

Публикация информации о существенных отклонениях в ИСС

Информация о существенных отклонениях цены, спроса, предложения или объема торгов финансовым инструментом, иностранной валютой и (или) товаром



Ежедневная публикация информации о существенных отклонениях

Информационно-статистический сервер Московской Биржи, публикация информации о существенных отклонениях на 3 рынках (пока работает в тестовом режиме):

Фондовый: https://iss.moex.com/iss/downloads/deviations/sedev_20240426.zip

Где: в «sedev_20240426» (YYYYMMDD), соответственно год, месяц и дата торгового дня, за который предоставляются сведения.

Файл с существенными отклонениями цены и объема, спроса и предложения на ФР - "sedev_YYYYMMDD.zip", где YYYYMMDD - дата отчетного торгового дня; внутри архива - файл sedev_YYYYMMDD.csv и файл devds_YYYYMMDD.csv;

Срочный: https://iss.moex.com/iss/downloads/deviations/fodev_20240426.zip

Где: в «fodev_20240426» (YYYYMMDD), соответственно год, месяц и дата клирингового дня, за который предоставляются сведения.

Файл с существенными отклонениями цены и объема на СР - "fodev_YYYYMMDD.zip", где YYYYMMDD - дата отчетного торгового дня; внутри архива - файл fodev_YYYYMMDD.csv;

Валютный: https://iss.moex.com/iss/downloads/deviations/cudev_20240426.zip

Где: в «cudev_20240426» (YYYYMMDD), соответственно год, месяц и дата торгового дня, за который предоставляются сведения.

Файл с существенными отклонениями цены и объема на ВР - "cudev_YYYYMMDD.zip", где YYYYMMDD - дата отчетного торгового дня; внутри архива - файл cudev_YYYYMMDD.csv;

Ежедневная публикация информации о существенных отклонениях

Атрибуты в файлах `sedev_YYYYMMDD.csv`, `cudev_YYYYMMDD.csv`, `fodev_YYYYMMDD.csv` с существенными отклонениями цены и объема (направление сделки в поле «buysell» определяет лицо - сторону сделки, по которой было выявлено существенное отклонение):

Наименование параметра	Тип	Содержимое
tradedate	datetime	дата сделки
tradeno	string	номер сделки в ТКС
buysell	string	направление сделки ('B'-buy, 'S'-sell)
secid	string	идентификатор инструмента
devprice	string	признак отклонения по цене ('Y'-да, 'N'-нет)
devvol	string	признак отклонения по объёму ('Y'-да, 'N'-нет)

Атрибуты в файле `devds_YYYYMMDD.csv` с существенными отклонениями спроса и предложения:

Наименование параметра	Тип	Содержимое
entrydate	datetime	дата заявки
orderno	string	номер заявки
buysell	string	направление заявки ('B'-buy, 'S'-sell)
secid	string	идентификатор инструмента
devds	string	признак отклонения по спросу и предложению ('Y'-да, 'N'-нет)