

Изменения в Формы и форматы документов и отчетов и Форматы электронных сообщений Клирингового терминала

С 22.09.2025 г. в связи с изменением порядка исполнения обязательств по денежным средствам в отдельных иностранных валютах вступает в силу:

I. Новая редакция Форм и форматов документов и отчетов.

Основные изменения:

Формы и форматы документов и отчетов. Часть I. Общая часть.

1. В формат Запрос на изменение Расчетного кода (в части информации о наименовании фонда) (п. 2.9) внесены редакционные правки в текст запроса и сноски.

Формы и форматы документов и отчетов. Часть III. Формы и форматы документов и отчетов на валютном рынке и рынке драгметаллов.

1. В форму Клирингового отчета (CCX03, CCX3A) (п. 5.1., XML-структура) в ноду «CURRPAIR» добавлен новый необязательный атрибут «BasisId: Код базиса расчётов». Данный атрибут заполняется параметрами базового актива для сделок с инструментами, у которых базовым является актив с «SPECSETTLEMODE = "P"».
2. В форму Отчёта об итоговых нетто-обязательствах / итоговых нетто-требованиях (CCX04, CCX4A, CCX4P) (п. 5.2., XML-структура) в ноду «CURRENCY» добавлен новый необязательный атрибут «BasisId: Код базиса расчётов». Данный атрибут заполняется кодом базового актива по обязательствам из сделок со специализированной валютой на Базисе (для сделок с инструментами, у которых базовым является актив с «SPECSETTLEMODE = "P"»).
3. В форму Отчёта о торгово-клиринговых счетах (CCX20) (п. 5.10., XML-структура):
 - 3.1. в ноду «SETTLE» добавлен новый необязательный блок «BASIS (Блок данных по счетам для исполнения на базисе)» с атрибутами:
 - 3.1.1. «BasisId: Код базиса расчётов». Данный атрибут заполняется кодом Базиса, для исполнения на котором открыт Счёт для исполнения на Базисе
 - 3.1.2. «BasisAccStatus: Статус счёта для исполнения на Базисе»
 - 3.2. в описание атрибута «CurrencyId» добавлено «/драгоценного металла».
4. В форму Выписки из реестра сделок, принятых в клиринг (CCX43) (п.5.4., XML-структура):
 - 4.1. в ноду «CURRPAIR» добавлен новый необязательный атрибут «BasisId: Код базиса расчётов». Данный атрибут заполняется параметрами базового актива для сделок с инструментами, у которых базовым является актив с «SPECSETTLEMODE = "P"».
 - 4.2. Добавлены новые значения атрибута «Type»:
 - 4.2.1. 10 – Закрывающая сделка в отношении Недобросовестного Участника клиринга при непоставке (без подачи заявок)
 - 4.2.2. 11 – Балансирующая сделка с ДУКом по поставке, заключенная НКЦ (без подачи заявок)
 - 4.2.3. 12 – Закрывающая сделка по заявлению Участника клиринга в связи с невозможностью исполнения обязательств (без подачи заявок)
 - 4.2.4. 13 – Балансирующая сделка с Добросовестным участником клиринга в связи с невозможностью исполнения обязательств (без подачи заявок)
5. В форму Выписки из реестра внебиржевых предложений НКЦ (CCX122) (п. 5.24., XML-структура):
 - 5.1. в ноду «CURRPAIR» добавлен новый необязательный атрибут «BasisId: Код базиса расчётов». Данный атрибут заполняется только для Комбинированных предложений в режиме торгов SETL «OTC: Расчеты на базисе»
 - 5.2. добавлено новое значение атрибута «TradeGroup»: С — Комбинированное предложение.
6. В форму Выписки из реестра внебиржевых сделок с иностранной валютой / драгоценным металлом (CCX123) (п. 5.25., XML-структура) в ноду «CURRPAIR» добавлен новый необязательный атрибут «BasisId: Код базиса расчётов». Данный атрибут заполняется параметрами базового актива для сделок с инструментами, у которых базовым является актив с «SPECSETTLEMODE = "P"».

Схемы и стили для печатных форм отчётов опубликованы на FTP-сервере биржи:
<https://ftp.moex.com/pub/Reports/Currency>

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

1. В формат Заявления на открытие Брокерской фирмы» (п. 2.1.) внесено уточнение, что в рамках типа «Брокерская фирма ДУ (для клиента Участника клиринга, являющегося ДУ)», Участник клиринга обладает правом использовать в собственных интересах переданные ему денежные средства учредителя (учредителей) доверительного управления и (или) использовать указанные денежные средства для обеспечения исполнения собственных обязательств или обязательств третьих лиц.
2. В формат Согласия на прием (п. 2.24.) внесены правки уточняющего характера, в рамках которых Участнику клиринга необходимо дополнительно, при выражении своего согласия на прием позиций по Срочным контрактам и Обеспечения, указывать ранее открытые разделы клиринговых регистров, имеющие код Обособленной Брокерской фирмы № ХХУУ000, на которые предполагается прием данных позиций и Обеспечения.
3. В формат Сводного отчета о принятых в клиринг Сделках (Инструментах и Связках) (п. 3.3., CSV-структура) добавлены следующие поля:
 - 3.1. buy_deposit_erc: Базовый размер Гарантийного обеспечения покупателя, рассчитанный для категории с особым уровнем риска (в рублях РФ)
 - 3.2. sell_deposit_erc: Базовый размер Гарантийного обеспечения продавца, рассчитанный для категории с особым уровнем риска (в рублях РФ)
 - 3.3. buy_deposit_hrc: Базовый размер Гарантийного обеспечения покупателя, рассчитанный для категории с повышенным уровнем риска (в рублях РФ)
 - 3.4. sell_deposit_hrc: Базовый размер Гарантийного обеспечения продавца, рассчитанный для категории с повышенным уровнем риска (в рублях РФ)
 - 3.5. buy_deposit_lrc: Базовый размер Гарантийного обеспечения покупателя, рассчитанный для категории с начальным уровнем риска (в рублях РФ).
 - 3.6. sell_deposit_lrc: Базовый размер Гарантийного обеспечения продавца, рассчитанный для категории с начальным уровнем риска (в рублях РФ)
 - 3.7. buy_deposit_mrc: Базовый размер Гарантийного обеспечения покупателя, рассчитанный для категории со стандартным уровнем риска (в рублях РФ)
 - 3.8. sell_deposit_mrc: Базовый размер Гарантийного обеспечения продавца, рассчитанный для категории со стандартным уровнем риска (в рублях РФ)
 - 3.9. exp_enforcement_pay: Сумма единовременного платежа (в рублях РФ) за один однодневный фьючерсный контракт с автопродлонгацией исполненный заключением фьючерсного контракта исполнения.
4. Формат Отчета об обязательствах по Сделкам (п. 3.5., CSV-структура) дополнен следующими полями:
 - 4.1. pos_enforcement_exes: Количество исполненных однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией на основании поданных поручений об исполнении, а также исполненных принудительно
 - 4.2. pay_enforcement_exes: Сумма единовременного платежа (с учетом знака) в связи с исполнением однодневных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией (в рублях РФ).

II. Новая редакция Форматов электронных сообщений Клирингового терминала (версия 2.3.1).

Основные изменения:

1. В разделе II:
 - 1.1. Добавлены следующие типы:
 - 3.7. Тип Alpha2CodeType
 - 3.56. Тип INN10IDTextType
 - 3.78. Тип Max20CodeType
 - 1.2. В тип «3.21. Тип BrokerTypeType» добавлен вариант значения «N - Собственная Брокерская фирма - Нерезидент юридическое лицо»
 - 1.3. В типе «3.28. Тип CurrencyIDType» удалено уточнение «[Общероссийский классификатор валют]».
2. В разделе III:
 - 2.1. Добавлены элементы:
 - 5.7. [ct:BasisList]. Список базисов
 - 6.4. [ct:MemberDoc]. Документ, подписанный Участником
 - 6.5. [ct:MemberDocList]. Документы, подписанные Участником
 - 10.8. [ct:SCodeBasisList]. Соответствие Расчетных кодов и счетов на базисах
 - 2.2. В элементе «6.3. [ct:Member]. Информация об Участнике» добавлен реквизит «SCodeBasis - Наличие РК, связанного с базисом»
3. В разделах IV и V:
 - 3.1. Добавлены электронные документы:

- 20.1. [ct:DocToSign]. Документ для подписания
 - 20.2. [ct:DocToSignList]. Список документов для подписания
 - 22.16. [ed:SCodeBasisSet]. Запрос на установление соответствия Счета для исполнения на Базисе Расчетному коду
 - 22.17. [ed:SCodeBasisUnset]. Запрос на аннулирование соответствия Счета для исполнения на Базисе Расчетному коду
 - 22.19. [ed:SCodeCU2Settl]. Запрос на прекращение Нетто-обязательства / Нетто-требования в Специализированной валюте
 - 31.1. [ed:DocSign]. Подписание документов
4. Во всех электронных документах «21. Идентификаторы (торговые)», «22. Расчетные коды и Брокерские фирмы», «23. Счета для возврата обеспечения (платежные реквизиты)» добавлен реквизит «Lang - Язык документа».