Утверждены Приказом

ПАО Московская Биржа

от 29 декабря 2018 г. №2647-од

**Параметры заявок, отчетные документы и коды режимов торгов валютного рынка и рынка драгоценных металлов (в новой редакции)**

1. **Параметры заявок**
	1. Среднее допустимое количество действий[[1]](#footnote-2)\* 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) в формате XML.**

**Формат:** файлы в формате XML (ЭД - подписанный электронной подписью документ);

**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.

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: **<Идентификатор>, <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, в т.ч. сделка фикс/ поставочный фьючерс: | **<Код сделки спот/ сделки фикс/ 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 | Времярегистрациизаявки | Направлен. | Код режима торгов | Тип | Объем в валюте лота, ед. валюты | Предельная цена заявки | Статус | Времяснятия | 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 | Времярегистрациизаявки  | Направлен. | Код режима торгов | Тип | Базовый курс | Объем в валюте лота, ед. валюты | Предельная цена заявки | Статус | Времяснятия | Остаток заявки | Контрагент | Код ТКС | Краткий код Клиента |
|   |  |   |   |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|   |  |   |   |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

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

* + 1. *СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО ДОКУМЕНТА (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 | Идентификатор 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 |  |  |
|  | FixingDate | Дата расчета фиксинга | Нет | Date |  |  |
|  GROUP |  | Блок данных по виду заявки |  |  |  |  |
|  | TradeGroup | Вид заявки: T – заявка на заключение сделки спот, в т.ч. сделки фикс/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 | Нет | Number | 20 | 0 |
|  | Decimals | Число значимых знаков после запятой в предельной цене заявки (атрибут Price) | Да | Number |  |  |
|  | Price | Предельная цена заявки | Нет | 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 "снять остаток" с указанием исполнения по разным курсам | **LSW** |
| Безадресная лимитированная заявка типа "полностью или отклонить" с указанием исполнения по разным курсам | **LSN** |
| Безадресная рыночная заявка типа "поставить в очередь" с указанием исполнения по разным курсам | **MS** |
| Безадресная рыночная заявка типа "полностью или отклонить" с указанием исполнения по разным курсам | **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** |
| Безадресная заявка со средневзвешенной ценой типа "снять остаток" с указанием исполнения по разным курсам | **WSW** |
| Безадресная заявка со средневзвешенной ценой типа "полностью или отклонить" с указанием исполнения по разным курсам | **WSN** |

В безадресных лимитированных заявках на заключение сделок спот (за исключением сделок фикс) допускается указание типа заявки «скрыть количество».

Не допускается подача безадресных заявок типа «всем» на заключение сделок фикс.

Подача безадресных заявок со средневзвешенной ценой допускается только по инструменту USDRUB\_TOM.

* 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: **<Идентификатор>, <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, в т.ч. сделка фикс / поставочный фьючерс: | **<Код сделки спот/ сделки фикс/ 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 | Идентификатор 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, в т.ч. сделка фикс/ 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 системами | 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 по требованию Участника торгов посредством системы ЭДО.

* + 1. *ФОРМА*

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

Дата заключения сделок: <Дата>

Биржа: **ПАО Московская Биржа**

Участник торгов: **<Идентификатор>, <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-3)\* | Номер заявки | Контрагент | Код ТКС | Краткий код Клиента |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  | Итого покупка: |  |  |  |
|  |  | Итого продажа: |  |  |  |

*Сделки фикс*

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Сделка фикс |  | **<Код сделки фикс>** |  Валюта лота: | **<Наименование>** |  |  |  |
|  |  Сопряж. валюта: | **<Наименование>** | Котировки за: | ед. валюты лота |
| Номер сделки | Время заключения сделки | Код режима торгов | Направлен. | Дата расчета фиксинга | Объем в валюте лота, ед. валюты | 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 | Идентификатор 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; F- сделка фикс | 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 | Нет | Number | 20 | 6 |
|  | Quantity | Объем в валюте лота, ед. валюты | Да | Number | 20 | 0 |
|  | Value | Объем в сопряженной валюте, ед. валюты | Нет | 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. **«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 ЭД формируется и направляется по требованию Участника торгов посредством системы ЭДО.

* + 1. *ФОРМА*

**Выписка из реестра транзакций**

<дата>

Биржа: **ПАО Московская Биржа**

Участник торгов: **<Идентификатор>, <Наименование Участника торгов>**

| N п/п | Уникальныйкод заявки | Время | Статус | Причина отказа в регистрации |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  |

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

* + 1. *СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО ДОКУМЕНТА (XML-ФАЙЛ) «ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА ТРАНЗАКЦИЙ» CUX24*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 | Идентификатор 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 ЭД формируется и направляется посредством системы ЭДО 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: <**Идентификатор**>, <**Наименование Участника торгов**>

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Реквизиты гиперактивного торгового автомата (ГТА) | ИНН Участникаторгов | Краткий кодклиента | 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 денежнойпозициидля 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 ДОКУМЕНТА (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 | Идентификатор 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. **Коды режимов торгов с учетом совершаемых на них сделок с инструментами**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Инструменты** | **Системный режим** | **Внесистемный режим** |
| Сделки спот, сделки своп, поставочные своп контракты на иностранную валюту / драгоценные металлы со стандартными периодами исполнения обязательств по второй части своп контракта, поставочные фьючерсные контракты на иностранную валюту / драгоценные металлы с возможностью выбора даты исполнения обязательств | CETS | CNGD |
| Своп контракты на иностранную валюту / драгоценные металлы с фиксированными датами исполнения обязательств по второй части своп контракта, поставочные фьючерсные контракты на иностранную валюту / драгоценные металлы с фиксированными датами исполнения обязательств | FUTS | FUTN |
| Сделки фикс | FIXS | FIXN |
| Сделки своп | Аукцион с Банком РоссииAUCB |
| Инструменты переводов | TRAN |
| Инструменты переводов НКЦ | TRAD |

1. \* Под действием, выполняемым с использованием торгового идентификатора в Торговой системе, понимается: подача заявки, снятие заявки или изменение заявки. [↑](#footnote-ref-2)
2. \* *- указывается объем по инструменту с более поздней датой исполнения* [↑](#footnote-ref-3)