

УТВЕРЖДЕНЫ

Приказом Директора

ЗАО «Национальная товарная биржа»

«01» сентября 2015 г. (№ 01/17-29)

Директор

С.А. Наумов



Отчетные документы товарного рынка ЗАО «Национальная товарная биржа»

1. Отчетные документы

1.1. Порядок наименования файлов с электронными документами (ЭД) и электронными сообщениями (ЭС) в формате XML.

Формат: файлы в формате XML (ЭД - подписанный электронной подписью документ, ЭС – неподписанное электронной подписью сообщение);

Наименование: *MMNNNNN_TTTTT_SSS_DDMMYY_NNNNNNNN.xml.p7s* со следующими параметрами:

MMNNNNN – код Участника торгов в системе электронного документооборота (системе ЭДО) – первые 7 символов регистрационного кода Участника торгов.

TTTTT – 5-символьный тип ЭД (может принимать значения, приведенные ниже в документах);

SSS – 3-символьный код сессии или порядковый номер сессии;

DDMMYY – дата, за которую подготовлены данные в документе;

NNNNNNNN – 8-символьный уникальный номер ЭД или ЭС.

Здесь «xml» - стандартное расширение XML-файла, «p7s» - стандартное расширение файла, подписанного электронной подписью в системе ЭДО.

1.2. NTB01: Выписка из реестра заявок

Пример имени файла: *MN12345_NTB01_D01_011215_00003617.xml*

Код сессии (параметр *SSS* в имени файла) принимает значение *DNN / MNN* в зависимости от следующего:

Выписка из реестра заявок (NTB01) – выдается Участникам торгов после, по окончании торгов.

Файлы в виде электронных документов формируются и направляются Участнику торгов ежедневно по окончании торгов посредством системы ТКС «УРОЖАЙ».

1.2.1. ФОРМА

Выписка из реестра заявок Дата регистрации заявок: <дата>

Биржа: ЗАО «Национальная товарная биржа»

Участник торгов: <Регистрационный код>, <Наименование Участника торгов>

Участник клиринга: <Клиринговый идентификатор>, <Наименование участника клиринга>

Часть 1. Заявки на заключение форвардных договоров.

Номер заявки	Идентификатор участника торгов	Идентификатор клиента участника торгов (ИСД)	Время регистрации	Режим (EXW или EXW + доставка)	Направление.	Тип заявки	Делимость	Предельный объем	Основные характеристики товара	Базис / пункт назначения	Дата расчетов / диапазон допустимых дат	Предельная цена заявки	Статус	Время снятия	Остаток заявки	Дополнительные характеристики товара	АСП, выставшего заявки	ТКС, указанный в заявке
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19

Часть 2. Заявки на заключение договоров своп/своп контрактов.

Номер заявки	Идентификатор участника торгов	Идентификатор клиента участника торгов (ИСД)	Время регистрации	Направление.	Тип заявки	Основные характеристики товара	Базис	Базовый курс	Максимальная дата исполнения по первой части своп-контракта	Максимальная дата исполнения по второй части своп-контракта	Предельная цена заявки	Статус	Время снятия	Остаток заявки	АСП, выставшего заявки	ТКС, указанный в заявке
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17

Уполномоченный представитель Биржи: _____ /ФИО/

1.2.2. СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО СООБЩЕНИЯ (XML-ФАЙЛ) «ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА ЗАЯВОК»

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	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	
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES						
NTB01		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата торгов	Да	Date		
	FirmId	Регистрационный код Участника торгов	Да	Character	0-12	
	FirmName	Наименование Участника торгов	Да	Character	0-120	
	FirmNameEN	Наименование Участника торгов (eng)	Нет	Character	0-120	
CLEARPART		Блок данных по Участнику клиринга				
	ClearingFirmId	Идентификатор Участника клиринга	Да	Character	0-12	
	ClearingFirmName	Наименование Участника клиринга	Да	Character	0-120	
	ClearingFirmNameEN	Наименование Участника клиринга (eng)	Нет	Character	0-120	
SETTLE		Блок информации по расчетному коду				
	ExtSettleCode	Расчетный код Участника клиринга	Да	Character	20	
SESSION		Блок данных по типу сессии				
	AddSession	Тип сессии: N – Основная сессия	Да	Character	1	
	SessionName	Наименование сессии	Да	Character		
	SessionNameEN	Наименование сессии (eng)	Да	Character		
SECURITY		Блок данных по инструменту				
	SecName	Наименование Товара	Да	Character	0-10	
	Class	Основная качественная характеристика Товара (класс)	Да	Character	0-12	
	Basis	Базис Товара	Да	Character	0-12	
SETTLEDATE		Блок данных по дате исполнения				
	SettleDateBegin	Начало интервала допустимых дат исполнения	Да	Date		
	SettleDateEnd	Конец интервала допустимых дат исполнения				
GROUP		Блок данных по виду заявки				
	TradeGroup	Вид договора: F - форвард; S - договор своп/своп контракт, T- спот договор;	Да	Character	1	
RECORDS		Блок данных по заявке				
	OrderNo	Номер заявки	Да	Number	20	0
	UserId	Торговый идентификатор Участника торгов/Идентификатор спонсируемого доступа	Да	Character	0-12	
	ASP	АСП Участника торгов	Да	Character	0-12	
	EntryTime	Время регистрации заявки	Да	Time		
	BuySell	Направление заявки: B – Покупка, S – Продажа;	Да	Character	1	
	OrderType	Тип заявки	Да	Character	3	
	BasePrice	Базовый курс	Нет	Number	20	6
	Quantity	Всего объем в единицах измерения товара	Да	Number	20	0
	QuantityHidden	Скрытый объем в единицах измерения товара	Да	Number	20	0
	Decimals	Число значимых знаков после запятой в предельной цене заявки (атрибут Price)	Да	Number		

	Price	Предельная цена заявки	Да	Number	20	6
	Status	Статус	Да	Character	1	
	AmendTime	Время снятия заявки	Нет	Time		
	Balance	Остаток заявки	Да	Number	20	2
	CPFirmId	Контрагент	Нет	Character	0-12	
	ClientCode	Краткий код клиента	Нет	Character	12	
	Details	ИНН или № паспорта клиента	Нет	Character	20	
	SubDetails	ИНН или № паспорта клиента субброкера	Нет	Character	20	
	BoardId	Идентификатор правил торгов	Да	Character	4	
	BoardName	Наименование правил торгов	Да	Character	30	
	BoardNameEN	Наименование правил торгов (eng)	Да	Character	30	
	/RECORDS					
	/GROUP					
	/SETTLEDATE					
	/SECURITY					
	/SESSION					
	/SETTLE					
	/CLEARPART					
	/NTB01					

1.3. Выписка из реестра договоров (NTB02)

Пример имени файла: *MN12345_NTB02_D01_031011_12345678.xml.p7s*

Файлы в виде электронных документов формируются и направляются Участнику торгов ежедневно по окончании торгов посредством системы ТКС “УРОЖАЙ”.

1.3.1. ФОРМА

Выписка из реестра договоров
Дата заключения договоров: <Дата>

Биржа: ЗАО «Национальная товарная биржа»

Участник торгов: <Регистрационный код>, <Наименование Участника торгов>

Участник клиринга: <Клиринговый идентификатор>, <Наименование участника клиринга>

Часть 1. Форвардные договора.

Номер договора	Время заключения договоров	Режим (EXW или EXW + доставка)	Направление.	Основные характеристики товара	Дополнительные характеристики товара	Базис	Пункт назначения	Цена за единицу товара	Объем товара	Объем в рублях	Дополнительные характеристики товара	Номер заявки	Договор с ПФИ	Контрагент	Комисс. вознаграждение за организацию торгов, руб.	Вознаграждение за предоставление ИТС, руб.	Комисс. вознаграждение за клиринг. обслуживание, руб.	Комиссия всего по сделке, руб.	АСП, выставленный в заявке	ТКС, указанный в заявке	

Итого покупка:

Итого по комиссии:

Итого продажа:

Часть 2. Договоры, входящие в сделку своп/своп контракт

Номер договора	Время заключения договоров	Режим (EXW или EXW + доставка)	Направление.	Основные характеристики товара	Дополнительные характеристики товара	Базис	Пункт назначения	Цена за единицу товара	Объем товара	Объем в рублях	Дополнительные характеристики товара	Номер заявки	Договор с ПФИ	Контрагент	Комисс. вознаграждение за организацию торгов, руб.	Вознаграждение за предоставление ИТС, руб.	Комисс. вознаграждение за клиринг. обслуживание, руб.	Комиссия всего по сделке, руб.	АСП, выставленный в заявке	ТКС, указанный в заявке	

Уполномоченный представитель Биржи: _____ /ФИО/

1.3.2. СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО ДОКУМЕНТА (XML-ФАЙЛ) «ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА ДОГОВОРОВ»

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			
NTB02		Блок данных отчета	Да			
	ReportDate	Дата, за которую сформирован отчет	Да	Date		
	FirmID	Идентификатор Участника клиринга	Да	Character	0-12	
	FirmName	Наименование Участника клиринга	Да	Character	0-120	
INFTYPE		Блок данных по типу информации	Да			
	InfType	Тип информации ("1" - Исполненные договоры текущего дня; "2" - Договоры, подлежащие исполнению)	Да	Number	1	0
SETTLEDATE		Блок данных по дате исполнения	Да			
	SettleDate	Дата исполнения	Да	Date		
TRADE		Блок данных по типу Договора	Да			
	ContractTCCode	Код Договора (FWH/ SWH/ SPT)	Да	Character	3	
	ContractName	Наименование Договора: F – форвардный договор, S – своп договор, F – спот договор	Да	Character	1	
SECURITY		Блок данных по товару	Да			
	SecName	Наименование товара	Да	Character	0-120	
	Class	Основная качественная характеристика товара (класс)	Да	Character	0-12	
	Basis	Базис товара	Да	Character	0-12	
	AdditFeatures	Дополнительные характеристики	Нет	Character	0-120	
RECORDS		Блок данных по Договору	Да			
	RecNo	Номер по порядку	Да	Number	11	0
	TradeNo	Номер Договора в Системе торгов	Да	Number	20	0
	ClearingType	Тип клиринга: 1 – клиринг с частичным обеспечением; 2 – клиринг с полным обеспечением	Да	Number	1	0
	TradeDate	Дата торгов	Да	Date		
	TradeTime	Время регистрации Договора в Системе торгов	Да	Time		
	AdditFeatures					

	BuySell	Направленность Договора/ части своп договора (Покупка (B) / продажа (S))	Да	Character	1	
	ContractPeriod	Срок договора	Нет	Number	11	0
	Price	Цена за один Договор	Нет	Number	20	6
	Quantity	Объём товара (в единицах измерения товара)	Да	Number	20	0
	Value	Объём в денежных средствах (российские рубли)	Нет	Number	20	2
	Amount	Обязательство по денежным средствам	Нет	Number	20	2
	Balance	Обязательство по товару	Нет	Number	20	0
	TDif	Обязательство по уплате транспортного дифференциала	Нет	Number	20	2
	ExchComm	Биржевой сбор	Нет	Number	20	2
	ClrComm	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра	Нет	Number	20	2
	TrdAccId	Торгово-клиринговый счет	Да	Character	0-12	
	CPFirmId	Идентификатор контрагента	Нет	Character	0-12	
	CPFirmShortName	Краткое наименование контрагента	Нет	Character	0-30	
	ClientCode	Краткий код клиента	Нет	Character	0-12	
	Price2	Цена второй части своп договора	Нет	Number	20	6
	SwapPart	Часть своп договора ("1" - первая часть; "2" – вторая часть)	Нет	Number	1	0
	Type	Тип договора, заключенной в целях урегулирования неисполнения обязательств: 1 - закрывающий форвардный договор	Нет	Number	1	
	/RECORDS		Да			
	/SECURITY		Да			
	/TRADE		Да			
	/SETTLEDATE		Да			
	/INFTYPE					
	/NTB02		Да			
	/MICEX_DOC		Да			

1.4. NTB03: Выписка из реестра договоров СПОТ

Пример имени файла: *MN12345_NTB03_D01_031011_12345678.xml.p7s*

Файлы в виде электронных документов формируются и направляются Участнику торгов ежедневно по окончании торгов посредством системы ТКС “УРОЖАЙ”.

1.4.1. ФОРМА

Выписка из реестра договоров СПОТ

Дата заключения договоров: <Дата>

Биржа: ЗАО «Национальная товарная биржа»

Участник торгов: <Регистрационный код>, <Наименование Участника торгов>

Участник клиринга: <Клиринговый идентификатор>, <Наименование участника клиринга>

Часть 1. Форвардные договора.

Номер договора	Время заключения договоров	Режим (EXW или EXW + доставка)	Направление.	Основные характеристики товара	Дополнительные характеристики товара	Базис	Пункт назначения	Цена за единицу товара	Объем товара	Объем в рублях	Дополнительные характеристики товара	Номер заявки	Договор с ПФИ	Контрагент	Комисс. вознагражд. за организацию торгов, руб.	Вознаграждение за предоставление ИТС, руб.	Комисс. вознагражд. за клиринг. обслуживание, руб.	Комиссия всего по сделке, руб.	АСП, выставленного заявления	ТКС, указанный в заявке	

Итого покупка:

Итого по комиссии:

Итого продажа:

1.4.2. СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО ДОКУМЕНТА (XML-ФАЙЛ) «ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА ДОГОВОРОВ СПОТ»

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			
NTB03		Блок данных отчета	Да			
	ReportDate	Дата, за которую сформирован отчет	Да	Date		
	FirmID	Идентификатор Участника клиринга	Да	Character	0-12	
	FirmName	Наименование Участника клиринга	Да	Character	0-120	
INFTYPE		Блок данных по типу информации	Да			
	InfType	Тип информации ("1" - Исполненные договоры текущего дня; "2" - Договоры, подлежащие исполнению)	Да	Number	1	0
SETTLEDATE		Блок данных по дате исполнения	Да			
	SettleDate	Дата исполнения	Да	Date		
TRADE		Блок данных по типу Договора	Да			
	ContractTCCode	Код Договора (FWH/ SWH/ SPT)	Да	Character	3	
	ContractName	Наименование Договора: F – форвардный договор, S – своп договор, F – спот договор	Да	Character	1	
SECURITY		Блок данных по товару	Да			
	SecName	Наименование товара	Да	Character	0-120	
	Class	Основная качественная характеристика товара (класс)	Да	Character	0-12	
	Basis	Базис товара	Да	Character	0-12	
RECORDS		Блок данных по Договору	Да			
	RecNo	Номер по порядку	Да	Number	11	0
	TradeNo	Номер Договора в Системе торгов	Да	Number	20	0
	ClearingType	Тип клиринга: 1 – клиринг с частичным обеспечением; 2 – клиринг с полным обеспечением	Да	Number	1	0
	TradeDate	Дата торгов	Да	Date		
	TradeTime	Время регистрации Договора в Системе торгов	Да	Time		
	AdditFeatures	Дополнительные характеристики				
	BuySell	Направленность Договора/ части своп договора (Покупка (B) / продажа (S))	Да	Character	1	

	ContractPeriod	Срок договора	Нет	Number	11	0
	Price	Цена за один Договор	Нет	Number	20	6
	Quantity	Объём товара (в единицах измерения товара)	Да	Number	20	0
	Value	Объём в денежных средствах (российские рубли)	Нет	Number	20	2
	Amount	Обязательство по денежным средствам	Нет	Number	20	2
	Balance	Обязательство по товару	Нет	Number	20	0
	TDif	Обязательство по уплате транспортного дифференциала	Нет	Number	20	2
	ExchComm	Биржевой сбор	Нет	Number	20	2
	ClrComm	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра	Нет	Number	20	2
	TrdAccId	Торгово-клиринговый счет	Да	Character	0-12	
	CPFirmId	Идентификатор контрагента	Нет	Character	0-12	
	CPFirmShortName	Краткое наименование контрагента	Нет	Character	0-30	
	ClientCode	Краткий код клиента	Нет	Character	0-12	
	Price2	Цена второй части своп договора	Нет	Number	20	6
	SwapPart	Часть своп договора ("1" - первая часть; "2" – вторая часть)	Нет	Number	1	0
	Type	Тип договора, заключенной в целях урегулирования неисполнения обязательств: 1 - закрывающий форвардный договор	Нет	Number	1	
	/RECORDS		Да			
	/SECURITY		Да			
	/TRADE		Да			
	/SETTLEDATE		Да			
	/INFTYPE					
	/NTB03		Да			
	/MICEX_DOC		Да			

1.5. NTB04: Структура электронного сообщения (XML-файл) «Выписка из реестра транзакций»

Пример имени файла: MN12345_NTB04_000_031011_12345678.xml

Код сессии (параметр SSS в имени файла) всегда принимает значение 000.

Файл в виде ЭС формируется и направляется по требованию Участника торгов посредством электронных каналов связи.

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	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	
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES						
NTB04		Блок данных отчета				
	EntrytDate	Дата торгов	Да	Date		
	FirmId	Регистрационный код Участника торгов	Да	Character	0-12	
	FirmName	Наименование Участника торгов	Да	Character	0-120	
	FirmNameEN	Наименование Участника торгов (eng)	Нет	Character	0-120	
RECORDS		Блок данных по заявке				
	RecNo	Номер по порядку	Да	Number	11	0
	TransNo	Уникальный код заявки (номер транзакции)	Да	Number	20	0
	EntryTime	Время фиксации заявки в торговой системе	Да	Time		
	Status	Статус заявки: Y – зарегистрирована в торговой системе; N – не зарегистрирована в торговой системе	Да	Character	1	
	MisType	Причина отказа в регистрации заявки в торговой системе	Нет	Character	0-255	
	MisTypeEN	Причина отказа в регистрации заявки в торговой системе (eng)	Нет	Character	0-255	
/RECORDS						
/NTB04						