Отчет о торгово-клиринговых счетах
Понедельник 20.11.2023

Наименование участника клиринга: "Пример" (АО) (MC1234500000)
Идентификатор участника клиринга: MC1234500000

Информация о денежных позициях

Код денежной позиции: 55555

Тип денежной позиции	для учета собственных средств
Модель использования Расчетного кода	Расчетный код Участника клиринга, совпадающего в одном лице с Участником торгов
Без допуска к клирингу с частичным обеспечением по денежным средствам	Нет
Соответствие Расчетному коду имущественного пула	Нет
Соответствие Расчетному коду Единого пула	Нет
Соответствие Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений	
Расчетный код Обособленного клиента	Нет
Соответствие Расчетному коду со Специальным признаком	Нет

РК не имущественного пула («обычный РК»). Деньги.

Код валюты	Код организации	Наименование организации	Номер счета / Расчетный код	Номер счета обеспечения	Признаки переводов денежных средств		Основной Расчетный код для списания комиссионных вознаграждений	Взимается оборотная часть комиссионного вознаграждения	Изменения
					с T0 на T+ при исполнении	с T0 на T+ в размере нетто-обязательства			
CHF	NCC	НКЦ	55555	30420756531000055555			Нет	Нет	*
CNY	NCC	НКЦ	55555	30420156131000055555			Нет	Нет	*
EUR	NCC	НКЦ	55555	30420978131000055555			Нет	Нет	*
GBP	NCC	НКЦ	55555	30420826131000055555			Нет	Нет	*
KZT	NCC	НКЦ	55555	47405398130000055555			Нет	Нет	*
RUR	NCC	НКЦ	55555	30420810231000055555			Нет	Нет	*
RUR	NSD	НРД	30411810000008000345	30420810532000055555	Да	Нет	Нет	Нет	*
USD	NCC	НКЦ	55555	30420840531000055555			Нет	Нет	*

* Показывает наличие изменений

EQM20 – Отчет о торгово-клиринговых счетах (на фондовом рынке)

Содержит информацию о Расчетных кодах, ТКС и идентификационных данных клиентов в случае их указания при регистрации ТКС. Формируются: ежедневно около 0:00 (EQM20_00Т), а также в случае изменений – до 9:00 (EQM20_001).

Информация о торгово-клиринговых счетах

«Обычный» РК (не РК ИП). Бумаги.

Код денежной позиции: 55555

Торгово-клиринговые счета:

Код Торгово-клирингового счета	Наименование Торгово-клирингового счета	Состояние Торгово-клирингового счета	Счет депо	Раздел счета депо	Соответствие раздела счету	Признаки переводов ценных бумаг			Без допуска к клирингу с частичным обеспечением по ценным бумагам	Заключение сделок купли-продажи в случае неисполнения обязательств по Сделкам Т+	Торгово-клиринговый счет Единого пула	Приоритетный Торгово-клиринговый счет Обеспечения под стресс	Изменения
						с Т0 на Т+ при исполнении	с Т0 на Т+ в размере нетто-обязательства	с Т+ на Т0 в размере нетто-требования					
NCC+00055555	Технический счет - переводы	A							Нет	Нет	Нет	Нет	
NSD-00055555	Технический счет - переводы	A							Нет	Нет	Нет	Нет	
S02+00000F01	Счет обеспечения	A	HS1516171819	36MC1234500000F01	Счет в НРД	Нет	Нет	Нет	Нет	Нет	Нет	Нет	
S02-00000F01	ПРИМЕР (АО) (наш)	A	HS1516171819	31MC1234500000F01	Расчетный код	Да	Нет	Нет	Нет	Нет	Нет	Нет	

* Признак проведения изменений

Торгово-клиринговые счета:

Торгово-клиринговый счет для заключения депозитных договоров	Да
--	----

Код Торгово-клирингового счета	Наименование Торгово-клирингового счета	Состояние Торгово-клирингового счета	Изменения
00000055555	Основной, депозиты	A	

* Признак проведения изменений

РК имущественного пула. Бумаги.

Код денежной позиции: 77777

Торгово-клиринговые счета:

Код Торгово-клирингового счета	Наименование Торгово-клирингового счета	Состояние Торгово-клирингового счета	Субсчет депо	Соответствие ТКС Т+
S01b00000F01	пул GCBONDS	A	8SMC1234500000F01	S01+00000F01

EQM20 – Отчет о торгово-клиринговых счетах (на фондовом рынке)

РК имущественного пула. Деньги.

Код денежной позиции: 55555

Тип денежной позиции	для учета собственных средств
Модель использования Расчетного кода	Расчетный код Участника клиринга, совпадающего в одном лице с Участником торгов
Соответствие Расчетному коду имущественного пула	Да
Соответствие Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений	
Расчетный код Обособленного клиента	Нет
Соответствие Расчетному коду со Специальным признаком	Нет

Код валюты	Код организации	Наименование организации	Расчетный код	Номер счета обеспечения
CHF	NCC	НКЦ	55555	30420756534000055555
CNY	NCC	НКЦ	55555	30420156134000055555
EUR	NCC	НКЦ	55555	30420978134000055555
GBP	NCC	НКЦ	55555	30420826134000055555
HKD	NCC	НКЦ	55555	30420344234000055555
RUR	NCC	НКЦ	55555	30420810234000055555
USD	NCC	НКЦ	55555	30420840534000055555

EQM20A – Отчет о торгово-клиринговых счетах 2-го и 3-го уровня (на фондовом рынке)

Содержит информацию о Расчетных кодах, ТКС и идентификационных данных клиентов в случае их указания при регистрации ТКС. Формируются ежедневно:

- EQM20A_С01 – утром, до 9:00 – более полный с указанием таблиц по 3-му уровню, даже пустых;
- EQM20A_00С – около 0:00 после отчетного дня

EQM20A_С01

Расчетный код	Торгово-клиринговый счет			
55555	YGN+SPUTNB01			
Расчетный код 2-го уровня	Торгово-клиринговый счет 2-го уровня	Идентификационные данные клиента/ Идентификатор Участника торгов	Наименование Участника торгов	Оказание услуг по ведению клиринговых регистров 3-го уровня Участнику клиринга
100000123	Y200000021CD			Да

Расчетный код	Торгово-клиринговый счет			
66666	YV5+00000B83			
Расчетный код 2-го уровня	Торгово-клиринговый счет 2-го уровня	Идентификационные данные клиента/ Идентификатор Участника торгов	Наименование Участника торгов	Оказание услуг по ведению клиринговых регистров 3-го уровня Участнику клиринга
100000321	Y200000022A8			Да

EQM20A_00С

Расчетный код	Торгово-клиринговый счет			
55555	YGN+SPUTNB01			
Расчетный код 2-го уровня	Торгово-клиринговый счет 2-го уровня	Идентификационные данные клиента/ Идентификатор Участника торгов	Наименование Участника торгов	Оказание услуг по ведению клиринговых регистров 3-го уровня Участнику клиринга
100000123	Y200000021CD			Да

Расчетный код 2-го уровня	Торгово-клиринговый счет 2-го уровня		
100000123	Y200000021CD		
Расчетный код 3-го уровня	Торгово-клиринговый счет 3-го уровня	Идентификационные данные клиента	Дата открытия Торгово-клирингово счета 3-го уровня

Расчетный код	Торгово-клиринговый счет			
66666	YV5+00000B83			
Расчетный код 2-го уровня	Торгово-клиринговый счет 2-го уровня	Идентификационные данные клиента/ Идентификатор Участника торгов	Наименование Участника торгов	Оказание услуг по ведению клиринговых регистров 3-го уровня Участнику клиринга
100000321	Y200000022A8			Да

Расчетный код 2-го уровня	Торгово-клиринговый счет 2-го уровня		
100000321	Y200000022A8		
Расчетный код 3-го уровня	Торгово-клиринговый счет 3-го уровня	Идентификационные данные клиента	Дата открытия Торгово-клирингово счета 3-го уровня

EQM20A – Отчет о торгово-клиринговых счетах 2-го и 3-го уровня (на фондовом рынке)

Содержит информацию о Расчетных кодах, ТКС и идентификационных данных клиентов в случае их указания при регистрации ТКС. Формируются ежедневно:

- EQM20A_С01 – утром, до 9:00 – более полный с указанием таблиц по 3-му уровню, даже пустых;
- EQM20A_00С – около 0:00 после отчетного дня

Бумажная форма отчета для Участника торгов

Расчетный код 2-го уровня	Торгово-клиринговый счет 2-го уровня	Идентификатор Участника клиринга	Наименование Участника клиринга	Оказание услуг по ведению клиринговых регистров 3-го уровня Участнику клиринга	Раскрытие Участнику клиринга информации о клиентах

Расчетный код 2-го уровня	Торгово-клиринговый счет 2-го уровня		
Расчетный код 3-го уровня	Торгово-клиринговый счет 3-го уровня	Идентификационные данные клиента	Дата открытия Торгово-клирингового счета 3-го уровня

EQM28 – Отчет о дополнительных торговых разделах, открытых для проведения операций Участниками клиринга

Отчет предоставляется **Держателем**. Содержит информацию о ТКС, открытых участниками клиринга в привязке к Торговым счетам депо Держателя.

Формируется после 0:00 отчетного дня:

- в первый рабочий день месяца;
- в случае изменений (в том числе регистрации нового ТКС Участником клиринга).

EQM28

Отчет о дополнительных торговых разделах, открытых для проведения операций Участниками клиринга, и иных реквизитах Пятница 03.11.2023

Тип: Кредитная
Наименование держателя: Закрытое акционерное общество "Депозитарий"
Идентификатор держателя: MC0012300000

Наименование и идентификатор участника клиринга: АО "Участник клир-1" (MC0000100000)

Торгово-клиринговые счета:

Код Торгово-клирингового счета	Наименование Торгово-клирингового счета	Состояние Торгово-клирингового счета	Счет депо	Раздел счета депо	Признаки переводов ценных бумаг			Без допуска к клирингу с частичным обеспечением по ценным бумагам	Изменения
					с T0 на T+ при исполнении	с T0 на T+ в размере нетто-обязательства	с T+ на T0 в размере нетто-требования		
Y98-AMFOKB00	счет обеспечения	A	HL121212121A	36MC00001AMFOKB00			Нет	Нет	
Y98-AMFOKB00	Клиент (кл. в ЗАО Деп)	A	HL121212121A	31MC00001AMFOKB00	Да	Нет	Нет	Нет	
Y00-00001CE7	T0, кл. в ЗАО Деп	N	HL121212121A	31MC00001SEME1B00	Да	Нет	Нет	Нет	

* Признак проведения изменений по параметрам торгово-клиринговых счетов

Наименование и идентификатор участника клиринга: ООО "Участник кл-2" (MC0015300000)

Торгово-клиринговые счета:

Код Торгово-клирингового счета	Наименование Торгово-клирингового счета	Состояние Торгово-клирингового счета	Счет депо	Раздел счета депо	Признаки переводов ценных бумаг			Без допуска к клирингу с частичным обеспечением по ценным бумагам	Изменения
					с T0 на T+ при исполнении	с T0 на T+ в размере нетто-обязательства	с T+ на T0 в размере нетто-требования		
Y12-HOGDUB05	Счет обеспечения	A	HL121212121A	36MC00123HOGDUB05			Нет	Да	
Y8S-RGFKIB00	Счет обеспечения	A	HL121212121A	36MC00123RGFKIB00			Нет	Да	
YV4-0000VB00	Счет обеспечения	A	HL121212121A	36MC001230000VB00			Нет	Да	
Y00+00000A2C	T+, клиент в ЗАО Депозитарий	A	HL121212121A	36MC00123GPB11B00			Нет	Нет	*

* Признак проведения изменений по параметрам торгово-клиринговых счетов

Информация о ТКС
в разрезе
Участников
клиринга

Тип Держателя: «Некредитная», «Кредитная»

Состояние ТКС: А – активный; N – не активный

EQM30, ССХ19 – Отчеты о клиринговых идентификаторах

Содержит информацию о полномочиях клиринговых идентификаторов.

Формируется после 0:00 отчетного дня:

- в первый рабочий день месяца;
- в случае изменения клиринговых полномочий – вечером после 20:00.

На валютном рынке

ССХ19

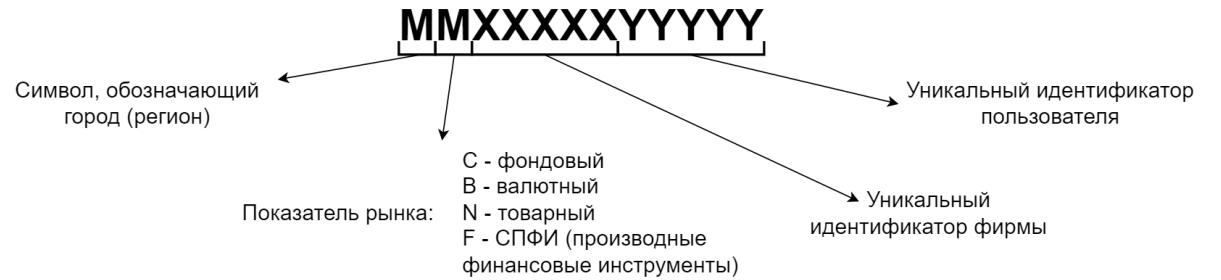
ОТЧЕТ О КЛИРИНГОВЫХ ИДЕНТИФИКАТОРАХ

Дата, за которую сформирован отчет: 01.11.2023

Идентификатор Участника клиринга: MB1234500000

Наименование Участника клиринга: Пример (АО)

Клиринговый идентификатор	Полномочия Клирингового идентификатора				Изменения
	Клиринговый менеджер	Оператор	Переводы	Внебиржевые сделки с иностранной валютой	
MD1234500094	Нет	Да	Да	Нет	Нет
MD1234500149	Нет	Да	Да	XAUUSD_SPT GBPUSD_SPT USDCNY_SPT USDJPY_SPT USDTRY_TOM EURUSD_SPT RUBKZT_TOM	Нет
MD123450030C	Нет	Да	Да	Нет	Нет
MD1234500310	Нет	Да	Да	Нет	Нет
MD1234500528	Да	Да	Да	XAUUSD_SPT GBPUSD_SPT USDCNY_SPT USDJPY_SPT USDTRY_TOM EURUSD_SPT RUBKZT_TOM	Нет



или

Код пользователя:
U - пользователь фондового рынка
D - пользователь валютного рынка

На фондовом рынке

EQM30

Отчет о Клиринговых идентификаторах

Понедельник 06.11.2023

Наименование участника клиринга: Пример (публичное акционерное общество) (MC1234500000)

Идентификатор участника клиринга: MC1234500000

Клиринговый идентификатор	Полномочия Клирингового идентификатора			Изменения
	Клиринговый менеджер	Оператор	Переводы	
MU123450043C	Нет	Да	Да	
MU1234500506	Нет	Да	Да	
MU1234500528	Нет	Да	Да	
MU1234502489	Нет	Нет	Нет	
MU123450249A	Нет	Нет	Нет	
MU123450250B	Нет	Нет	Нет	
MU123450251C	Да	Да	Да	
MU1234502520	Да	Да	Да	*

* Признак проведения изменений

EQM92, EQM93, ССХ94, EQM94

—

отчеты об обеспечении на Расчетных
кодах Гарантийных фондов и
Обеспечения под стресс и риски
концентрации на эмитента

EQM92 - Отчет о Гарантийных фондах

Отчет направляется при наличии остатков на РК ГФ.

Не используются для заключения сделок Участниками клиринга.

В Гарантийные фонды принимаются российские рубли, ОФЗ, ГОВОЗ

Актуальный перечень ценных бумаг, принимаемых в качестве вноса в ГФ: [Параметры ценных бумаг](#)

Время формирования – до 9:00 отчетного дня

ГФ

Да ▾

[Подробнее о Гарантийных фондах](#)

EQM92

Отчет о гарантийных фондах
Дата отчета: 20.11.2023

Наименование участника клиринга: АО ПРИМЕР (MC12345000000)

Расчетный код для учета взносов в гарантийные фонды: 11111

Торгово-клиринговый счет для учета взносов в гарантийные фонды: F01+00000F01

Номер субсчета депо для учета взносов в гарантийные фонды: 9HMC12345000000F01

Краткий код актива	Наименование актива	Количество актива	Лимит приема в обеспечение, %	Оценочная стоимость актива, руб.
SU29006RMFS2	ОФЗ 29006	25,000	100.00	23,173,250.00
RUR	руб.	10,000,000.00	100.00	10,000,000.00
Общая оценочная стоимость активов, руб.				33,173,250.00

Гарантийный фонд, созданный в соответствии с Правилами клиринга	Минимальный размер вноса в Гарантийный фонд, руб.
на срочном рынке	0.00
на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов	10,000,000.00
на валютном рынке и рынке драгоценных металлов	10,000,000.00
на товарном рынке	0.00
на рынке Стандартизированных ПФИ	0.00

Свободные средства, руб.	13,173,250.00
--------------------------	---------------

EQM93 - Отчет об Обеспечении под стресс

EQM93

Отчет об Обеспечении под стресс
Дата отчета: 15.11.2023

Наименование участника клиринга: АО Пример (MC1234500000)

Расчетный код для учета Обеспечения под стресс: 22222

Торгово-клиринговый счет для учета Обеспечения под стресс: G00+0000060B

Номер субсчета депо для учета Обеспечения под стресс: HCMC1234500000F00

Краткий код актива	Наименование актива	Количество актива	Лимит приема в обеспечение, %	Оценочная стоимость актива, руб.
XS0114288789	RUS-30	10,100,000	100.00	75,931,220.00
SU26239RMFS2	ОФЗ 26239	1,542,369	100.00	1,072,040,881.07
SU26237RMFS6	ОФЗ 26237	1,547,351	100.00	1,157,573,269.82
RU000A1034K8	RUS-36 EUR	30	100.00	191,902,396.20
RU000A102CK5	RUS-27 EUR	80	100.00	577,786,242.40
SU26236RMFS8	ОФЗ 26236	1,000,000	100.00	732,590,000.00
SU26232RMFS7	ОФЗ 26232	700,000	100.00	541,275,000.00
RU000A0ZZVE6	RUS-25 EUR	100	100.00	819,496,688.00
SU52002RMFS1	ОФЗ 52002	316,809	100.00	385,879,698.18
SU29006RMFS2	ОФЗ 29006	3,334,632	100.00	3,100,460,128.08
SU26212RMFS9	ОФЗ 26212	1,600,000	100.00	1,289,670,000.00
RUR	руб.	2,140,000,000.00	100.00	2,140,000,000.00
Общая оценочная стоимость активов, руб.				12,084,605,523.75

Обеспечение под стресс, внесенное в соответствии с Правилами клиринга	Минимальный размер Обеспечения под стресс, руб.
на срочном рынке	4,272,500,000.00
на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов	7,723,500,000.00
на валютном рынке и рынке драгоценных металлов	0.00
на товарном рынке	0.00
на рынке Стандартизированных ПФИ	0.00
Свободные средства, руб.	88,605,523.75

Отчет направляется при наличии остатков на РК ОпС

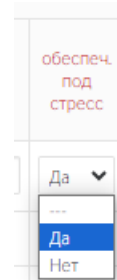
Не используются для заключения сделок
Участниками клиринга

[Методика определения размера Обеспечения под стресс](#) раскрывается на сайте НКЦ

В качестве ОпС принимаются: RUR, CNY, ОФЗ, ГОВОЗ
(см. актуальный [перечень ценных бумаг](#))

Время формирования – до 9:00 отчетного дня

[Подробнее об Обеспечении под стресс](#)



ССХ94 - Уведомление о минимальном размере Обеспечения под стресс

Отчет формируется в случае необходимости внесения Обеспечения под стресс.

Время формирования – до 10:00 отчетного дня

УВЕДОМЛЕНИЕ О МИНИМАЛЬНОМ РАЗМЕРЕ ОБЕСПЕЧЕНИЯ ПОД СТРЕСС

Дата формирования отчета: 21.11.2023

Наименование Участника клиринга: Пример (АО)

Идентификатор Участника клиринга: 1234500000

Расчетный код для учета Обеспечения под стресс: 22222

Дата начала действия минимального размера Обеспечения под стресс: 21.11.2023

Рынок	Минимальный размер Обеспечения под стресс, руб.	Расчетный размер Обеспечения под стресс, руб.
Валютный рынок и рынок драгоценных металлов	0.00	4,500,000.00

Дата формирования отчета: 22.11.2023

Наименование Участника клиринга: Пример (АО)

Идентификатор Участника клиринга: 1234500000

Расчетный код для учета Обеспечения под стресс: 22222

Дата начала действия минимального размера Обеспечения под стресс: 22.11.2023

Рынок	Минимальный размер Обеспечения под стресс, руб.	Расчетный размер Обеспечения под стресс, руб.
Валютный рынок и рынок драгоценных металлов	4,500,000.00	83,500,000.00
Фондовый рынок и рынок депозитов	0.00	0.00
Срочный рынок	0.00	0.00
Рынок СПФИ	0.00	0.00

Утром 21.11 Участнику приходит Уведомление о том, что на 22.11 рассчитан размер ОпС. Зачислить обеспечение необходимо до 17:30 22.11.

В Уведомлении 22.11 указывается Минимальный размер ОпС, рассчитанный 21.11, а также сообщается Расчетный размер на следующий день (23.11).

EQM94 - Отчет об Обеспечении под риски концентрации на эмитентов

Отчет содержит информацию об открытых РК и ТКС для учета обеспечения под риски концентрации на эмитентов (ОпРКЭ), а также о внесенном обеспечении в разрезе активов.

Не используются для заключения сделок Участниками клиринга.

В качестве ОпРКЭ принимаются российские рубли, ОФЗ, ГОВОЗ (см. [Перечень активов, принимаемых в качестве Обеспечения под РКЭ](#))

[Подробнее об ОпРКЭ](#)

EQM94

Отчет об Обеспечении под риск концентрации на эмитента

Дата отчета: 15.11.2023

Наименование участника клиринга: **Закрытое акционерное общество коммерческий банк (МС0012300000)**

Расчетный код для учета Обеспечения под риск концентрации на эмитента: **00123**

Торгово-клиринговый счет для Обеспечения под риск концентрации на эмитента: **F01+00000F00**

Номер субсчета депо для учета Обеспечения под риск концентрации на эмитента: **H0022222222**

Краткий код актива	Наименование актива	Количество актива	Оценочная стоимость актива, руб.
SU25085RMFS0	ОФЗ 25085	100	86,582.00
RUR	руб.	5,000,000.00	5,000,000.00
Общая оценочная стоимость активов, руб.			5,086,582.00

Требование по обеспечению риска концентрации на эмитента, руб.	10,000,000.00
---	----------------------

Свободные средства, руб.	0.00
---------------------------------	-------------

В данном случае (величина требований превышает оценочную стоимость активов) Единый лимит по РК становится отрицательным, возникает Маргинальное требование

EQM12 и ССХ12 – Уведомления о замене торгово-клирингового счета

Функционал замены ТКС 1-го уровня в сделках используется Участниками клиринга при перераспределении обслуживаемых клиентов между ТКС и при ошибочном заключении сделки с указанием не того ТКС.

Функционал также позволяет объединять ТКС и РК 1-го уровня, переводя часть клиентов на ТКС и РК 2-го и 3-го уровней.

Время формирования – около 0:00 после отчетного дня (дня замены ТКС)

На валютном рынке

ССХ12

Уведомление о замене торгово-клирингового счета

Дата: 07.11.2023

Идентификатор Участника клиринга: MB1234500000

Наименование Участника клиринга: ООО "Пример"

№	Номер сделки	Дата заключения	Направление	Код ТКС до замены	Код ТКС после замены
RecNo	TradeNo	TradeDate	BuySell	TrdAcclIdOld	TrdAcclIdNew
1	555537567	07.11.2023	П	MB1234511111	MB1234522222
2	555540067	07.11.2023	К	MB1234511111	MB1234522222
3	555540069	07.11.2023	К	MB1234511111	MB1234522222

Структура XML-файла отчета ССХ12 также предусматривает атрибуты:

TradeTime - Время заключения сделки

ClientCode - Краткий Код Клиента

Type - Тип обязательств, варианты значений:

T - обычная сделка,

S - сделка своп,

N - внебиржевая сделка с иностранной валютой,

W - внебиржевая сделка своп/ своп контракт

Запрос на замену ТКС в сделках доступен для всех ТКС на ФР и ВР, кроме типов «ДУ, депозиты» и «Основной, депозиты». Возможен множественный отбор сделок по коду клиента или номеру/направлению сделок.

«Запрос на замену Торгово-клирингового счета в сделках» подается через API Клирингового терминала (формат TrdAccReplace, см. ФЭС КТ) или по ЭДО (формат REPTRA, см. ФИФ ОЧ).

На фондовом рынке

EQM12

Уведомление о замене торгово-клирингового счета

Вторник 07.11.2023

Наименование участника клиринга: Пример (АО) (MC1234500000)

Идентификатор участника клиринга: MC1234500000

№ п.п.	Номер сделки (или Комп. взноса)	Дата заключения	Направление сделки	Код Торгово-клирингового счета до замены	Код Торгово-клирингового счета после замены
1	1111101367	07.11.2023	S	S01+00000F01	M01+00000V01
2	1111101369	07.11.2023	S	S01+00000F01	M01+00000V01

Структура XML-файла отчета EQM12 также предусматривает атрибуты:

ClientCode - Краткий Код Клиента

Type - Тип обязательств, варианты значений:

R - первая часть сделки РЕПО,

r - вторая часть сделки РЕПО,

N - сделка РПС,

D - компенсационный взнос

EQM14, ССХ11

—

отчеты о маржинальных требованиях

EQM14 и ССХ11 – Отчеты о маржинальных требованиях

Предоставляется в случае возникновения маржинального требования. Содержит информацию о сумме маржинального требования по каждому Расчетному коду, на котором возникло маржинальное требование.

Время формирования – с 10:00 до 10:15 отчетного дня.

На валютном рынке

На фондовом рынке

Исх. №: 099999999/СС от 15.11.2023 10:05:15

ССХ11

НКО НКЦ (АО)

ОТЧЕТ О МАРЖИНАЛЬНОМ ТРЕБОВАНИИ

Дата, за которую сформирован отчет: 15.11.2023

Идентификатор Участника клиринга: МВ1234500000

Наименование Участника клиринга: АО "Пример"

Маржинальное требование должно быть исполнено в срок до: 17:30 мск. 15.11.2023

Расчетный код	Сумма Маржинального требования, руб.
44444	1,600,631.94

Исх. №: 099999999/EQ от 15.11.2023

EQM14

Небанковская кредитная организация-центральный контрагент
«Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество)

Отчет о маржинальных требованиях

Дата отчета: 15.11.2023

Наименование участника клиринга: АО Пример (МС1234500000)

Идентификатор участника клиринга: МС1234500000

Маржинальное требование должно быть исполнено в срок до: 17:30 мск. 15.11.2023

Расчетный код	Вид Расчетного кода	Сумма Маржинального требования, руб.
55555	Расчетный код для учета обеспечения	187,230,474.67
66666	Расчетный код имущественного пула	122,365,295.90

СПАСИБО ЗА ВНИМАНИЕ

Управление продвижения и информационной
поддержки клиринговых услуг:
Константин Кропанцев, ps@moex.com