



МОЕХ

**НАЦИОНАЛЬНЫЙ
КЛИРИНГОВЫЙ
ЦЕНТР**

УПРАВЛЯЙТЕ ЛИКВИДНОСТЬЮ ЭФФЕКТИВНО!
ЗНАКОМСТВО С ИНСТРУМЕНТАМИ ДЕНЕЖНОГО
РЫНКА.

ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ СДЕЛОК РЕПО С ПЛАВАЮЩЕЙ СТАВКОЙ

Основные клиринговые отчеты для участника рынка РЕПО с ЦК

Основные:

EQM06- Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг

EQM13 - Отчет об Итоговых нетто-обязательствах / нетто-требованиях

EQM23 - Отчет об обязательствах по Сделкам Т+

EQM15 - Отчет по обязательствам участника клиринга по комиссионному вознаграждению

ССХ99 - Отчет о движении денежных средств

Описание структуры клиринговых отчетов:

- [НКЦ | Часть II. Формы и форматы документов и отчетов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов. \(nationalclearingcentre.ru\)](http://nationalclearingcentre.ru)
- [Московская Биржа | Рынки \(moex.com\)](http://moex.com)

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)

Импорт XML... ? X

Открываемый файл содержит таблицы стилей. Выберите требуемое действие:

☒ открыть файл, не применяя таблицу стилей

☐ открыть файл, применив следующую таблицу стилей (выберите одну):

OK Отмена

Открытие XML ? X

Выберите способ открытия этого файла:

☒ XML-таблица

☐ книга, доступная только для чтения

☐ использовать область задач XML-источника

OK Отмена Справка

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M
1	DOC_DATE	DOC_TIME	DOC_NO	DOC_TYPE_ID	SENDER_ID	SENDER_NAME	RECEIVER_ID	REMARKS	ReportDate	PoolCode	PoolName	CPCNomValueSum	HValue
2	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
3	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
4	01.11.2022	10:01:49	023667388/EQ	EQM46	MC0888800000		MM0000100000		01.11.2022	GCSHARES	Имущественный пул «GC Shares»: все акции, принимаемые НКЦ в обеспече	27457935541	0,35

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)

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



EQM06. Тип информации (InfType)

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

SettleDate Дата исполнения: 02.11.2022

BoardName ДЕПОЗИТЫ с ЦК 1 день (CNY)

№ 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
-------	--------------	--------------	-----------------	----------------	--------------	-----------------------	-------------------	-----------------------------	--------------------------------	---------------------	--

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)											
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 расчетов: 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	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 исполнения 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
1	6780000002	1	01.11.2022	S	Y0Y1				21,491,676.00						-21,491,676.00			0.3000000		000000012345	О НКД (АО)		5550000001			19:39:09	19:39:09	Нет

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	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 исполнения 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
2	6780000002	2	01.11.2022	S	Y0Y1				21,491,852.64						21,491,852.64			0.3000000		000000012345	О НКД (АО)		5550000001					Нет

EQM06. Пример сделки с пл. ставкой

```
<INFTYPE InfType="2">
  <CLEARINGTYPE ClearingType="C">
    <SESSION Session="1">
      <SETTLEDATE SettleDate="2023-03-06">
        <INSTRTRADE InstrType="S">
          <BOARD BoardId="EQRP" BoardName="РЕПО с ЦК 1 день">
            <BOARD BoardId="EQWP" BoardName="РЕПО с ЦК 7 дн.">
              <BOARD BoardId="FCTM" BoardName="РЕПО с ЦК с КСУ пл. 3 мес.">
                <SECURITY SecurityId="RU000A0JW4Z1" ISIN="RU000A0JW4Z1" SecShortName="КСУ обл." PriceType="CASH">
                  <RECORDS RecNo="16" TradeNo="3461" TradeDate="2023-03-06" TradeTime="10:20:58" BuySell="S" SettleCode="Y0" Decimals="3" Price="1" Quantity="10000000" Value="10000000" AccInt="0" Amount="10000000" Balance="10000000" ExchComm="315" ClrComm="798" TrdAccId="S01+00000F00" CPFirmId="MC" CPFirmShortName="НКО НКЦ (АО)" Price2="1.019" RepoPart="1" ReportTime="16:43:25" SettleTime="17:41:41" DueDate="2023-03-06" EarlySettleStatus="N" RepoRate="0.14" RateType="FLOATING" Benchmark="RUSFAR" BenchmarkRate="7.67" />
```

EQM06 за 6 марта:

RUSFAR	03.03.2023	7,67
RUSFAR	06.03.2023	7,67
RUSFAR	07.03.2023	7,72
RUSFAR	09.03.2023	7,49
RUSFAR	10.03.2023	7,22
RUSFAR	13.03.2023	7

```
<INFTYPE InfType="3">
  <CLEARINGTYPE ClearingType="C">
    <SESSION>
      <SETTLEDATE SettleDate="2023-03-07">
      <SETTLEDATE SettleDate="2023-03-13">
      <SETTLEDATE SettleDate="2023-06-02">
        <INSTRTRADE InstrType="S">
          <BOARD BoardId="FCTM" BoardName="РЕПО с ЦК с КСУ пл. 3 мес.">
            <SECURITY SecurityId="RU000A0JW4Z1" ISIN="RU000A0JW4Z1" SecShortName="КСУ обл." PriceType="CASH">
              <RECORDS RecNo="93" TradeNo="3461" TradeDate="2023-03-06" TradeTime="10:20:58" BuySell="B" SettleCode="Y3M" Decimals="3" Price="1.019" Quantity="10000000" Value="10187572.6" AccInt="0" Amount="10187572.6" Balance="10000000" ExchComm="0" ClrComm="0" TrdAccId="S01+00000F00" CPFirmId="MC" CPFirmShortName="НКО НКЦ (АО)" Price2="1.019" RepoPart="2" DueDate="2023-06-02" EarlySettleStatus="N" RepoRate="0.14" RateType="FLOATING" Benchmark="RUSFAR" BenchmarkRate="7.67" CurRepoRate="7.81" RepoSum="10187572.6" />
```

В отчете за 7 марта сделки нет, т.к. значение RUSFAR не изменилось, 8 марта – выходной
EQM06 за 9 марта:

```
<INFTYPE InfType="6">
  <CLEARINGTYPE ClearingType="C">
    <SESSION Session="0">
      <SETTLEDATE SettleDate="2023-04-28">
      <SETTLEDATE SettleDate="2023-06-02">
        <INSTRTRADE InstrType="S">
          <BOARD BoardId="FCTM" BoardName="РЕПО с ЦК с КСУ пл. 3 мес.">
            <SECURITY SecurityId="RU000A0JW4Z1" ISIN="RU000A0JW4Z1" SecShortName="КСУ обл." PriceType="CASH">
              <RECORDS RecNo="51" TradeNo="13461" TradeDate="2023-03-06" TradeTime="10:20:58" BuySell="B" SettleCode="Y3M" Decimals="3" Price="1.019" Quantity="10000000" Value="10187572.6" AccInt="0" Amount="10187572.6" Balance="10000000" TrdAccId="S01+00000F00" CPFirmId="MC" CPFirmShortName="НКО НКЦ (АО)" Price2="1.019" RepoPart="2" DueDate="2023-06-02" EarlySettleStatus="N" RepoRate="0.14" RateType="FLOATING" Benchmark="RUSFAR" BenchmarkRate="7.72" CurRepoRate="7.86" RepoSum="10189016.44" />
```

EQM06 за 13 марта:

```
<INFTYPE InfType="6">
  <CLEARINGTYPE ClearingType="C">
    <SESSION Session="0">
      <SETTLEDATE SettleDate="2023-04-28">
      <SETTLEDATE SettleDate="2023-06-02">
        <INSTRTRADE InstrType="S">
          <BOARD BoardId="FCTM" BoardName="РЕПО с ЦК с КСУ пл. 3 мес.">
            <SECURITY SecurityId="RU000A0JW4Z1" ISIN="RU000A0JW4Z1" SecShortName="КСУ обл." PriceType="CASH">
              <RECORDS RecNo="125" TradeNo="3461" TradeDate="2023-03-06" TradeTime="10:20:58" BuySell="B" SettleCode="Y3M" Decimals="3" Price="1.019" Quantity="10000000" Value="10187572.6" AccInt="0" Amount="10187572.6" Balance="10000000" TrdAccId="S01+00000F00" CPFirmId="MC" CPFirmShortName="НКО НКЦ (АО)" Price2="1.019" RepoPart="2" DueDate="2023-06-02" EarlySettleStatus="N" RepoRate="0.14" RateType="FLOATING" Benchmark="RUSFAR" BenchmarkRate="7.22" CurRepoRate="7.36" RepoSum="10188832.88" />
```

Изменения в клиринговых отчетах для сделок РЕПО с «Открытой датой» (планируемые)

EQM06 – Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг

Нода	Атрибут	Описание	Обязательность	Тип	Кол-во символов
SETTLEDATE		Блок данных по дате расчётов	Обязательный		
	SettleDate	Фактическая дата расчетов / Дата исполнения / Максимально допустимый срок исполнения второй части сделки РЕПО с «Открытой датой»	Обязательный	Date	
RECORDS		Блок данных по сделке/ заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений/ депозитному договору/ кредитному договору	Обязательный		
	DueDate	Дата исполнения / Максимально допустимый срок РЕПО с «Открытой датой»	Обязательный	Date	
	OpenRepo	Признак сделки РЕПО с «Открытой датой»: «Y» - да.	Не обязательный	Character	1

Клиринговая комиссия за ежедневный перенос даты исполнения второй части сделки отражается операцией с отдельным кодом (FeeType в EQM15, TRANTYPE в CCX99):

308 – «Фондовый рынок. Сумма клиринговой комиссии по сделкам РЕПО с «Открытой датой»»

Комиссии нарастающим итогом планируется отражать в новом отчете, с параметрами:

- Номер сделки (который был показан в EQM06 при заключении);
- Дата заключения сделки;
- Валюта торгов;
- Данные по ценной бумаге;
- Комиссия за клиринг, начисленная в отчетный день;
- Дата списания комиссии за клиринг с учетом календаря расчетных дней;
- Комиссия по сделке нарастающим итогом (начисленная).

СПАСИБО ЗА ВНИМАНИЕ

• Настоящая презентация была подготовлена и выпущена Небанковской кредитной организацией – центральным контрагентом «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) (далее – «НКО НКЦ АО»). Если нет какой-либо оговорки об ином, то НКО НКЦ АО считается источником всей информации, изложенной в настоящем документе. Данная информация предоставляется по состоянию на дату настоящего документа и может быть изменена без какого-либо уведомления.

• Настоящая презентация не представляет собой рекламу или публичное предложение ценных бумаг в какой-либо юрисдикции. Данная презентация не предназначена для публичного распространения в какой-либо юрисдикции.

• Данный документ не является, не формирует и не должен рассматриваться в качестве предложения или же приглашения для продажи или участия в подписке, или же, как побуждение к приобретению или же к подписке на какие-либо ценные бумаги, а также этот документ или его часть или же факт его распространения не являются основанием и на них нельзя полагаться в связи с каким-либо предложением, договором, обязательством или же инвестиционным решением, связанными с ним, равно как и он не является рекомендацией относительно ценных бумаг НКО НКЦ АО.

• Изложенная в данном документе информация не являлась предметом независимой проверки. В нем также не содержится каких-либо заверений или гарантий, сформулированных или подразумеваемых и никто не должен полагаться на достоверность, точность и полноту информации или мнения, изложенного здесь. Никто из НКО НКЦ АО или каких-либо его дочерних обществ или аффилированных лиц или их директоров, сотрудников или работников, консультантов или их представителей не принимает какой-либо ответственности (независимо от того, возникла ли она в результате халатности или чего-то другого), прямо или косвенно связанной с использованием этого документа или иным образом возникшей из него.

• Данная презентация содержит прогнозные заявления. Все включенные в настоящую презентацию заявления, за исключением заявлений об исторических фактах, включая, но, не ограничиваясь, заявлениями, относящимися к нашему финансовому положению, бизнес-стратегии, планам менеджмента и целям по будущим операциям являются прогнозными заявлениями. Эти прогнозные заявления включают в себя известные и неизвестные риски, факторы неопределенности и иные факторы, которые могут стать причиной того, что наши нынешние показатели, достижения, свершения или же производственные показатели, будут существенно отличаться от тех, которые сформулированы или подразумеваются под этими прогнозными заявлениями. Данные прогнозные заявления основаны на многочисленных презумпциях относительно нашей нынешней и будущей бизнес-стратегии и среды, в которой мы ожидаем осуществлять свою деятельность в будущем. Важнейшими факторами, которые могут повлиять на наши нынешние показатели, достижения, свершения или же производственные показатели, которые могут существенно отличаться от тех, которые сформулированы или подразумеваются этими прогнозными заявлениями являются, помимо иных факторов, следующие:

- восприятие рыночных услуг, предоставляемых НКО НКЦ АО ;
- волатильность (а) Российской экономики и рынка ценных бумаг и (b) секторов с высоким уровнем конкуренции, в которых Компания и ее дочерние общества осуществляют свою деятельность;
- изменения в (а) отечественном и международном законодательстве и налоговом регулировании и (b) государственных программах, относящихся к финансовым рынкам и рынкам ценных бумаг;
- ростом уровня конкуренции со стороны новых игроков на рынке России;
- способность успевать за быстрыми изменениями в научно-технической среде, включая способность использовать расширенные функциональные возможности, которые популярны среди клиентов НКО НКЦ АО;
- способность сохранять преемственность процесса внедрения новых конкурентных продуктов и услуг, равно как и поддержка конкурентоспособности;
- способность привлекать новых клиентов на отечественный рынок и в зарубежных юрисдикциях;
- способность увеличивать предложение продукции в зарубежных юрисдикциях. Прогнозные заявления делаются только на дату настоящей презентации, и мы точно отрицаем наличие любых обязательств по обновлению или пересмотру прогнозных заявлений в настоящей презентации в связи с изменениями наших ожиданий, или перемен в условиях или обстоятельствах, на которых основаны эти прогнозные заявления.