

Фондовый и Валютный рынок

Спецификация формата данных Full Orders Log (тип А):

Наименование поля	Тип	Описание
NO	<i>Int</i>	Номер записи
SECCODE	<i>String</i>	Код инструмента
BUYSELL ¹	<i>Char</i>	Признак купли/продажи
		B= Купить
		S= Продать
TIME ²	<i>LongInt</i>	Время в формате HHMMSSZZZXXX с марта 2016
		Время в формате HHMMSSZZZ до марта 2016
ORDERNO	<i>Int</i>	Номер заявки
ACTION	<i>Byte</i>	Тип события:
		0=Снятие заявки
		1=Постановка заявки
PRICE ³	<i>Float</i>	2=Сделка
		Цена заявки
		Объем
VOLUME	<i>Int</i>	Для action=1 – видимый объем поставленной заявки
		Для action=2 – объем сделки
		Для action=0 – остаток видимой части заявки
Следующие поля заполняются только для сделок (ACTION=2)		
TRADENO	<i>Int</i>	Номер сделки
TRADEPRICE	<i>Float</i>	Цена сделки

Пример данных Full Orders Log (тип А):

NO	SECCODE	BUYSELL	TIME	ORDERNO	ACTION	PRICE	VOLUME	TRADENO	TRADEPRICE
30818	LSRG	S	100000429850	30789	2	574.9	10	1961689585	575
30819	NLMK	B	100000430356	30790	1	63.21	1780		
30831	ELTZ	S	100000435125	25211	0	824.6	150		

Объем файла за 1 месяц: 1-3 Gb в сжатом виде. Формат CSV

Примечания:

1. Значения параметра направленности сделок Buy/Sell доступны с Января 2011г
2. Нулевое значение параметра ЦЕНА (PRICE) означает "рыночную" заявку, которая исполняется лучшей встречной заявкой/заявками, имеющимися в торговой системе на тот момент времени:

4, TGKI, B, 103000000, 4, 1, 0, 40000000, ,

3. Время (TIME) с точностью до **микросекунд** с марта 2016 года. До марта 2016 года время в миллисекундах.

Спецификация формата данных Top of the Book (тип В):

Наименование поля	Тип	Описание
SECCODE	<i>String</i>	Код инструмента
BUYSELL ¹	<i>Char</i>	Признак купли/продажи
		B= Купить
		S= Продать
TIME ²	<i>LongInt</i>	Время в формате HHMMSSZZZXXX с марта 2016
		Время в формате HHMMSSZZZ до марта 2016
TRADENO	<i>Int</i>	Номер сделки (заполняется только для сделок)
PRICE	<i>Float</i>	Лучшая котировка (для сделок - цена сделки)
VOLUME	<i>Int</i>	Суммарный объем по лучшей котировке (для сделок - объем сделки)

Пример данных Top of the Book (тип В):

SECCODE	BUYSELL	TIME	TRADENO	PRICE	VOLUME
SBER	S	100000429324		96.47	300
SBER	S	100000430955		96.41	1500
GAZP	B	100000435233	25211	147.56	450

Объем файла за 1 месяц: 0.5-1 Gb в сжатом виде. Формат CSV

Примечания:

1. Значения параметра направленности сделок Buy/Sell доступны с Января 2011г.
2. Время (TIME) с точностью до **микросекунд** с марта 2016 года. До марта 2016 года время в миллисекундах

Срочный рынок

Спецификация формата данных Full Orders Log (тип А):

Наименование	Тип	Описание
SYMBOL	<i>String</i>	Код инструмента
SYSTEM	<i>Char</i>	Идентификатор рынка: F- фьючерсы, C(P)- call(put) опционы
TYPE	<i>Char</i>	Тип заявки (B -купить/ S - продать)
MOMENT	<i>LongInt</i>	Дата и Время события YYYYMMDDHHMMSSZZZ
ID	<i>Int</i>	Номер заявки
ACTION	<i>Byte</i>	Статус заявки (0-снята, 1-добавлена, 2-закрыта сделкой)
PRICE	<i>Float</i>	Цена заявки
VOLUME	<i>Int</i>	Объём заявки (в контрактах, в шт.бумаг)
Следующие поля заполняются только для сделок (ACTION=2)		
ID_DEAL	<i>Int</i>	Номер сделки закрывшей заявку
PRICE_DEAL	<i>Float</i>	Цена сделки

Пример данных Full Orders Log (тип А):

SYMBOL	SYSTEM	TYPE	MOMENT	ID	ACTION	PRICE	VOLUME	ID_DEAL	PRICE_DEAL
RIM1	F	B	20110531190000900	4000649468	0	188030	2		
SRM1	F	S	20110531190000956	4000649496	1	9807	20		
SRM1	F	B	20110531190002130	4000649487	2	9777	3	327626573	9777

Спецификация формата данных Top of the Book (тип B):

Наименование	Тип	Описание
SYMBOL	<i>String</i>	Код инструмента
SYSTEM	<i>Char</i>	Тип инструмента: F- фьючерсы, C(P)- call(put) опционы
TYPE	<i>Char</i>	Направление Buy/Sell (B - на купить, S - на продажу)
MOMENT	<i>LongInt</i>	Дата и Время YYYYMMDDHHMMSSZZZ
ID_DEAL	<i>Int</i>	Номер сделки
PRICE	<i>Float</i>	Лучшая котировка (для сделок - цена сделки)
VOLUME	<i>Int</i>	Суммарный объем по лучшей котировке (для сделок - объем сделки)

Пример данных Top of the Book (тип B):

SYMBOL	SYSTEM	TYPE	MOMENT	ID_DEAL	PRICE	VOLUME
RIM1	F	B	20110531190000913		188030	2000
SRM1	F	S	20110531190001900		9807	120
SRM1	F	B	20110531190002345	327626573	9807	30

Trades - сделки с информацией об открытых позициях

Наименование	Тип	Описание
SYMBOL	<i>String</i>	Код инструмента
SYSTEM	<i>Char</i>	Идентификатор рынка (борда): F- фьючерсы, C(P)- call(put) опционы
MOMENT	<i>LongInt</i>	Время заключения сделки
ID_DEAL	<i>Int</i>	Номер сделки
PRICE_DEAL	<i>Float</i>	Цена сделки
VOLUME	<i>Int</i>	Объем сделки
OPEN_POS	<i>Int</i>	Количество открытых позиций (в контрактах)
DIRECTION	<i>Char</i>	Направление сделки (сделка закрыта по заявке "купить" или по заявке "продать")

Данные **Trades** являются дополнением к данным *Full Orders Log (Тип A)* и *Top of the Book (Тип B)* для Срочного рынка.