

УТВЕРЖДЕНЫ

Приказом Директора

Акционерное общество «Национальная товарная биржа»

«22» февраля 2017 г. (№ 15/17-5)

Директор



С.А. Наумов

Отчетные документы товарного рынка Акционерного общества «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.p7s*

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

Биржа: Акционерное общество «Национальная товарная биржа»
 Участник торгов: <Наименование участника торгов>
 Идентификатор участника торгов: <Идентификатор участника торгов>

Часть 1. Заявки на заключение форвардных договоров.

Номер заявки	Уникальный код заявки	Код (ИНН) участника торгов	Код (ИНН) клиента участника торгов	Код (ИНН) клирингового брокера	Указание на исполнение обязательств маркет-мейкера	Вид заявки (делимность)	Тип заявки (двусторонний/ аукционный/ адресный)	Направление (продажа/покупка)	Наименование товара	Основная характеристика	Дополнительные характеристики	Товарный склад/ ЖД станция/ Округ	Цена за единицу товара	Объем заявки, единицы товара	Единица товара	Дата/ диапазон допустимых дат исполнения обязательств	Тип сессии	ТКС, указанный в заявке	Дата и время регистрации заявки	Статус заявки (зарегистрирована/ не зарегистрирована)	Причина отказа в регистрации заявки	Дата и время изменения заявки	Дата и время закрытия заявки	Результат подачи заявки (отклонена/снята/ исполнена)	Причина аннулирования заявки	Признак частичного исполнения	Остаток заявки, единицы товара	Тип обеспечения (полное/частичное)	Код инструмента	Расчетный код участника клиринга	АСП выставлявшего заявку (идентификатор)	Контрагент адресной заявки (идентификатор)	Номер аукциона	Комбинированная заявка
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27	28	29	30	31	32	33	34	35

Часть 2. Заявки на заключение своп-договоров.

Номер заявки	Уникальный код заявки	Код (ИНН) участника торгов	Код (ИНН) клиента участника торгов	Код (ИНН) клирингового брокера	Указание на исполнение обязательств маркет-мейкера	Вид заявки (делимность)	Тип заявки (двусторонний/ адресный)	Направление (продажа/ покупка)	Наименование товара	Основная характеристика	Дополнительные характеристики	Товарный склад	Цена, процентов годовых	Объем заявки, руб.	Единица товара	Дата/ диапазон допустимых дат исполнения обязательств по второй части договора	Тип сессии	ТКС, указанный в заявке	Дата и время регистрации заявки	Статус заявки (зарегистрирована/ не зарегистрирована)	Причина отказа в регистрации заявки	Дата и время изменения заявки	Дата и время закрытия заявки	Результат подачи заявки (отклонена/снята/ исполнена)	Причина аннулирования заявки	Признак частичного исполнения	Остаток заявки, руб.	Код инструмента	Расчетный код участника клиринга	АСП выставлявшего заявку (идентификатор)	Контрагент адресной заявки (идентификатор)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27	28	29	30	31	32

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	12	
	FirmName	Наименование Участника торгов	Да	Character	1-120	
	FirmNameEN	Наименование Участника торгов (eng)	Нет	Character	0-120	
CLEARPART		Блок данных по Участнику клиринга				
	ClearingFirmId	ИНН Участника клиринга	Да	Character	1-12	
	ClearingFirmName	Наименование Участника клиринга	Да	Character	1-120	
	ClearingFirmNameEN	Наименование Участника клиринга (eng)	Нет	Character	0-120	
SETTLE		Блок информации по расчетному коду				
	ExtSettleCode	Расчетный код Участника клиринга	Да	Character	1-30	
	NccRealAccount	Номер Счета обеспечения	Нет	Character	1-30	
SESSION		Блок данных по типу сессии				
	AddSession	Тип сессии (N - Основная сессия; Y – Основная сессия (урегулирование неисполненных обязательств)	Да	Character	1	
	SessionName	Наименование сессии	Да	Character	1-25	
	SessionNameEN	Наименование сессии (eng)	Да	Character		
GROUP		Блок данных по виду заявки				
	TradeGroup	Вид договора: F- форвард; S – договор своп/своп контракта;	Да	Character	1	
RECORDS		Блок данных по заявке				
	OrderNo	Номер заявки	Да	Character	1-12	0

	UserId	Торговый идентификатор Участника торгов/ Идентификатор спонсируемого доступа	Да	Character	1-30	
	ASP	АСП Участника торгов	Да	Character	1-30	
	BuySell	Направление заявки: B – Покупка; S – Продажа	Да	Character	1	
	SeparateType	Вид заявки: Делимая; Неделимая	Да	Character	1-12	
	OrderType	Тип заявки	Да	Character	1-20	
	SecName	Наименование товара	Да	Character	1-120	
	Class	Основная качественная характеристика товара	Да	Character	1-12	
	Basis	Товарный склад/ ЖД станция товара/ Округ	Да	Character	1-12	
	AdditFeatures	Дополнительные характеристики	Нет	Character	0-120	
	SettleDateBegin	Начало интервала допустимых дат исполнения	Да	Date		
	SettleDateEnd	Конец интервала допустимых дат исполнения	Да	Date		
	Quantity	Всего объем в единицах измерения товара/руб	Да	Number	1-20	0
	Decimals	Число значимых знаков после запятой в предельной цене заявки (атрибут Price)	Да	Number	2	
	Price	Цена за единицу товара/ процентов годовых	Да	Number	1-20	6
	Status	Результат подачи заявки	Да	Character	1-50	
	AmendTime	Время снятия заявки	Нет	Time		
	Balance	Остаток заявки	Да	Number	0-20	2
	ClientCode	Краткий код (ИНН) клиента участника торгов	Нет	Character	1-12	
	BoardId	Идентификатор правил торгов	Да	Character	1	
	BoardName	Наименование правил торгов	Да	Character	0-120	
	BoardNameEN	Наименование правил торгов (eng)	Нет	Character	0-120	
	CommodityUnit	Единица товара	Да	Character	1-12	
	InstrumentCode	Код инструмента	Да	Character	1-12	
	ClearingBrokerCode	Код (ИНН) клирингового брокера	Да	Character	0-12	
	MarketmeikerFlag	Указание на исполнение обязательств маркет- мейкера	Да	Character	3	
	RegStatus	Статус заявки (зарегистрирована/ не зарегистрирована)	Да	Character	20	
	ReasonToCancel	Причина аннулирования заявки	Да	Character	0-120	
	CAaddressOrder	Торговый идентификатор контрагента адресной заявки	Да	Character	0-30	
	TCAnumber	ТКС, указанный в заявке	Да	Character	0-12	
	RejectionReason	Причина отказа в регистрации заявки	Да	Character	0-120	
	ChangeTime	Дата и время изменения заявки	Да	Time		
	CloseTime	Дата и время закрытия заявки	Да	Time		
	PartExecFlag	Признак частичного исполнения	Да	Character	3	
	CollateralType	Тип обеспечения (полное/частичное)	Да	Character	10	
	RegTime	Дата и время регистрации заявки	Да	Time		
	CombType	Признак комбинированной заявки: 0- нет; 1 – да;	Да	Character	3	

	AuctionNumber	Номер аукциона	Да	Character	1-12	0
/RECORDS						
/GROUP						
/SESSION						
/SETTLE						
/CLEARPART						
/NTB01						
/MICEX_DOC						

1.3. Выписка из реестра договоров (NTB02)

Пример имени файла: *MN12345_NTB02_D01_031011_12345678.xml.p7s*

Выписка из реестра договоров (NTB02) – 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».

1.3.1. ФОРМА

Выписка из реестра договоров

Биржа: Акционерное общество «Национальная товарная биржа»

Участник торгов: <Наименование участника торгов>

Идентификатор участника торгов: <Идентификатор участника торгов>

№ п/п	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27	28
		Наименование товара	Основная характеристика	Дополнительные характеристики	Товарный склад	Дата исполнения обязательств	Номер заявки	Номер договора	Направление (продажа/покупка)	Дата и время регистрации договора	Центральный контрагент	Код (ИНН) участника торгов	Код (ИНН) клиента участника торгов	Код (ИНН) клирингового брокера	Код инструмента	Тип сделки (двусторонний/ аукционный / адресный)	Цена за единицу товара (включая НДС)	Объем, единиц товара	Своп разница в руб. (не включая НДС)	Единица товара	Сумма договора, руб. (включая НДС)	Расчетный код участника клиринга	ТКС, указанные в заявке	АСП выявлявшего заявку (идентификатор пользователя)	Статус договора	Комиссионное вознаграждение, руб.	Контрагент адресной заявки (краткое наименование)	Парный форвардный договор

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	
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/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				
	SettleDate	Дата исполнения	Да	Date		
TRADE		Блок данных по типу договора	Да			
	ContractTCode	Код договора	Да	Character	3	
	ContractName	Наименование договора: F-форвардный договор, S – своп 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	Товарный склад	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	Да	Time		
	AdditFeatures	Дополнительные характеристики	Нет	Character	0-120	
	BuySell	Направленность Договора/ части своп договора (B – Покупка; S – Продажа)	Да	Character	1	
	ContractPeriod	Срок договора	Нет	Number	11	0
	Price	Цена за единицу товара	Нет	Number	1-20	6
	Quantity	Объем товара (в единицах измерения товара)	Да	Number	1-20	0
	Value	Объем в денежных средствах (российские рубли)	Нет	Number	1-20	2
	TDif	Транспортный дифференциал, руб.	Нет	Number	0-20	2
	ExchComm	Биржевой сбор, руб.	Нет	Number	0-20	2
	ClrComm	Комиссионное вознаграждение за клиринговое обслуживание, руб.	Нет	Number	0-20	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 (ИНН) клиента участника торгов	Нет	Character	12	
	Type	Тип договора, заключенный в целях урегулирования неисполнения обязательств	Нет	Number	1	
	CommodityUnit	Единица товара	Да	Character	1-12	
	InstrumentCode	Код инструмента	Да	Character	1-12	
	ClearingBrokerCode	Код (идентификатор) клирингового брокера	Да	Character	12	
	CAaddressOrder	Краткое наименование контрагента адресной заявки	Да	Character	0-30	
	CentralCA	Центральный контрагент	Да	Character	1	
	OrderID	Номер заявки	Да	Character	1-12	0
	AuctionType	Тип сделки	Да	Character	20	
	ExtSettleCode	Расчетный код Участника клиринга	Да	Character	20	
	ASP	АСП Участника торгов	Да	Character	1-30	
	AgreementStatusName	Статус договора	Да	Character	0-50	
	ClearingFirmID	Код (ИНН) участника торгов	Да	Character	0-12	
	CombType	Признак комбинированной заявки: 0- нет; 1 – да	Да	Character	3	
	PairContractType	Признак парного форвардного договора: 0- нет; 1 – да	Да	Character	3	
	/RECORDS					
	/SECURITY					
	/TRADE					
	/SETTLEDATE					
	/INFTYPE					
	/NTB02					
	/MICEX_DOC					