

Описание видов файлов с сигналами системы мониторинга и их полей данных

Все файлы содержат в названии код фирмы участника (**FIRM**) и дату в формате **YYYY-MM-DD**, за которую сформированы данные. Данные предоставляются в формате **.xlsx**

Фондовый рынок

1. Файл **signals_FIRM_eq_YYYY-MM-DD.xlsx** – сигналы по нестандартным сделкам/заявкам, совершенным/поданным участником торгов и его клиентами на Фондовом рынке Московской Биржи

evdate	Дата выявления сигнала
sigtyp	Тип рынка ("eq" для фондового рынка)
crit_name	Код-наименование критерия
seccode	Код финансового инструмента
clientcode	Код клиента
tsno	Номер транзакции (номер сделки для критериев по сделкам, номер заявки для критериев по заявкам)
message	Сообщение системы мониторинга с описанием критерия срабатывания

2. Файл **signals_FIRM_hft_YYYY-MM-DD.xlsx** – сигналы по критериям недобросовестных высокочастотных практик в операциях участника торгов и его клиентов на Фондовом рынке Московской Биржи

evdate	Дата выявления сигнала
sigtyp	Признак высокочастотной торговли ("hft")
tsno	Номер транзакции (номер сделки для критериев по сделкам, номер заявки для критериев по заявкам)
critname	Код-наименование критерия
seccode	Код финансового инструмента
secboard	Код режима торгов
clientcode	Код раздела клирингового регистра Участника торгов (клиента Участника торгов)
message	Сообщение системы мониторинга с описанием критерия срабатывания

3. Файл **signals_FIRM_eq_crit3_YYYY-MM-DD.xlsx** – сигналы по взаимным сделкам, совершенным участником торгов и его клиентами, по итогу торгового дня на Фондовом рынке Московской Биржи

tradedate	Дата выявления сигнала
critname	Код-наименование критерия
securityid	Код инструмента фондового рынка
firm_id	Код участника торгов
client_code_id	Биржевой код клиента
client_det	Идентификатор клиента 1-го уровня
client_subdet	Идентификатор клиента 2-го уровня
message	Сообщение системы мониторинга с описанием критерия срабатывания

4. Файл **signals_FIRM_eq_crit4_5_YYYY-MM-DD.xlsx** – сигналы по нестандартной активности участника торгов и его клиентов по итогам торгового дня на Фондовом рынке Московской Биржи

tradedate	Дата выявления сигнала
critname	Код-наименование критерия
securityid	Код инструмента фондового рынка
boardid	Код режима торгов
firm_id	Код участника торгов
clientcodeid_full	Полный код клиента (конкатенация кода участника торгов, идентификатора клиента 1-го уровня, идентификатора клиента 2-го уровня)
message	Сообщение системы мониторинга с описанием критерия срабатывания

5. Файл **signals_FIRM_eq_dev_trades_YYYY-MM-DD.xlsx** – данные о наличии/отсутствии существенных отклонений цены и объема торгов в сделках участника торгов и его клиентов на Фондовом рынке Московской Биржи, рассчитанные в соответствии с методическими рекомендациями Банка России

tradedate	Дата сделки
tradeno	Номер сделки в торговой системе
buysell	Направление (B-покупка, S-продажа)
firmid	Код участника торгов
securityid	Код инструмента фондового рынка
Сущ.отклонение по цене	Признак существенного отклонения по цене (Y, N)
Сущ.отклонение по объему	Признак существенного отклонения по объему (Y, N)

Валютный рынок

Файл **signals_FIRM_cu_YYYY-MM-DD.xlsx** – сигналы по нестандартным сделкам/заявкам, совершенным/поданным участником торгов и его клиентами на Валютном рынке Московской Биржи

evdate	Дата выявления сигнала
sigtyp	Тип рынка ("cu" для валютного рынка)
crit_name	Код-наименование критерия
seccode	Код валютной пары
clientcode	Код клиента
tsno	Номер транзакции (номер сделки для критериев по сделкам, номер заявки для критериев по заявкам)
message	Сообщение системы мониторинга с описанием критерия срабатывания

Срочный рынок

Файл **signals_FIRM_dm_YYYY-MM-DD.xlsx** – сигналы по нестандартным сделкам/заявкам, совершенным/поданным участником торгов и его клиентами на Срочном рынке Московской Биржи

evdate	Дата выявления сигнала
sigtyp	Тип рынка ("fo" для срочного рынка)

crit_name	Код-наименование критерия
seccode	Код инструмента срочного рынка
clientcode	Код раздела клирингового регистра Участника торгов (клиента Участника торгов)
tsno	Номер транзакции (номер сделки для критериев по сделкам, номер заявки для критериев по заявкам)
message	Сообщение системы мониторинга с описанием критерия срабатывания