Утверждены Приказом

ПАО Московская Биржа

от 05.05.2017 г. №766-од

**Параметры заявок и отчетные документы валютного рынка и рынка драгоценных металлов (в новой редакции)**

1. **Параметры заявок**
   1. Среднее допустимое количество действий[[1]](#footnote-1)\* в секунду, выполняемых в Торговой системе с использованием торгового идентификатора на протяжении 5 минут, – 150.
   2. Среднее допустимое количество сообщений об ошибке в секунду, формируемых в Торговой системе вследствие ошибочных действий, выполняемых с использованием торгового идентификатора на протяжении 5 минут, – 10.
   3. Минимальное количество лотов, указываемых в заявке типа «скрыть количество» и отображаемых в окне текущих котировок, – 1 000.
   4. Максимальное соотношение количества лотов, скрытых в заявке типа «скрыть количество», к количеству лотов, отображаемых в окне текущих котировок, – 100:1.
2. **Отчетные документы** 
   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\_NNNNNNNNN.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;

*NNNNNNNNN* - 8-символьный уникальный номер ЭД или ЭС.

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

* 1. **Выписка из реестра заявок**

Пример имени файла: ***MB12345\_CUX22\_000\_031011\_12345678.xml***

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

Файл в виде (электронного документа) ЭД формируется и направляется по требованию Участника торгов посредством системы ЭДО.

* + 1. *ФОРМА*

**Выписка из реестра заявок**

Дата регистрации заявок: <дата>

Биржа: **ПАО Московская Биржа**

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

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

Расчетный код Участника клиринга: **<Расчетный код 1>…<Расчетный код N>**

Расчетный код Участника торгов: **< Расчетный код 1>…< Расчетный код N> /**

Расчетный код клиента Участника торгов: **< Расчетный код 1>…< Расчетный код N>**

Наименование сессии: **<Тип сессии>**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Сделка спот/поставочный фьючерс: | | | **<Код сделки спот/ поставочного фьючерса>** | | | Валюта лота: | | | **<Наименование>** | | |  | |  | | | |  |
| Дата исполнения: | | | **<Дата>** | | | Сопряж. валюта: | | | **<Наименование>** | | | Котировки за: | | ед. валюты лота | | | |  |
| Номер заявки | Торговый идентификатор/ Идентификатор спонсируемого доступа | АСП Участника торгов | | Время  регистрации  заявки | Направлен. | Код режима торгов | Тип | Объем в валюте лота, ед. валюты | | | Предельная цена заявки | | Статус | | Время  снятия | Остаток заявки | Контрагент | | | Код ТКС | Краткий код Клиента |
| Всего | | Скрыто |
|  |  |  | |  |  |  |  |  | |  |  | |  | |  |  |  | | |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |  |  | |  |  | |  | |  |  |  | | |  |  |

*Заявки на заключение сделок своп/своп контрактов*

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Сделка своп/  своп контракт: | | | **<Код сделки своп / своп контракта>** | | | Валюта лота: | | | **<Наименование>** | | |  | |  | | |  | |
| Сопряж. валюта: | | | **<Наименование>** | | | Котировки за: | | ед. валюты лота | | |  | |
| Номер заявки | Торговый идентификатор/ Идентификатор спонсируемого доступа | АСП Участника торгов | | Время  регистрации  заявки | Направлен. | Код режима торгов | Тип | Базовый курс | | Объем в валюте лота, ед. валюты | Предельная цена заявки | | Статус | | Время  снятия | Остаток заявки | | Контрагент | | Код ТКС | Краткий код Клиента |
|  |  |  | |  |  |  |  |  | |  |  | |  | |  |  | |  | |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |  |  | |  |  | |  | |  |  | |  | |  |  |

**Уполномоченный представитель Биржи:** \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_/ФИО/

* + 1. *СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО СООБЩЕНИЯ (XML-ФАЙЛ) «ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА ЗАЯВОК» CUX22*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 |  |  |  |  |  |  |
| CUX22 |  | 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 Участника клиринга |  |  |  |  |
|  | ExtSettleCode | Расчетный код Участника клиринга | Да | Character | 20 |  |
| TRADEACC |  | Блок информации по Расчетному коду Участника торгов / клиента Участника торгов |  |  |  |  |
|  | ExtTradeCode | Расчетный код Участника торгов / Расчетный код клиента Участника торгов | Да | Character | 20 |  |
|  | ExtTradeCodeType | Тип Расчетного кода Участника торгов: TRADE – Расчетный код Участника торгов, CLIENT - Расчетный код клиента Участника торгов | Да | Character | 10 |  |
| 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 |  |  |
| CURRPAIR |  | Блок данных валютной пары |  |  |  |  |
|  | CurrencyId | Идентификатор валюты лота | Да | Character | 4 |  |
|  | CurrencyName | Наименование валюты лота | Да | Character | 30 |  |
|  | CurrencyNameEN | Наименование валюты лота (eng) | Да | Character | 30 |  |
|  | CoCurrencyId | Идентификатор сопряженной валюты | Да | Character | 4 |  |
|  | CoCurrencyName | Наименование сопряженной валюты | Да | Character | 30 |  |
|  | CoCurrencyNameEN | Наименование сопряженной валюты (eng) | Да | Character | 30 |  |
| SECURITY |  | Блок данных по инструменту |  |  |  |  |
|  | SecurityId | Идентификатор инструмента | Да | Character | 12 |  |
|  | SecShortName | Краткое наименование инструмента | Да | Character | 10 |  |
|  | FaceValue | Котировка | Да | Number | 20 | 6 |
| SETTLEDATE |  | Блок данных по дате исполнения |  |  |  |  |
|  | SettleDate | Дата исполнения | Да | Date |  |  |
| GROUP |  | Блок данных по виду заявки |  |  |  |  |
|  | TradeGroup | Вид заявки: T - заявка на заключение сделки спот/поставочного фьючерса; S - заявка на заключение сделки своп/своп контракта; | 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 валюте лота, ед. валюты | Да | Number | 20 | 0 |
|  | QuantityHidden | Скрытый объем в валюте лота, ед. валюты | 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 |  |
|  | TrdAccId | Код Торгово-клирингового счета соответствующего уровня | Да | 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 |  |  |  |  |  |  |
| /CURRPAIR |  |  |  |  |  |  |
| /SESSION |  |  |  |  |  |  |
| /TRADEACC |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLE |  |  |  |  |  |  |
| /CLEARPART |  |  |  |  |  |  |
| /CUX22 |  |  |  |  |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
| **Тип заявки** | **Значение поля OrderType в отчете CUX22** |
| Безадресная лимитированная заявка типа "поставить в очередь" с указанием исполнения по разным курсам | **LS** |
| Безадресная лимитированная заявка типа "поставить в очередь" с указанием исполнения по одному курсу | **LO** |
| Безадресная лимитированная заявка типа "снять остаток" с указанием исполнения по разным курсам | **LSW** |
| Безадресная лимитированная заявка типа "снять остаток" с указанием исполнения по одному курсу | **LOW** |
| Безадресная лимитированная заявка типа "полностью или отклонить" с указанием исполнения по разным курсам | **LSN** |
| Безадресная лимитированная заявка типа "полностью или отклонить" с указанием исполнения по одному курсу | **LON** |
| Безадресная рыночная заявка с указанием исполнения по разным курсам | **MS** |
| Безадресная рыночная заявка с указанием исполнения по разным курсам, подаваемая посредством РМ ВПТС | **MSN** |
| Адресная заявка на заключение сделок во внесистемном режиме торгов, заявка на заключение безадресной сделки типа «всем» и заявка на заключение сделки типа «аукцион» | **NO** |

В безадресных лимитированных заявках допускается указание типа заявки «скрыть количество».

* 1. **Выписка из реестра сделок**

Пример имени файла: ***MB12345\_CUX23\_D01\_031011\_12345678.xml.p7s***

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

**DNN** – выдается Участникам торгов по окончании торгов по инструментам с датами исполнения обязательств, совпадающими с датой проведения торгов, и/или Участникам торгов, клиринговые брокеры которых предоставили Клиринговому центру Постоянное поручение на проведение ранних расчетов или Запрос на проведение ранних расчетов по соответствующему расчетному коду в соответствии с Временным регламентом проведения торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов и Правилами клиринга (NN – порядковый номер сессии),

**MNN** – выдается Участникам торгов после 19:00 (после 18:00 Участникам торгов, подавшим Клиринговому центру соответствующий запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром), по окончании торгов по инструментам с датами исполнения обязательств, превышающими дату проведения торгов, и/или Участникам торгов, клиринговые брокеры которых предоставили Клиринговому центру Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром или Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром по соответствующему расчетному коду в соответствии с Временным регламентом проведения торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов и Правилами клиринга (NN – порядковый номер сессии),

Файлы в виде ЭД формируются и направляются Участнику торгов ежедневно по окончании соответствующих сессий посредством системы ЭДО.

* + 1. *ФОРМА*

**Выписка из реестра сделок**

Дата заключения сделок: <Дата>

Биржа: **ПАО Московская Биржа**

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

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

Расчетный код Участника клиринга: **<Расчетный код 1>…<Расчетный код N>**

Расчетный код Участника торгов: **< Расчетный код 1>…< Расчетный код N> /**

Расчетный код клиента Участника торгов: **< Расчетный код 1>…< Расчетный код N>**

Наименование сессии: **<Тип сессии>**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Сделка спот/поставочный фьючерс | | | | **<Код сделки спот/ поставочного фьючерса>** | | | | | Валюта лота | | | **<Наименование>** | | |  | |  |  | |  | |
| Дата исполнения | | | | **<Дата>** | | | | | Сопряж. валюта | | | **<Наименование>** | | | Котировки за | |  | ед. валюты лота | |  | |
| Номер сделки | | Время заключения сделки | Код режима торгов | | Направлен. | Курс сделки | Объем в валюте лота, ед. валюты | Объем в сопряж. валюте, ед. валюты | | Номер заявки | Сделка с ПФИ | | | Контрагент | | Комисс. вознагр. за организацию торгов, руб. | | | Вознаграждение за предоставление ИТС, руб. | | Комисс. вознагр. за клиринг. обслуживание, руб. | | Комиссия всего по сделке, руб. | Код ТКС | Краткий код Клиента |
|  | |  |  | |  |  |  |  | |  |  | | |  | |  | | |  | |  | |  |  |  |
|  | |  |  | |  |  |  |  | |  |  | | |  | |  | | |  | |  | |  |  |  |
|  | Итого покупка: | | | | | |  |  | | Итого по комиссии: | | | | | |  | | |  | |  | |  |  |
|  | Итого продажа: | | | | | |  |  | |  | | |

*Сделки, входящие в сделку своп/своп контракт*

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Сделка своп/  своп контракт: | | | | **<Код сделки своп / своп контракта>** | | | | | Валюта лота: | | | | **<Наименование>** | |  | |  | |  | |
| Сопряж. валюта: | | | | **<Наименование>** | | Котировки за: | | ед. валюты лота | |  | |
| Номер сделки | | Время заключения сделки | Код режима торгов | | Направлен. | Курс сделки | Объем в валюте лота, ед. валюты | Объем в сопряж. валюте, ед. валюты | | Номер заявки | Сделка с ПФИ | | | Контрагент | | Комисс. вознагр. за организацию торгов, руб. | | Вознаграждение за предоставление ИТС, руб. | | Комисс. вознагр. за клиринг. обслуживание, руб. | | Комиссия всего по сделке, руб. | Код ТКС | Краткий код Клиента |
|  | |  |  | |  |  |  |  | |  |  | | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |
|  | |  |  | |  |  |  |  | |  |  | | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |
|  | Итого покупка: | | | | | |  |  | | Итого по комиссии: | | | | | |  | |  | |  | |  |  |
|  | Итого продажа: | | | | | |  |  | |  | |

**Уполномоченный представитель Биржи:** \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_/ФИО/

* + 1. *СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО ДОКУМЕНТА (XML-ФАЙЛ) «ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА СДЕЛОК» CUX23*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 |  |  |  |  |  |  |
| CUX23 |  | 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 Участника клиринга |  |  |  |  |
|  | ExtSettleCode | Расчетный код Участника клиринга | Да | Character | 20 |  |
| TRADEACC |  | Блок информации по Расчетному коду Участника торгов / клиента Участника торгов |  |  |  |  |
|  | ExtTradeCode | Расчетный код Участника торгов Расчетный код клиента Участника торгов | Да | Character | 20 |  |
|  | ExtTradeCodeType | Тип Расчетного кода Участника торгов: TRADE – Расчетный код Участника торгов, CLIENT - Расчетный код клиента Участника торгов | Да | Character | 10 |  |
| 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 |  |  |
|  | SessionNameEN | Наименование сессии (eng) | Да | Character |  |  |
| CURRPAIR |  | Блок данных валютной пары |  |  |  |  |
|  | CurrencyId | Идентификатор валюты лота | Да | Character | 4 |  |
|  | CurrencyName | Наименование валюты лота | Да | Character | 30 |  |
|  | CurrencyNameEN | Наименование валюты лота (eng) | Да | Character | 30 |  |
|  | CoCurrencyId | Идентификатор сопряженной валюты | Да | Character | 4 |  |
|  | CoCurrencyName | Наименование сопряженной валюты | Да | Character | 30 |  |
|  | CoCurrencyNameEN | Наименование сопряженной валюты (eng) | Да | Character | 30 |  |
| SECURITY |  | Блок данных инструменту |  |  |  |  |
|  | SecurityId | Идентификатор инструмента | Да | Character | 12 |  |
|  | SecShortName | Краткое наименование инструмента | Да | Character | 10 |  |
|  | FaceValue | Котировка | Да | Number | 20 | 6 |
| SETTLEDATE |  | Блок данных по дате исполнения |  |  |  |  |
|  | SettleDate | Дата исполнения | Да | Date |  |  |
| GROUP |  | Блок данных по виду сделки |  |  |  |  |
|  | TradeGroup | Вид сделки: T - сделка спот/поставочный фьючерс; S - сделка своп/своп контракт; | Да | Character | 1 |  |
| MAINSEC |  | Блок данных по типам титульных "лицевых" сделок |  |  |  |  |
|  | MainSecurityId | Идентификатор инструмента титульной сделки своп/своп контракта | Да | Character | 12 |  |
|  | MainSecShortName | Краткое наименование инструмента титульной сделки своп/своп контракта | Да | Character | 10 |  |
| RECORDS |  | Блок данных по сделке |  |  |  |  |
|  | TradeNo | Номер сделки | Да | Number | 20 | 0 |
|  | BuySell | Направление сделки: B – Покупка; S – Продажа; | Да | Character | 1 |  |
|  | OrderNo | Номер заявки | Да | Number | 20 | 0 |
|  | TradeDeriv | Сделка с ПФИ: Y – Да; N – Нет; | Да | Character | 1 |  |
|  | TradeTime | Время заключения сделки | Да | Time |  |  |
|  | TradeType | Тип сделки: Т – безадресная; N – адресная; S – безадресная, входящая в своп/своп контракт; W – адресная, входящая в своп/своп контракт; | Да | Character | 1 |  |
|  | Decimals | Число значимых знаков после запятой в курсе сделки (атрибут Price) | Да | Number |  |  |
|  | Price | Курс сделки | Да | Number | 20 | 6 |
|  | Quantity | Объем в валюте лота, ед. валюты | Да | Number | 20 | 0 |
|  | Value | Объем в сопряженной валюте, ед. валюты | Да | Number | 20 | 2 |
|  | CPFirmId | Контрагент | Нет | Character | 0-12 |  |
|  | Period | Период торгов: O – период открытия; N – нормальный период; C – период закрытия; | Да | Character | 1 |  |
|  | SettleCode | Код расчетов | Да | Character | 12 |  |
|  | UserId | Торговый идентификатор Участника торгов/ Идентификатор спонсируемого доступа | Да | Character | 0-12 |  |
|  | UserExchangeId | Идентификатор региона доступа Участника торгов | Да | Character | 4 |  |
|  | BrokerRef | Примечание, дополнительная справочная информация | Нет | Character | 20 |  |
|  | ExtRef | Поле-примечание, используется для обратной связи с внешними системам | Нет | Character | 12 |  |
|  | ExchComm | Комиссионное вознаграждение за организацию торгов, руб. | Нет | Number | 20 | 2 |
|  | ITSComm | Вознаграждение за предоставление ИТС, руб. | Нет | Number | 20 | 2 |
|  | ClrComm | Комиссионное вознаграждение за клиринговое обслуживание, руб. | Нет | Number | 20 | 2 |
|  | SumComm | Итоговая комиссия | Нет | Number | 20 | 2 |
|  | TrdAccId | Код Торгово-клирингового счета соответствующего уровня | Да | 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 |  |
|  | RepoTradeNo | Номер титульной сделки своп/своп контракта | Нет | Number | 20 | 0 |
|  | BoardId | Идентификатор правил торгов | Да | Character | 4 |  |
|  | BoardName | Наименование правил торгов | Да | Character | 30 |  |
|  | BoardNameEN | Наименование правил торгов (eng) | Да | Character | 30 |  |
| /RECORDS |  |  |  |  |  |  |
| /MAINSEC |  |  |  |  |  |  |
| /GROUP |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLEDATE |  |  |  |  |  |  |
| /SECURITY |  |  |  |  |  |  |
| /CURRPAIR |  |  |  |  |  |  |
| /SESSION |  |  |  |  |  |  |
| /TRADEACC |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLE |  |  |  |  |  |  |
| /CLEARPART |  |  |  |  |  |  |
| /CUX23 |  |  |  |  |  |  |
| /MICEX\_DOC |  |  |  |  |  |  |

* 1. **Выписка из реестра сделок (сделки аналитического учета)**

Пример имени файла: ***MB12345\_CUX33\_000\_031011\_12345678.xml***

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

Файлы в виде ЭД формируются и направляются Участнику торгов ежедневно по окончании соответствующих сессий посредством системы ЭДО.

* + 1. *ФОРМА*

**Выписка из реестра сделок (сделки аналитического учета)**

Дата заключения сделок: <Дата>

Биржа: **ПАО Московская Биржа**

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

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

Расчетный код Участника клиринга: <**Расчетный код 1**> … <**Расчетный код N**>

Расчетный код Участника торгов: **< Расчетный код 1>…< Расчетный код N> /**

Расчетный код клиента Участника торгов: **< Расчетный код 1>…< Расчетный код N>**

Наименование сессии: **<Тип сессии>**

*Сделки своп/своп контракты*

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Сделка своп/  своп контракт: | | | | | **<Код сделки своп / своп контракта>** | | | Валюта лота: | | | **<Наименование>** | |  | | | |  | |  | |
| Сопряж. валюта: | | | **<Наименование>** | | Котировки за: | | | |  | | ед. валюты лота | |
| Номер сделки | | Время заключения сделки | | Код режима торгов | | Направлен. | Базовый курс | | Курс сделки | Объем в валюте лота, ед. валюты | | Объем в сопряж. валюте, ед. валюты[[2]](#footnote-2)\* | | Номер заявки | Контрагент | | | Код ТКС | | Краткий код Клиента |
|  | |  | |  | |  |  | |  |  | |  | |  |  | | |  | |  |
|  | |  | |  | |  |  | |  |  | |  | |  |  | | |  | |  |
|  |  | | Итого покупка: | | | | | | |  | |  | |  | |
|  |  | | Итого продажа: | | | | | | |  | |  | |  | |

**Уполномоченный представитель Биржи:** \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_/ФИО/

* + 1. *СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО ДОКУМЕНТА (XML-ФАЙЛ) «ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА СДЕЛОК (СДЕЛКИ АНАЛИТИЧЕСКОГО УЧЕТА)» CUX33*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 |  |  |  |  |  |  |
| CUX33 |  | 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 Участника клиринга |  |  |  |  |
|  | ExtSettleCode | Расчетный код Участника клиринга | Да | Character | 20 |  |
| TRADEACC |  | Блок информации по Расчетному коду Участника торгов / клиента Участника торгов |  |  |  |  |
|  | ExtTradeCode | Расчетный код Участника торгов / Расчетный код клиента Участника торгов | Да | Character | 20 |  |
|  | ExtTradeCodeType | Тип Расчетного кода Участника торгов: TRADE – Расчетный код Участника торгов, CLIENT - Расчетный код клиента Участника торгов | Да | Character | 10 |  |
| 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 |  |  |
|  | SessionNameEN | Наименование сессии (eng) | Да | Character |  |  |
| GROUP |  | Блок данных по виду сделки |  |  |  |  |
|  | TradeGroup | Вид сделки: S - сделка своп/своп контракт; | Да | Character | 1 |  |
| CURRPAIR |  | Блок данных валютной пары |  |  |  |  |
|  | CurrencyId | Идентификатор валюты лота | Да | Character | 4 |  |
|  | CurrencyName | Наименование валюты лота | Да | Character | 30 |  |
|  | CurrencyNameEN | Наименование валюты лота | Да | Character | 30 |  |
|  | CoCurrencyId | Идентификатор сопряженной валюты | Да | Character | 4 |  |
|  | CoCurrencyName | Наименование сопряженной валюты | Да | Character | 30 |  |
|  | CoCurrencyNameEN | Наименование сопряженной валюты | Да | Character | 30 |  |
|  | FaceValue | Котировка | Да | Number | 20 | 6 |
| SECURITY |  | Блок данных инструменту |  |  |  |  |
|  | SecurityId | Идентификатор инструмента | Да | Character | 12 |  |
|  | SecShortName | Краткое наименование инструмента | Да | Character | 10 |  |
| RECORDS |  | Блок данных по сделке |  |  |  |  |
|  | TradeNo | Номер сделки | Да | Number | 20 | 0 |
|  | BuySell | Направление сделки: B – Покупка; S – Продажа | Да | Character | 1 |  |
|  | OrderNo | Номер заявки | Да | Number | 20 | 0 |
|  | TradeTime | Время заключения сделки | Да | Time |  |  |
|  | TradeType | Тип сделки: Т – безадресная; N – адресная; S – безадресная, входящая в своп/своп контракт; W – адресная, входящая в своп/своп контракт; | Да | Character | 1 |  |
|  | BasePrice | Базовый курс | Нет | Number | 20 | 6 |
|  | Decimals | Число значимых знаков после запятой в курсе сделки (атрибут Price) | Да | Number |  |  |
|  | Price | Курс сделки | Да | Number | 20 | 6 |
|  | Quantity | Объем в валюте лота, ед. валюты | Да | Number | 20 | 0 |
|  | Value | Объем в сопряженной валюте, ед. валюты | Да | Number | 20 | 2 |
|  | CPFirmId | Контрагент | Нет | Character | 0-12 |  |
|  | TrdAccId | Код Торгово-клирингового счета соответствующего уровня | Да | 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 |  |
|  | RepoTradeNo | Номер титульной сделки своп/своп контракта | Нет | Number | 20 | 0 |
|  | BoardId | Идентификатор правил торгов | Да | Character | 4 |  |
|  | BoardName | Наименование правил торгов | Да | Character | 30 |  |
|  | BoardNameEN | Наименование правил торгов (eng) | Да | Character | 30 |  |
| /RECORDS |  |  |  |  |  |  |
| /SECURITY |  |  |  |  |  |  |
| /CURRPAIR |  |  |  |  |  |  |
| /GROUP |  |  |  |  |  |  |
| /SESSION |  |  |  |  |  |  |
| /TRADEACC |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLE |  |  |  |  |  |  |
| /CLEARPART |  |  |  |  |  |  |
| /CUX33 |  |  |  |  |  |  |
| /MICEX\_DOC |  |  |  |  |  |  |

* 1. **CUX24: Структура электронного сообщения (XML-файл) «Выписка из реестра транзакций»**

Пример имени файла: **MB12345\_CUX24\_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 |  |  |  |  |  |  |
| CUX24 |  | 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 |  |  |  |  |  |  |
| /CUX24 |  |  |  |  |  |  |

* 1. **Отчет по обязательствам Участника торгов по Дополнительному Комиссионному Сбору (ДКС)**

Пример имени файла: **MB12345\_CUX16\_000\_031015\_12345678.xml**

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

Файлы в виде ЭС формируется и направляется посредством электронных каналов связи только Участникам торгов валютного рынка.

* + 1. *ФОРМА*

**Отчет по обязательствам Участника торгов по**

**Дополнительному Комиссионному Сбору (ДКС)**

Дата торгов: <дата>

Биржа: **ПАО Московская Биржа**

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

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Реквизиты гиперактивного торгового автомата (ГТА) | ИНН Участника торгов | Краткий код клиента | ИНН или  № паспорта  клиента | ИНН или № паспорта клиента субброкера | Количество заявок с учетом маркет-мейкерских (округляется при расчете по коэффициентам L1, L2) | Сумма комиссионного вознаграждения для расчета ДКС (информационно), руб.\* | Сумма комиссионного вознаграждения для расчета ДКС, руб.\*\* | Расчетное значение ДКС (информационно), руб. | Сумма ДКС, руб. | Код денежной позиции для уплаты ДКС |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

\* - рассчитывается по сделкам, не являющимися внесистемными и не входящими в сделки своп с учетом влияния на ДКС объема в заявках (коэффициенты K1, K2).

\*\* - рассчитывается по сделкам, не являющимися внесистемными и не входящими в сделки своп, с учетом влияния на ДКС объема в заявках (коэффициенты K1, K2) и с поправкой на коэффициент учета тарифного плана, выбранного по данному регистрационному коду (коэффициент F).

Уполномоченный представитель Биржи \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

* + 1. *СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО СООБЩЕНИЯ (XML-ФАЙЛ) «ОТЧЕТ ПО ОБЯЗАТЕЛЬСТВАМ УЧАСТНИКА ТОРГОВ ПО ДОПОЛНИТЕЛЬНОМУ КОМИССИОННОМУ СБОРУ (ДКС)»*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 |  |  |  |  |  |  |
| CUX16 |  | 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 |  |
| RECORDS |  | Данные по ДКС для клиента Участника торгов |  |  |  |  |
|  | DetailsGTA | Реквизиты ГТА (ИНН Участника торгов/ ИНН или № паспорта Клиента) | Да | Character | 20 |  |
|  | NumOrdersGTA | Общее количество заявок для расчета ДКС (с учетом коэффициентов L1, L2) | Да | Number | 20 | 0 |
|  | InfoSumCommissionGTA | Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов K1, K2), рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп, руб. | Да | Number | 20 | 2 |
|  | SumCommissionGTA | Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов K1, K2), рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп, с поправкой на коэффициент учета тарифного плана (коэффициент F), руб. | Да | Number | 20 | 2 |
|  | InfoGTACommission | Расчетное значение общей суммы ДКС взимаемого с ГТА (информационно), руб. | Да | Number | 20 | 2 |
|  | GTACommission | Общая сумма ДКС взимаемого с ГТА, руб. | Да | Number | 20 | 2 |
|  | BankAccId | Код денежной позиции для уплаты начисленного ДКС | Нет | Character | 12 |  |
| DETAILS |  | Детальная информация по клиенту |  |  |  |  |
|  | FirmINN | ИНН Участника торгов | Да | Character | 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 |  |
|  | NumOrders | Количество заявок (с учетом коэффициентов L1, L2) | Да | Number | 20 | 0 |
|  | InfoSumCommission | Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов K1, K2), рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп, руб. | Да | Number | 20 | 2 |
|  | SumCommission | Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов K1, K2), рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп, с поправкой на коэффициент учета тарифного плана (коэффициент F), руб. | Да | Number | 20 | 2 |
| /DETAILS |  |  |  |  |  |  |
| /RECORDS |  |  |  |  |  |  |
| /CUX16 |  |  |  |  |  |  |
| /MICEX\_DOC |  |  |  |  |  |  |

1. **ФОРМА ЗАПРОСА НА АКТИВАЦИЮ ТОРГОВОГО ИДЕНТИФИКАТОРА**

**Запрос на активацию торгового идентификатора после исправления ошибки программного обеспечения**

Настоящим уведомляем, что (дата) в программном обеспечении, использовавшемся под торговым идентификатором (№\_\_\_\_\_\_\_), была устранена ошибка, приводящая к нарушению критериев, установленных п. 2.2.4. Раздела 2 «Общие положения» Правил организованных торгов ПАО Московская Биржа на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

Программное обеспечение протестировано и введено в эксплуатацию с (дата, время).

Прошу возобновить возможность осуществления операций в торговой системе посредством торгового идентификатора (№\_\_\_\_\_\_\_).

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

(Должность Руководителя организации)

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_/\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

(Подпись) (Фамилия И.О.)

М.П.

1. \* Под действием, выполняемым с использованием торгового идентификатора в Торговой системе, понимается: подача заявки, снятие заявки или изменение заявки. [↑](#footnote-ref-1)
2. \* *- указывается объем по инструменту с более поздней датой исполнения* [↑](#footnote-ref-2)