

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

1. Параметры заявок

1.1. Среднее допустимое количество действий* в секунду, выполняемых в Торговой системе с использованием торгового идентификатора на протяжении 5 минут, – 150.

1.2. Среднее допустимое количество сообщений об ошибке в секунду, формируемых в Торговой системе вследствие ошибочных действий, выполняемых с использованием торгового идентификатора на протяжении 5 минут, – 150.

1.3. Минимальное количество лотов, указываемых в заявке типа «скрыть количество» и отображаемых в окне текущих котировок, – 1 000.

1.4. Максимальное соотношение количества лотов, скрытых в заявке типа «скрыть количество», к количеству лотов, отображаемых в окне текущих котировок, – 100:1.

1.5. Для заявок по инструментам USDRUB_TDB, USDRUB_TMB, EURRUB_TDB и EURRUB_TMB с момента их попадания в ПТК ТЦ и до регистрации в Торговой системе допускается искусственная задержка, формируемая случайным образом. Время такой задержки варьируется в диапазоне от 1 мс до 100 мс и определяется уполномоченным органом ПАО Московская Биржа.

Для заявок по инструментам TRYRUB_TOD и TRYRUB_TOM с момента их попадания в ПТК ТЦ и до регистрации в Торговой системе допускается искусственная задержка, формируемая случайным образом. Время такой задержки варьируется в диапазоне от 1 мс до 1000 мс и определяется уполномоченным органом ПАО Московская Биржа.

1.5.1. Сообщение об отмене заявки (транзакция cancel) может быть направлено в ПТК ТЦ только после регистрации заявки в Торговой системе. Искусственная задержка, формируемая случайным образом, не устанавливается для транзакции cancel.

2. Отчетные документы

2.1. 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_NNNNNNNN.xml.p7s.zip.p7e*

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;

* Под действием, выполняемым с использованием торгового идентификатора в Торговой системе, понимается: подача заявки, снятие заявки или изменение заявки.

NNNNNNNN - 8-символьный уникальный номер ЭД.

Здесь «xml» - стандартное расширение XML-файла, «p7s» - стандартное расширение файла, подписанного электронной подписью в системе ЭДО, «zip» - стандартное расширение архивированного файла, «p7e» - стандартное расширение зашифрованного файла.

2.2. 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.

2.2.1. 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,
средневзвешенная сделка/
поставочный фьючерс:

<Код сделки спот/ сделки фикс/
средневзвешенной сделки/ 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	Контр агент	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	Контр агент	Код ТКС	Краткий код Клиента

Уполномоченный представитель Биржи: _____ /ФИО/

2.2.2. 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/ средневзвешенной цены	Нет	Date		
GROUP		Блок данных по виду заявки				
	TradeGroup	Вид заявки: T – заявка на заключение сделки спот, в т.ч. сделки фикс, средневзвешенной сделки /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.

2.3. Выписка из реестра сделок

Пример имени файла: *MB12345_CUX23_D01_031011_12345678.xml*

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.

2.3.1. 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,
 средневзвешенная сделка /
 поставочный фьючерс:

<Код сделки спот/ сделки фикс/
 средневзвешенной сделки / 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	Контр агент	Комисс. вознаграждение за организацию торгов, руб.	Вознаграждение за предоставление ИТС, руб.	Комисс. вознаграждение 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	Направление	Курс сделки	Объем в валюте лота, ед. валюты	Объем в сопряж. валюте, ед. валюты	Номер заявки	Сделка с ПФИ	Контр агент	Комисс. вознагражд. за организацию торгов, руб.	Вознаграждение за предоставление ИТС, руб.	Комисс. вознагражд. 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/

2.3.2. 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, средневзвешенная сделка/ 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: В – 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: T – 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					

2.4. 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.

2.4.1. 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	Направ. лен.	Базовый курс	Курс сделки	Объем в валюте лота, ед. валюты	Объем в сопряж. валюте, ед. валюты*	Номер заявки	Контрагент	Код ТКС	Краткий код Клиента

Итого покупка:

Итого продажа:

Сделки фикс/ Средневзвешенные сделки

Сделка фикс/средневзвешенная сделка: <Код сделки фикс/средневзвешенной сделки> Валюта лота: <Наименование> Сопряж. валюта: <Наименование> Котировки за: ед. валюты лота

Номер сделки	Время заключения сделки	Код режима торгов	Направ. лен.	Дата расчета фиксинга/средневзвешенной цены	Объем в валюте лота, ед. валюты	Номер заявки	Контрагент	Код ТКС	Краткий код Клиента

Итого покупка:

Итого продажа:

Уполномоченный представитель Биржи: _____/ФИО/

* - указывается объем по инструменту с более поздней датой исполнения

2.4.2. 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/ средневзвешенная сделка;	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		
	FixingDate	Дата расчета фиксинга/ средневзвешенной цены	Нет	Date		
	TradeType	Тип сделки: T – 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					

2.5. «Выписка из реестра транзакций»

А) Для Участников торгов, не имеющих идентификаторов спонсируемого доступа

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.

2.5.1. ФОРМА

Выписка из реестра транзакций

<дата>

Биржа: ПАО Московская Биржа

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

№ п/п	Уникальный код заявки	Время	Статус	Причина отказа в регистрации

Уполномоченный представитель Биржи: _____ /ФИО/

2.5.2. 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				
	EntryDate	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						
/MICEX_DOC						

В) Для Участников торгов, имеющих идентификаторы спонсируемого доступа

Пример имени файла: **MB12345_CUX34_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.

2.5.3. ФОРМА

Выписка из реестра транзакций идентификаторов спонсируемого доступа

Дата торгов: <дата>

Биржа: **ПАО Московская Биржа**

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

Идентификатор спонсируемого доступа: <Идентификатор>

N п/п	Уникальный код транзакции (поручения)	Время подачи поручения	Направлен.	Код режима торгов	Идентификатор инструмента	Объем в валюте лота, ед. валюты		Идентификатор валюты лота	Предельная цена поручения	Контрагент	Время снятия порученияТС	Код ТКС	Краткий код Клиента	Номер поручения на стороне клиента	Статус транзакции	Причина отклонения поручения/отказа в регистрации заявки	
						Всего	Скрыто										

Уполномоченный представитель Биржи: _____ /ФИО/

2.5.4. СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО ДОКУМЕНТА (XML-ФАЙЛ) «ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА ТРАНЗАКЦИЙ» CUX34

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						
CUX34		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	
	FirmINN	ИНН Участника торгов	Да	Character	12	
USER						
	UserId	Идентификатор спонсируемого доступа	Да	Character	12	
RECORDS		Блок данных по транзакции				
	RecNo	Номер по порядку	Да	Number	11	0
	TransNo	Уникальный код транзакции (поручения)	Да	Number	20	0
	EntryTime	Время подачи поручения	Да	Time		
	Status	Статус транзакции: Y – заявка по поручению зарегистрирована в торговой системе; N – заявка по поручению не зарегистрирована в торговой системе	Да	Character	1	
	BuySell	Направление поручения: B – Покупка, S – Продажа	Да	Character	1	
	BoardID	Идентификатор режима торгов	Да	Character	4	
	SecurityId	Идентификатор инструмента	Да	Character	12	
	BasePrice	Базовый курс	Нет	Number	20	
	Quantity	Всего объем в валюте лота, ед. валюты	Да	Number	20	
	QuantityHidden	Скрытый объем в валюте лота, ед. валюты	Нет	Number	20	
	Decimals	Число значимых знаков после запятой в предельной цене поручения (атрибут Price)	Да	Number	x	
	Price	Предельная цена поручения	Нет	Number	20	
	AmendTime	Время снятия поручения ТС	Нет	Time		
	CPFirmId	Контрагент	Нет	Character	12	
	ClientCode	Краткий код клиента	Нет	Character	12	
	TrdAccId	Код Торгово-клирингового счета соответствующего уровня	Да	Character	12	
	BrokerRef	Номер поручения на стороне клиента (поле ClOrdID при подаче поручения посредством протокола FIX):	Нет	Character	20	
	Details	Данные о клиенте первого уровня	Нет	Character	12	
	SubDetails	Данные о клиенте второго уровня	Нет	Character	20	
	MisType	Причина отклонения поручения/ отказа в регистрации заявки	Нет*	Character	256	
	MisTypeEN	Причина отклонения поручения/ отказа в регистрации заявки (eng)	Нет*	Character	255	
	Message	Содержимое транзакции	Да	Character	1000	
/RECORDS						
/USER						
/CUX34						
/MICEX_DOC						

* если Status = N, то поле обязательное

2.6. 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.

2.6.1. 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 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 _____

2.6.2. 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						

2.7. 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, LICU*
Крупные сделки спот на иностранную валюту	SDBP	
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
Средневзвешенные сделки	WAPS	WAPN
Сделки своп	Аукцион с Банком России AUCB	
Инструменты переводов	TRAN	
Инструменты переводов НКЦ	TRAD	

* - Безадресная сделка типа «всем» в Режиме урегулирования