

Фьючерсы. Открытые позиции intraday

Получение данных

Данные доступны для просмотра и скачивания только после оформления [подписки](#)

Где смотреть?

Данные по всем доступным контрактам

<https://iss.moex.com/iss/analyticalproducts/futoi/securities/>

Данные по одному выбранному контракту (указать двухсимвольный код контракта, например Si)

<https://iss.moex.com/iss/analyticalproducts/futoi/securities/si>

Все данные за указанную дату

<https://iss.moex.com/iss/analyticalproducts/futoi/securities?date=2020-05-12>

Данные по одному контракту за указанный промежуток времени (Si, с 12 мая по 15 мая)

<https://iss.moex.com/iss/analyticalproducts/futoi/securities/si?from=2020-05-12&till=2020-05-15>

Убедитесь, что Вы залогинены на сайте

Ручное скачивание

Данные по всем доступным контрактам

<https://iss.moex.com/iss/analyticalproducts/futoi/securities.csv>

Данные по одному выбранному контракту (указать двухсимвольный код контракта, например Si)

<https://iss.moex.com/iss/analyticalproducts/futoi/securities/si.csv>

Все данные за указанную дату

<https://iss.moex.com/iss/analyticalproducts/futoi/securities.csv?date=2020-05-12>

Данные по одному контракту за указанный промежуток времени (Si, с 12 мая по 15 мая)

<https://iss.moex.com/iss/analyticalproducts/futoi/securities/si.csv?from=2020-05-12&till=2020-05-15>

Убедитесь, что Вы залогинены на сайте

Автоматизированное скачивание

Данные предоставляются через API Московской Биржи (ISS) в форматах csv, json и xml. Доступны два метода получения данных:

- Все инструменты за указанную дату – <https://iss.moex.com/iss/reference/808>
- Один инструмент за указанный период – <https://iss.moex.com/iss/reference/809>

Примеры запросов смотрите в разделе «Ручное скачивание» выше. Поменяв csv в запросе на json или xml, получите данные в соответствующем формате. Ограничение на количество записей в одном запросе – 1000.

Все возможности API смотрите в [описании](#) (в том числе про аутентификацию).

Пример кода на Python для получения данных

```
# coding: utf-8

import pandas as pd
import requests as re
from io import StringIO

s = re.Session()

#login – email, указанный при регистрации на сайте moex.com
#password – пароль от учетной записи на сайте moex.com
s.get('https://passport.moex.com/authenticate', auth=(login, password))

headers = {"User-Agent": "Mozilla/5.0 (Macintosh; Intel Mac OS X 10.14; rv:66.0) Gecko/20100101 Firefox/66.0"}
cookies = {'MicexPassportCert': s.cookies['MicexPassportCert']}

url = 'https://iss.moex.com/iss/analyticalproducts/futoi/securities.csv'
req = re.get(url, headers=headers, cookies = cookies)

#Далее, csv данные можно перевести в pandas DataFrame
data = StringIO(req.text)
X = pd.read_csv(data, ';', skiprows = 2)
```