**Отчеты о нестандартных сделках Маркет-мейкера «MMNSTDTrades»**

**Пакет файлов YYMMDD\_OrgID\_MMNSTDTrades.zip.p7s.p7e – информация о нестандартных сделках Маркет-мейкера, оказывающего услуги по поддержанию цен, спроса, предложения и (или) объема торгов в отношении инструмента(-ов) Биржевых рынков**[[1]](#footnote-1) **(ценных бумаг, иностранной валюты, драгоценных металлов и (или) производных финансовых инструментов).**

**Порядок предоставления пакета файлов: ежедневно (с информацией по итогам предыдущего торгового дня).**

**Пакет файлов направляется в адрес Участника торгов, выполняющего функции Маркет-мейкера, через Личный кабинет (см. папку «Отчеты ММ по нестандартным сделкам»).**

**Файлы**

**1. Файл YYYY-MM-DD\_OrgID\_EQ\_MMNSTDTrades.XLSX – информация о нестандартных сделках Маркет-мейкера на Фондовом рынке. Файл формата XLSX.**

Структура файла **YYYY-MM-DD\_OrgID\_EQ\_MMNSTDTrades.XLSX**

|  |  |
| --- | --- |
| **Название поля** | **Описание поля** |
| Торговый день | Дата торгового дня |
| Наименование Участника торгов | Краткое наименование организации - Участника торгов |
| Идентификатор Участника торгов | Идентификатор Участника торгов (FirmID) |
| ТКС | Торгово-клиринговый счёт |
| Краткий код клиента | Краткий код клиента (ККК) – уникальные буквенно-цифровые коды, присваиваемые Клиентам Участника торгов ПАО Московская Биржа в соответствии с Правилами допуска к участию в торгах на Фондовом рынке |
| Рег. данные | ИНН Маркет-мейкера или регистрационные данные, предоставленные Маркет-мейкером на ПАО Московская Биржа при регистрации своего Клиента в соответствии с требованиями законодательства |
| Инструмент | Торговый код ценной бумаги |
| Борд | Технологический идентификатор режима торгов в соответствующей валюте расчета |
| Кол-во НС, шт. | Количество Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, в штуках *(по указанному инструменту)* |
| Кол-во НС, в % от всего кол-ва ММ сделок | Отношение количества Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, ко всему количеству сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, % *(по указанному инструменту)* |
| Кол-во НС, в % от всего кол-ва ММ сделок за 60 торг. дней | Отношение количества Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) торговых дней, ко всему количеству сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) торговых дней, % *(по указанному инструменту)* |
| Объем НС, ценные бумаги | Объем Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, в ценных бумагах *(по указанному инструменту)* |
| Объем НС, в % от всего объема ММ торгов | Отношение объема Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, ко всему объему сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, % *(по указанному инструменту)* |
| Объем НС, в % от всего объема ММ торгов за 60 торг. дней | Отношение объема Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) торговых дней, ко всему объему сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) дней, % *(по указанному инструменту)* |
| Кол-во НС, шт. (суммарно по рег. данным) | Количество Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, в штуках *(по указанному инструменту и суммарно по указанным отдельно взятым регистрационным данным, к которым принадлежат все Идентификаторы ММ[[2]](#footnote-2), указанные в заключенном с Биржей договоре о выполнении функций маркет-мейкера (далее – ММ договор))* |
| Кол-во НС, в % от всего кол-ва ММ сделок (суммарно по рег. данным) | Отношение количества Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, ко всему количеству сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, % *(по указанному инструменту и суммарно по указанным отдельно взятым регистрационным данным, к которым принадлежат все Идентификаторы ММ, указанные в заключенном с Биржей ММ договоре)* |
| Кол-во НС, в % от всего кол-ва ММ сделок за 60 торг. дней (суммарно по рег. данным)  Показатель 1[[3]](#footnote-3) | Отношение количества Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) торговых дней, ко всему количеству сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) торговых дней, % *(по указанному инструменту и суммарно по указанным отдельно взятым регистрационным данным, к которым принадлежат все Идентификаторы ММ, указанные в заключенном с Биржей ММ договоре)* |
| Объем НС (суммарно по рег. данным), ценные бумаги | Объем Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, в ценных бумагах *(по указанному инструменту и суммарно по указанным отдельно взятым регистрационным данным, к которым принадлежат все Идентификаторы ММ, указанные в заключенном с Биржей ММ договоре)* |
| Объем НС, в % от всего объема ММ торгов (суммарно по рег. данным) | Отношение объема Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, ко всему объему сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, % *(по указанному инструменту и суммарно по указанным отдельно взятым регистрационным данным, к которым принадлежат все Идентификаторы ММ, указанные в заключенном с Биржей ММ договоре)* |
| Объем НС, в % от всего объема ММ торгов за 60 торг. дней (суммарно по рег. данным)  Показатель 2 | Отношение объема Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) торговых дней, ко всему объему сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) дней, % *(по указанному инструменту и суммарно по указанным отдельно взятым регистрационным данным, к которым принадлежат все Идентификаторы ММ, указанные в заключенном с Биржей ММ договоре)* |

**2. Файл YYYY-MM-DD\_OrgID\_CU\_MMNSTDTrades.XLSX – информация о нестандартных сделках Маркет-мейкера на Валютном рынке. Файл формата XLSX.**

Структура файла **YYYY-MM-DD\_OrgID\_CU\_MMNSTDTrades.XLSX**

|  |  |
| --- | --- |
| **Название поля** | **Описание поля** |
| Торговый день | Дата торгового дня |
| Наименование Участника торгов | Краткое наименование организации - Участника торгов |
| Идентификатор Участника торгов | Идентификатор Участника торгов (FirmID) |
| ТКС | Торгово-клиринговый счёт |
| Краткий код клиента | Краткий код клиента (ККК) – уникальные буквенно-цифровые коды, присваиваемые Клиентам Участника торгов ПАО Московская Биржа в соответствии с Правилами допуска к участию в торгах на Валютном рынке |
| Рег. данные | ИНН Маркет-мейкера или регистрационные данные, предоставленные Маркет-мейкером на ПАО Московская Биржа при регистрации своего Клиента в соответствии с требованиями законодательства |
| Инструмент | Торговый код иностранной валюты/драгоценного металла |
| Борд | Технологический идентификатор режима торгов в соответствующей валюте расчета |
| Кол-во НС, шт. | Количество Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, в штуках *(по указанному инструменту)* |
| Кол-во НС, в % от всего кол-ва ММ сделок | Отношение количества Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, ко всему количеству сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, % *(по указанному инструменту)* |
| Кол-во НС, в % от всего кол-ва ММ сделок за 60 торг. дней | Отношение количества Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) торговых дней, ко всему количеству сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) торговых дней, % *(по указанному инструменту)* |
| Объем НС, валюта инструмента | Объем Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, в валюте инструмента *(по указанному инструменту)* |
| Объем НС, в % от всего объема ММ торгов | Отношение объема Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, ко всему объему сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, % *(по указанному инструменту)* |
| Объем НС, в % от всего объема ММ торгов за 60 торг. дней | Отношение объема Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) торговых дней, ко всему объему сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) дней, % *(по указанному инструменту)* |
| Кол-во НС, шт. (суммарно по рег. данным) | Количество Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, в штуках *(по указанному инструменту и суммарно по указанным отдельно взятым регистрационным данным, к которым принадлежат все Идентификаторы ММ[[4]](#footnote-4), указанные в заключенном с Биржей договоре о выполнении функций маркет-мейкера (далее – ММ договор))* |
| Кол-во НС, в % от всего кол-ва ММ сделок (суммарно по рег. данным) | Отношение количества Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, ко всему количеству сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, % *(по указанному инструменту и суммарно по указанным отдельно взятым регистрационным данным, к которым принадлежат все Идентификаторы ММ, указанные в заключенном с Биржей ММ договоре)* |
| Кол-во НС, в % от всего кол-ва ММ сделок за 60 торг. дней (суммарно по рег. данным)  Показатель 1 | Отношение количества Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) торговых дней, ко всему количеству сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) торговых дней, % *(по указанному инструменту и суммарно по указанным отдельно взятым регистрационным данным, к которым принадлежат все Идентификаторы ММ, указанные в заключенном с Биржей ММ договоре)* |
| Объем НС (суммарно по рег. данным), валюта инструмента | Объем Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, в валюте инструмента *(по указанному инструменту и суммарно по указанным отдельно взятым регистрационным данным, к которым принадлежат все Идентификаторы ММ, указанные в заключенном с Биржей ММ договоре)* |
| Объем НС, в % от всего объема ММ торгов (суммарно по рег. данным) | Отношение объема Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, ко всему объему сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, % *(по указанному инструменту и суммарно по указанным отдельно взятым регистрационным данным, к которым принадлежат все Идентификаторы ММ, указанные в заключенном с Биржей ММ договоре)* |
| Объем НС, в % от всего объема ММ торгов за 60 торг. дней (суммарно по рег. данным)  Показатель 2 | Отношение объема Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) торговых дней, ко всему объему сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) дней, % *(по указанному инструменту и суммарно по указанным отдельно взятым регистрационным данным, к которым принадлежат все Идентификаторы ММ, указанные в заключенном с Биржей ММ договоре)* |

**3. Файл YYYY-MM-DD\_OrgID\_FO\_MMNSTDTrades.XLSX – информация о нестандартных сделках Маркет-мейкера на Срочном рынке. Файл формата XLSX.**

Структура файла **YYYY-MM-DD\_OrgID\_FO\_MMNSTDTrades.XLSX**

|  |  |
| --- | --- |
| **Название поля** | **Описание поля** |
| Торговый день | Дата торгового дня |
| Наименование Участника торгов | Краткое наименование организации - Участника торгов |
| Идентификатор Участника торгов | Код раздела клиринговых регистров |
| Код раздела регистра учета позиций | Код раздела регистра учета позиций |
| Рег. данные | ИНН Маркет-мейкера или регистрационные данные, предоставленные Маркет-мейкером на ПАО Московская Биржа при регистрации своего Клиента в соответствии с требованиями законодательства |
| Код фьючерса | Код (обозначение) фьючерсного контракта |
| Режим торгов | Тип срочного контракта (Фьючерсы/Опционы) |
| БА фьючерса | Код базового актива фьючерсного контракта |
| Период обращения инструмента | Периодичность экспирации инструмента: Квартальный/Неквартальный/Месячный/Недельный. Под инструментом с Квартальным периодом обращения понимается инструмент с экспирацией в следующие месяцы: март, июнь, сентябрь и декабрь.  Под инструментом с Неквартальным периодом обращения понимается инструмент с экспирацией во все месяцы, кроме марта, июня, сентября и декабря.  Под инструментом с Месячным периодом обращения понимается инструмент с ежемесячной экспирацией. Под инструментом с Недельным периодом обращения понимается инструмент с еженедельной экспирацией, кроме тех недель, когда происходит экспирация Квартальных и Месячных инструментов. |
| № Срока исполнения инструмента | Порядковый номер срока исполнения по фьючерсному / опционному контракту, обозначаемый как i=n (n = 1, 2, …), где n=1 – это номер срока исполнения по фьючерсному / опционному контракту наименее удаленный от торгового дня, в который участник торгов выполняет функции Маркет-мейкера по данному фьючерсному / опционному контракту |
| День экспирации | Дата окончания обращения фьючерсного/опционного контракта (дата исполнения) |
| Кол-во НС, шт. | Количество Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, в штуках *(по указанному инструменту)* |
| Кол-во НС, в % от всего кол-ва ММ сделок | Отношение количества Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, ко всему количеству сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, % *(по указанному инструменту)* |
| Кол-во НС, в % от всего кол-ва ММ сделок за 60 торг. дней | Отношение количества Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) торговых дней, ко всему количеству сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) торговых дней, % *(по указанному инструменту)* |
| Объем НС, контракты | Объем Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, в контрактах *(по указанному инструменту)* |
| Объем НС, в % от всего объема ММ торгов | Отношение объема Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, ко всему объему сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, % *(по указанному инструменту)* |
| Объем НС, в % от всего объема ММ торгов за 60 торг. Дней | Отношение объема Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) торговых дней, ко всему объему сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) дней, % *(по указанному инструменту)* |
| Кол-во НС, шт. (суммарно по рег. данным) | Количество Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, в штуках *(по указанному инструменту и суммарно по указанным отдельно взятым регистрационным данным, к которым принадлежат все Идентификаторы ММ, указанные в заключенном с Биржей договоре о выполнении функций маркет-мейкера (далее – ММ договор))* |
| Кол-во НС, в % от всего кол-ва ММ сделок (суммарно по рег. данным) | Отношение количества Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, ко всему количеству сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, % *(по указанному инструменту и суммарно по указанным отдельно взятым регистрационным данным, к которым принадлежат все Идентификаторы ММ, указанные в заключенном с Биржей ММ договоре)* |
| Кол-во НС, в % от всего кол-ва ММ сделок за 60 торг. дней (суммарно по рег. данным)  Показатель 1 | Отношение количества Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) торговых дней, ко всему количеству сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) торговых дней, % *(по указанному инструменту и суммарно по указанным отдельно взятым регистрационным данным, к которым принадлежат все Идентификаторы ММ, указанные в заключенном с Биржей ММ договоре)* |
| Объем НС (суммарно по рег. данным), контракты | Объем Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, в контрактах *(по указанному инструменту и суммарно по указанным отдельно взятым регистрационным данным, к которым принадлежат все Идентификаторы ММ, указанные в заключенном с Биржей ММ договоре)* |
| Объем НС, в % от всего объема ММ торгов (суммарно по рег. данным) | Отношение объема Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, ко всему объему сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им в отчетный торговый день, % *(по указанному инструменту и суммарно по указанным отдельно взятым регистрационным данным, к которым принадлежат все Идентификаторы ММ, указанные в заключенном с Биржей ММ договоре)* |
| Объем НС, в % от всего объема ММ торгов за 60 торг. дней (суммарно по рег. данным)  Показатель 2 | Отношение объема Нестандартных сделок Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) торговых дней, ко всему объему сделок данного Маркет-мейкера, совершенных им за последние 60 (Шестьдесят) дней, % *(по указанному инструменту и суммарно по указанным отдельно взятым регистрационным данным, к которым принадлежат все Идентификаторы ММ, указанные в заключенном с Биржей ММ договоре)* |

1. Биржевой рынок – одна из торговых (биржевых) секций ПАО Московская Биржа, на которой ПАО Московская Биржа является организатором торговли. В настоящем документе Биржевыми рынками называются:

   Фондовый рынок – Секция Фондового рынка ПАО Московская Биржа;

   Валютный рынок – Валютный рынок и рынок драгоценных металлов ПАО Московская Биржа, на котором заключаются сделки с иностранной валютой и драгоценными металлами;

   Срочный рынок – Срочный рынок ПАО Московская Биржа. [↑](#footnote-ref-1)
2. Идентификатор Маркет-мейкера (Идентификатор ММ) – буквенно-цифровой код или сочетание нескольких таких кодов, по которому(-ым) учитывается информация об исполнении обязательств Маркет-мейкера и рассчитывается его вознаграждение. Биржевым рынкам соответствуют следующие Идентификаторы ММ:

   • Идентификатор маркет-мейкера для Фондового рынка – идентификатор Участника торгов и Торгово-клиринговый счёт (ТКС) или идентификатор Участника торгов и Торгово-клиринговый счёт (ТКС) и Краткий код клиента (ККК);

   • Идентификатор маркет-мейкера для Валютного рынка – идентификатор Участника торгов и/или расчетный код/группа расчетных кодов;

   • Идентификатор маркет-мейкера для Срочного рынка – код раздела регистра учета позиций/группа кодов раздела регистра учета позиций. [↑](#footnote-ref-2)
3. Показатель 1 и Показатель 2 – показатели, после одновременного превышения которых хотя бы 1 (Один) раз в течение Отчетного периода (календарного месяца) в ходе исполнения Маркет-мейкером своих обязательств ПАО Московская Биржа проводит проверку на предмет добросовестного исполнения обязательств Маркет-мейкера. [↑](#footnote-ref-3)
4. Идентификатор Маркет-мейкера (Идентификатор ММ) – буквенно-цифровой код или сочетание нескольких таких кодов, по которому(-ым) учитывается информация об исполнении обязательств Маркет-мейкера и рассчитывается его вознаграждение. Биржевым рынкам соответствуют следующие Идентификаторы ММ:

   • Идентификатор маркет-мейкера для Фондового рынка – идентификатор Участника торгов и Торгово-клиринговый счёт (ТКС) или идентификатор Участника торгов и Торгово-клиринговый счёт (ТКС) и Краткий код клиента (ККК);

   • Идентификатор маркет-мейкера для Валютного рынка – идентификатор Участника торгов и/или расчетный код/группа расчетных кодов;

   • Идентификатор маркет-мейкера для Срочного рынка – код раздела регистра учета позиций/группа кодов раздела регистра учета позиций. [↑](#footnote-ref-4)