**Описание изменений в клиринговые отчеты к релизу**

**I Изменения в клиринговые отчеты в рамках процедуры портабилити**

В рамках процедуры портабилити, проводимой в отношении [Обособленного клиента](https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/020904), предоставившего в НКЦ Заявление на перевод обязательств и Обеспечения от Базового участника клиринга к Участнику клиринга-реципиенту, предусмотрены отдельные клиринговые отчеты:

* **На фондовом рынке:**

1. Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (EQM06R) – является аналогом текущего отчета EQM06, предоставляется Участнику клиринга-реципиенту перед проведением процедуры портабилити

*(содержит в разрезе Расчетных кодов Обособленного клиента, зарегистрированных у Базового Участника клиринга, информацию о сделках с ЦК, подлежащих исполнению, заключенных с указанием ТКС Обособленного клиента, обязательства по которым будут исполнены Участником клиринга-реципиентом)*;

1. Отчет об обязательствах по передаче/требованиях по получению Дохода (EQM98R) – является аналогом отчета EQM98, предоставляется Участнику клиринга-реципиенту перед проведением процедуры портабилити

*(содержит в разрезе Расчетных кодов Обособленного клиента, зарегистрированных у Базового Участника клиринга, информацию об обязательствах/требованиях по передаче Дохода);*

1. Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (EQM06Р) - является аналогом текущего отчета EQM06, предоставляется Участнику клиринга-реципиенту после проведения процедуры портабилити

(*содержит в разрезе Расчетных кодов Участника клиринга-реципиента информацию о сделках, обязательства по которым были к нему переведены, с новым и единственным типом* ***InfType=9*** *– Сделки, обязательства по которым были переведены к Участнику клиринга в ходе процедуры Перевода обязательств и Обеспечения в соответствии с Правилами клиринга НКО НКЦ (АО).*

1. Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (EQM06Р) - является аналогом текущего отчета EQM06, предоставляется Базовому Участнику клиринга после проведения процедуры портабилити

*(содержит в разрезе Расчетных кодов Обособленного клиента Базового Участника клиринга информацию о сделках, обязательства по которым были переведены к Участнику клиринга-реципиенту, с новым типом InfType=8 – Сделки, обязательства по которым были переведены от Участника клиринга в ходе процедуры Перевода обязательств и Обеспечения в соответствии с Правилами клиринга НКО НКЦ (АО).*

1. Реализуется новый клиринговый отчет - Информация о размере Обеспечения, задолженности и Едином лимите (EQM184R), предоставляется Участнику клиринга-реципиенту перед проведением процедуры портабилити

*(содержит в разрезе Расчетных кодов Обособленного клиента, зарегистрированных у Базового Участника клиринга на фондовом рынке, информацию об обеспечении в денежных средствах/ драгоценных металлах или задолженности, Едином лимите, а также информацию об обеспечении в ценных бумагах на ТКС, соответствующих каждому Расчетному коду Обособленного клиента)*

* **На валютном рынке:**

1. Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (CCX43R) - является аналогом текущего отчета ССХ43, предоставляется Участнику клиринга-реципиенту перед проведением процедуры портабилити

*(содержит в разрезе Расчетных кодов Обособленного клиента, зарегистрированных у Базового Участника клиринга, информацию о сделках, подлежащих исполнению, заключенных с указанием ТКС Обособленного клиента, обязательства по которым будут исполнены Участником клиринга-реципиентом);*

1. Отчет об обязательствах по ПФИ (ССХ17R) - является аналогом отчета ССХ17, предоставляется Участнику клиринга-реципиенту перед проведением процедуры портабилити

*(содержит в разрезе Расчетных кодов Обособленного клиента, зарегистрированных у Базового Участника клиринга, информацию об обязательствах/требованиях по вариационной марже);*

1. Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (ССХ43Р) - является аналогом текущего отчета ССХ43, предоставляется Участнику клиринга-реципиенту после проведения процедуры портабилити и

*(содержит в разрезе Расчетных кодов Участника клиринга-реципиента информацию о сделках, обязательства по которым были к нему переведены, с новым и единственным типом* ***InfType=9*** *– Сделки, обязательства по которым были переведены к Участнику клиринга в ходе процедуры Перевода обязательств и Обеспечения в соответствии с Правилами клиринга НКО НКЦ (АО).*

1. Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (ССХ43Р) - является аналогом текущего отчета ССХ43, предоставляется Базовому Участнику клиринга после проведения процедуры портабилити

*(содержит в разрезе Расчетных кодов Обособленного клиента Базового Участника клиринга информацию о сделках, обязательства по которым были переведены к Участнику клиринга-реципиенту, с новым типом* ***InfType=8*** *– Сделки, обязательства по которым были переведены от Участника клиринга в ходе процедуры Перевода обязательств и Обеспечения в соответствии с Правилами клиринга НКО НКЦ (АО).*

             В типовые отчеты EQM06 и ССХ43 InfType=8 и InfType=9 не добавляются.

1. По аналогии с фондовым рынком реализуется новый клиринговый отчет на валютном рынке - Информация о размере Обеспечения, задолженности и Едином лимите (ССХ184R), предоставляется Участнику клиринга-реципиенту перед проведением процедуры портабилити

*(содержит в разрезе Расчетных кодов Обособленного клиента, зарегистрированных у Базового Участника клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, информацию об обеспечении в денежных средствах/ драгоценных металлах или задолженности, Едином лимите, а также информацию об обеспечении в ценных бумагах на ТКС, соответствующих каждому Расчетному коду Обособленного клиента)*

**II Изменения в Отчет об обязательствах по передаче/требованиях по получению Дохода (EQM98)**

Меняется XSLT-стиль Отчета об обязательствах по передаче/требованиях по получению Дохода (EQM98). В печатную форму отчета добавляется колонка «Дата и время исполнения обязательств по передаче Дохода», которая заполняется соответствующими значениями полей SettleDate и SettleTime.

**III Изменения в Отчет о движении денежных средств (ССХ99)** перенесено на 23.11.20

1. Уточняется порядок заполнения суффикса в имени файла ССХ99.

Имя файла ССХ99: <АВNNNNN> <ССХ99> <RRТ> <ДДММГГ> <ХХХХХХХХХ>,

где       АВNNNNN - Идентификатор Участника клиринга;

ССХ99 – код отчета;

**RRТ** – суффикс отчета;

ДДММГГ – дата формирования отчета;

ХХХХХХХХХ – номер документа ЭДО

Суффикс RRT будет принимать следующие значения:

RR:

EQ – фондовый рынок и рынок депозитов;

CU – валютный рынок и рынок драгоценных металлов;

FU – срочный рынок;

OT – рынок СПФИ;

CO – товарный рынок.

Т:

1 – соответствует REPORT\_TYPE = «1» – по всем Расчетным кодам;

2 – соответствует REPORT\_TYPE = «2» – по отдельному Расчетному коду;

3 – соответствует REPORT\_TYPE = «3» – по отдельному счету.

1. Меняется порядок заполнения поля «TRADE\_DATE». В настоящее время поле «TRADE\_DATE» заполняется календарной датой формирования отчета, а будет заполняться датой проведения операций, указанных в отчете, независимо от времени и даты формирования отчета.

**IV Изменения в Уведомление о списании и зачислении на Счет обеспечения (ССХ97)/ Отмена уведомления о списании и зачислении на Счет обеспечения (ССХ96)** перенесено на 23.11.20

Уточняется порядок заполнения суффикса в имени файла ССХ97, ССХ96.

Имя файла ССХ97/ССХ96:

<АВNNNNN> <ССХ99> <RRТ> <ДДММГГ> <ХХХХХХХХХ>,

Суффикс RRT будет принимать следующие значения:

RR:

EQ – фондовый рынок и рынок депозитов;

CU – валютный рынок и рынок драгоценных металлов;

FU – срочный рынок;

OT – рынок СПФИ;

CO – товарный рынок.

Т:

4 – платежное поручение;

5 – мемориальный ордер.