Утверждены Приказом ПАО Московская Биржа От 16 июня 2022 г. №МБ-П-2022-1173

### Параметры заявок, отчетные документы и коды режимов торгов валютного рынка и рынка драгоценных металлов

#### 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. Заявки из алгоритмического пакета заявок подаются в Торговую систему с минимальной кратностью в 1 секунду. Максимальное количество заявок в алгоритмическом пакете заявок 59 999.
- 1.4. Минимальное количество лотов, указываемых в заявке типа «скрыть количество» и отображаемых в окне текущих котировок, 1 000.
- 1.5. Максимальное соотношение количества лотов, скрытых в заявке типа «скрыть количество», к количеству лотов, отображаемых в окне текущих котировок, -100:1.
- 1.6. 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 в системном режиме торгов 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.

- 1.6.1. 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.
- 1.7. Объем заявки (в лотах) из алгоритмического пакета заявок определяется в соответствии со следующим порядком:
  - 1.7.1. Используемые функции:
  - Round функция математического округления до заданного порядка округления;
  - Floor (Ceil) функции округления вниз (вверх) до заданного порядка округления;
  - Random функция выборки случайной величины из диапазона;
  - Min (Max) функции выборки минимального (максимального) значения.
    - 1.7.2. Остаток объема алгоритмического пакета заявок на і-й итерации:

$$V$$
ост $_i = V - \sum_{j=1}^{i-1} V \phi$ акт $_J$ ,

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

где Vфакт $_j$  — объем, фактически исполненный при выставлении связанной заявки на j-й итерации. На итерации  $i=1\ V$ ост $_i=V$ .

1.7.3. Планируемое количество итераций, оставшееся до завершения алгоритма (включая текущую итерацию і):

$$M_i = Min\left(N - i + 1, Floor\left(\frac{Voct_i}{Vmin}\right)\right)$$

1.7.4. Средний объем заявки из алгоритмического пакета заявок:

$$Vcp_i = Floor \left( \begin{cases} M_i = 0 : Voct_i \\ M_i \neq 0 : \frac{Voct_i}{M_i} \end{cases} \right)$$

1.7.5. Минимальный объем заявки из алгоритмического пакета заявок:

$$Vmin_{i} = \begin{cases} Vcp_{i} = 0 : 0 \\ Vcp_{i} \neq 0 : Max\left(Floor\left(Vcp_{i} \times \left(1 - \frac{K_{r}exp}{2}\right)\right), Vmin\right), \end{cases}$$

где  $K_r exp = \frac{e^{K_r-1}}{e^{-1}}$  - величина случайного отклонения заявки из алгоритмического пакета заявок.

1.7.6. Максимальный объем заявки из алгоритмического пакета заявок:

$$Vmax_i = Ceil\left(Vcp_i \times \left(1 + \frac{K_rexp}{2}\right)\right)$$

1.7.7. Случайный объем заявки из алгоритмического пакета заявок:

$$Vrand_i = Random(Vmin_i, Vmax_i)$$

Границы диапазона включаются.

При равномерном распределении ( $K_r = K_r exp = 0$ )  $Vrand_i$  всегда будет равно  $Vcp_i$ .

1.7.8. Нормализация по минимальному остатку (гарантированно оставить объем Vmin для каждой последующей итерации алгоритмического пакета – при условии, что все заявки из него будут исполнены в ТС полностью):

$$Vmin \ \text{oct}_i = Min(Vrand_i, Voct_i - Vmin \times Max(M_i - 1, 0))$$

1.7.9. Дополнение остатка (если в результате исполнения і-й итерации (при условии полного исполнения заявки в TC) в алгоритмическом пакете остается объем < Vmin, то остаток прибавляется к объему текущей итерации):

$$V$$
доп $_i = egin{cases} V ext{ост}_i - V min \ ext{ост}_i \geq V min : V min \ ext{ост}_i \ V ext{ост}_i - V min \ ext{ост}_i < V min : V ext{ост}_i \end{cases}$  Финальный расчет объема заявки из алгоритмического пакета

1.8. Финальный расчет объема заявки из алгоритмического пакета заявок запланированный к вводу на і-й итерации:

$$V$$
план $_i = \left\{ egin{aligned} V$ доп $_i \geq Vmin: V$ доп $_i < Vmin: 0 \end{aligned} 
ight.$ 

- 1.9. Участник торгов при вводе параметров алгоритмического пакета вправе указать коэффициент случайного отклонения заявок из алгоритмического пакета заявок по времени их ввода и объему  $K_r = 0, ..., 1$  с шагом 0,1, где
  - 0 нет отклонений (равномерное распределение заявок по времени ввода и объему);
  - 1 максимальное отклонение ( $\pm 50\%$ от величины рассчитанного среднего временного интервала и от величины рассчитанного среднего объема V ср $_i$ ).

Величина случайного отклонения заявок рассчитывается следующим образом:

$$K_r exp = \frac{e^{K_r}-1}{e^{-1}},$$

где  $K_r exp$  — случайное отклонение заявок,

 $K_r$  – коэффициент случайного отклонения заявок, задаваемый Участником торгов  $(0,\,...,\,1)$ ,

 $e^{x}$  – экспонента заданного числа.

- 1.10. Контроль объема алгоритмического пакета и объемов заявок (как рыночных, так и лимитированных), содержащихся в данном алгоритмическом пакете:
  - максимальный объем алгоритмического пакета, вводимого без дополнительного подтверждения, 1 000 000 лотов. При превышении данного объема алгоритмический пакет вводится в Торговую систему только при дополнительном подтверждении Участником торгов сообщения, выдаваемого Торговой системой;
  - если при вводе алгоритмического пакета рассчитанный объем хотя бы одной заявки, содержащейся в данном алгоритмическом пакете, превышает 1 000 лотов, Участнику торгов выдается информационное сообщение (не требующее дополнительного подтверждения) о наличии в алгоритмическом пакете заявки с таким объемом. Указанная в настоящем абзаце проверка не проводится, если в соответствии с внутренними документами Биржи для инструмента установлен минимальный размер заявки (в лотах), превышающий установленное пороговое значение объема одной заявки, содержащейся в данном алгоритмическом пакете (1 000 лотов);
  - если при вводе алгоритмического пакета рассчитанный объем хотя бы одной заявки, содержащейся в данном алгоритмическом пакете, превышает 10 000 лотов, такой алгоритмический пакет заявок полностью отклоняется Торговой системой с выдачей Участнику торгов информационного сообщения об отклонении всего алгоритмического пакета и и необходимости проведения коррекции его параметров. Если в дальнейшем при исполнении алгоритмического пакета и пересчете его остатка объем заявки в какойлибо из итераций превысит 10 000 лотов, то такая заявка исполняется без предварительного уведомления Участника торгов. Указанная в настоящем абзаце проверка не проводится, если в соответствии с внутренними документами Биржи для инструмента установлен минимальный размер заявки (в лотах), превышающий максимально допустимый одной заявки, содержащейся ланном алгоритмическом пакете (10 000 лотов).
- 1.11. В период с 7:00 до 23:50 в течение торгового периода основной торговой сессии для режимов торгов с кодами CETS и SDBP для рыночных заявок «снять остаток» и «полностью или отклонить» устанавливается следующее максимальное отклонение цен допустимых встречных заявок от лучшей цены допустимой встречной заявки по инструментам:

Инструмент	Максимальное отклонение
USDRUB_TOD, USDRUB_TDB, USDRUB_TOM, USDRUB_TMB, USDRUB_TMS, USDRUB_SPT	
EURRUB_TOD, EURRUB_TDB, EURRUB_TOM, EURRUB_TMB, EURRUB_TMS, EURRUB_SPT	
EURUSD_TOD, EURUSD_TOM, EURUSD_SPT	
GBPUSD_TOD, GBPUSD_TOM, GBPUSD_SPT	
USDCNY_TOD, USDCNY_TOM, USDCNY_SPT	
CNYRUB_TOD, CNYRUB_TOM, CNYRUB_SPT	
USDCHF_TOD, USDCHF_TOM, USDCHF_SPT	1,00%
BYNRUB_TOD, BYNRUB_TOM, GBPRUB_TOD, GBPRUB_TOM	
HKDRUB_TOD, HKDRUB_TOM	
USDKZT_TOD, USDKZT_TOM, USDKZT_SPT	
USDTRY_TOD, USDTRY_TOM, USDTRY_SPT	
USDJPY_TOD, USDJPY_TOM, USDJPY_SPT	
KZTRUB_TOD, KZTRUB_TOM, KZTRUB_SPT	
TRYRUB_TOD, TRYRUB_TOM, CHFRUB_TOD, CHFRUB_TOM	

JPYRUB_TOD, JPYRUB_TOM	
ZARRUB_TOD, ZARRUB_TOM, ZARRUB_TMS	
USDZAR_TOD, USDZAR_TOM	
AEDRUB_TOD, AEDRUB_TOM, AEDRUB_TMS	ļ
USDAED_TOD, USDAED_TOM	
UZSRUB_TOD, UZSRUB_TOM	
AMDRUB_TOD, AMDRUB_TOM, AMDRUB_TMS	
USDAMD_TOD, USDAMD_TOM	

1.12. В период с 7:00 до 23:50 в течение торгового периода основной торговой сессии для режимов торгов с кодами CETS и SDBP для рыночных заявок «снять остаток» и «полностью или отклонить» устанавливается следующий максимально допустимый спред относительно лучшей заявки на покупку, при котором рыночные заявки принимаются Торговой системой:

Инструмент	Максимально допустимый спред
USDRUB_TOD, USDRUB_TDB, USDRUB_TOM, USDRUB_TMB, USDRUB_TMS, USDRUB_SPT	
EURRUB_TOD, EURRUB_TDB, EURRUB_TOM, EURRUB_TMB,	
EURRUB_TMS, EURRUB_SPT	
EURUSD_TOD, EURUSD_TOM, EURUSD_SPT	
GBPUSD_TOD, GBPUSD_TOM, GBPUSD_SPT	
USDCNY_TOD, USDCNY_TOM, USDCNY_SPT	
CNYRUB_TOD, CNYRUB_TOM, CNYRUB_SPT	
USDCHF_TOD, USDCHF_TOM, USDCHF_SPT	
BYNRUB_TOD, BYNRUB_TOM, GBPRUB_TOD, GBPRUB_TOM	
HKDRUB_TOD, HKDRUB_TOM	
USDKZT_TOD, USDKZT_TOM, USDKZT_SPT	
USDTRY_TOD, USDTRY_TOM, USDTRY_SPT	0,50%
USDJPY_TOD, USDJPY_TOM, USDJPY_SPT	
KZTRUB_TOD, KZTRUB_TOM, KZTRUB_SPT	
TRYRUB_TOD, TRYRUB_TOM, CHFRUB_TOD, CHFRUB_TOM	
JPYRUB_TOD, JPYRUB_TOM	
ZARRUB_TOD, ZARRUB_TOM, ZARRUB_TMS	
USDZAR_TOD, USDZAR_TOM	
AEDRUB_TOD, AEDRUB_TOM, AEDRUB_TMS	
USDAED_TOD, USDAED_TOM	
UZSRUB_TOD, UZSRUB_TOM	
AMDRUB_TOD, AMDRUB_TOM, AMDRUB_TMS	
USDAMD_TOD, USDAMD_TOM	

#### 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\_TTTTTT\_SSS\_DDMMYY\_NNNNNNNNNN.xml.p7s.zip.p7e* со следующими параметрами:

*ММNNNN* – код Участника торгов в системе электронного документооборота (системе ЭДО) – первые 7 символов регистрационного кода Участника торгов.

ТТТТТ – 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;

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: *МВ12345\_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. Φ*OPMA*

#### 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>

поставоч	пыи фьючере.															
Дата испо	Дата исполнения:			ата>					Сопряж. валюта:			Котировки за: ед. валюты лота				a
Номер заявки	Торговый идентификатор/ Идентификатор спонсируемого доступа	Торговый идентификатор Участника торгов, используемый для формирования ПЭП	Время регистрации заявки	Напра влен.	Номер алгоритми ческого пакета заявок	Код режима торгов	Тип		в валюте валюты Скрыто		Статус	Время снятия	Остаток заявки		Код ТКС	Краткий код Клиента

Заявки на заключение сделок своп/своп контрактов Сделка своп/ <Код сделки своп / Валюта лота: <Наименование> своп контракт: своп контракта> Сопряж. валюта: <Наименование> Котировки за: ед. валюты лота Торговый Торговый Номер Объем в идентификатор/ идентификатор Время алгоритми Код Краткий Напра Номер Кол Базовый валюте Предельная Время Остаток Контр Участника торгов, Идентификатор регистрации ческого режима Тип Статус код заявки лота, ед. цена заявки снятия заявки агент TKC влен. курс используемый для спонсируемого заявки пакета торгов Клиента валюты формирования ПЭП доступа заявок

Уполномоченный представитель Биржи:	/ФИО/

## 2.2.2. СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО ДОКУМЕНТА (XML- $\Phi$ АЙЛ) «ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА ЗАЯВОК» СUX22

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязате льность	Тип	Размер	Десят ичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				911,611
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
DOC_REQUISITES	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла		Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в	Нет	Character	1-12	
		системе электронного документооборота				
	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)		Character	0-120	
CLEARPART	THIIIVameExv	Блок данных по Участнику клиринга	TICI	Character	0-120	
CLEARFARI	ClearingFirmId	Идентификатор Участнику клиринга	По	Character	0-12	
				Character		
	ClearingFirmName	Наименование Участника клиринга	Да	Character	0-120	
CERTIFIE E	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				
BEBBION	AddSession	Тип сессии: N – Основная сессия	По	Character	1	
	SessionName	Наименование сессии	<u>Д</u> а Да	Character	1	
CLIDDDAID	SessionNameEN	Наименование сессии (eng)	Да	Character		
CURRPAIR	C II	Блок данных валютной пары		CI .	1	
	CurrencyId	Идентификатор валюты лота		Character	4	1
	CurrencyName	Наименование валюты лота	Да	Character	30	
	CurrencyNameEN	Наименование валюты лота (eng)	Да	Character	30	1
	CoCurrencyId	Идентификатор сопряженной валюты	Да	Character	4	
	CoCurrencyName	Наименование сопряженной валюты		Character	30	
	CoCurrencyNameEN	Наименование сопряженной валюты (eng)	Да	Character	30	
SECURITY		Блок данных по инструменту				
	SecurityId	Идентификатор инструмента		Character	12	
	SecShortName	Краткое наименование инструмента	Да	Character	10	1
	FaceValue	Котировка	Да	Number	20	6
SETTLEDATE		Блок данных по дате исполнения				
	SettleDate	Дата исполнения	Да	Date		
	FixingDate	Дата расчета фиксинга/ средневзвешенной		Date		
		цены				
GROUP		Блок данных по виду заявки				
	TradeGroup	Вид заявки: Т – заявка на заключение сделки	Да	Character	1	
		спот, в т.ч. сделки фикс, средневзвешенной				
		сделки /поставочного фьючерса; S – заявка на				
		заключение сделки своп/ своп контракта;				
RECORDS		Блок данных по заявке				
	OrderNo	Номер заявки	Да	Number	20	0
	AlgoOrderNo	Номер алгоритмического пакета заявок		Number	20	0

	IsActualMM	Заявка соответствует условиям маркет- мейкерского договора (Y – Да)	Нет	string	1-1	
	UserId	Торговый идентификатор Участника торгов/ Идентификатор спонсируемого доступа	Да	Character	0-12	
	ASP	Торговый идентификатор Участника торгов, используемый для формирования простой электронной подписи (ПЭП)	Да	Character	0-12	
	EntryTime	Время регистрации заявки	Да	Time		
	BuySell	Направление заявки: В – 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	2
	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: *МВ12345\_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. Φ*OPMA* 

#### 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,

 Наименование>

 средневзвешенная сделка / поставочный фьючерс:
 фьючерса>
 Валюта лота:
 Наименование>

Дата исполнения: <Дата> Сопряж. валюта: <Наименование> Котировки за: ед. валюты лота Номер Объем в Объем в алгорит Вознагражде Комисс. вознагр. Комисс, вознаго. Комиссия Краткий Время Код Напра за клиринг. Номер Курс валюте сопряж. Номер МИ Сделка с Контр ние за Код за организацию заключен режима всего по код ПФИ сделки влен. сделки лота, ед. валюте, ед. заявки ческого агент предоставлен обслуживание, TKC торгов, руб. Клиента ия сделки торгов сделке, руб. ие ИТС, руб. валюты валюты пакета руб. заявок

Итого покупка: Итого продажа: Итого по комиссии:

Сделки, входящие в сделку своп/своп контракт

Сделка	своп/ своп і	контракт:	•		<Код с	делки своп /	своп к	онтракта	>	га лота: іж. валк		аименование> аименование> Ко	отировки за:	ед. валн	оты лота	
Номер	Время заключен ия сделки	Код режима торгов	Напра влен.	Курс сделки	Объем в валюте лота, ед. валюты	Объем в сопряж. валюте, ед. валюты	Номер заявки		Сделка с ПФИ	•	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:

### 2.3.2. СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО ДОКУМЕНТА (XML-ФАЙЛ) «ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА СДЕЛОК» CUX23

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обяза тельн ость	Тип	Размер	Десяти чные 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		Character		
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES		•				
CUX23		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата торгов	Да	Date		
	FirmId	Идентификатор Участника торгов		Character	0-12	
	FirmName	Наименование Участника торгов		Character		
	FirmNameEN	Наименование Участника торгов (eng)	Нет	Character		
CLEARPART	,	Блок данных по Участнику клиринга				
	ClearingFirmId	Идентификатор Участника клиринга	Да	Character	0-12	
	ClearingFirmName	Наименование Участника клиринга		Character		
		Наименование Участника клиринга (eng)	Нет	Character		
SETTLE		Блок информации по расчетному коду Участника клиринга				
	ExtSettleCode	Расчетный код Участника клиринга	Да	Character	20	
TRADEACC	Existinceouc	Блок информации по расчетному коду Участника торгов / клиента Участника торгов	Да	Character	20	
	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	Да	Character	1	
		неисполненных обязательств)				
	SessionName	Наименование сессии	Да	Character		
CLIPPPAT	SessionNameEN	Наименование сессии (eng)	Да	Character		
CURRPAIR	C 7.1	Блок данных валютной пары		CI	4	
	CurrencyId	Идентификатор валюты лота	Да	Character		
	CurrencyName	Наименование валюты лота	Да	Character		
	CurrencyNameEN	Наименование валюты лота (eng)	Да	Character		
	CoCurrencyId	Идентификатор сопряженной валюты	Да	Character		
	CoCurrencyName	Наименование сопряженной валюты	Да	Character		
SECURITY		Наименование сопряженной валюты (eng) Блок данных инструменту	Да	Character		
	SecurityId	Идентификатор инструмента	Да	Character		
	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: Т - сделка спот, в т.ч. сделка фикс, средневзвешенная сделка/ поставочный	Да	Character	1	
MAINSEC		фьючерс; S - сделка своп/ своп контракт; Блок данных по типам титульных "лицевых"				
		сделок				
	MainSecurityId	Идентификатор инструмента титульной сделки своп/ своп контракта	Да	Character	12	

	MainSecShortName	Краткое наименование инструмента	Да	Character	10	
		титульной сделки своп/ своп контракта				
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
	AlgoOrderNo	Номер алгоритмического пакета заявок	Нет	Number	20	0
	IsActualMM	Заявка соответствует условиям маркет-	Нет	string	1-1	
		мейкерского договора (У – Да)				
	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	Да	Character	1	
	Decimals	контракт; 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	<u>да</u> Да	Number	20	2
	Value	Объем в сопряженной валють, ед. валюты		Number	20	2
			Да	Character		
	CPFirmId	Контрагент	Нет			
	Period	Период торгов: О – период открытия; N – нормальный период; С – период закрытия;	Да	Character		
	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	Нет	Number	20	2
	CC	клиринговое обслуживание, руб.	TT	NII	20	2
	SumComm	Итоговая комиссия	Нет	Number	20	2
	TrdAccId	Код Торгово-клирингового счета соответствующего уровня	Да	Character		
	ClientCode	Краткий код клиента	Нет	Character	12	
	Details	ИНН или № паспорта клиента	Нет	Character		
	SubDetails	ИНН или № паспорта клиента субброкера	Нет	Character	20	
	RepoTradeNo	Номер титульной сделки своп/своп контракта	Нет		20	0
	BoardId	Идентификатор правил торгов	Да	Character	4	
	BoardName	Наименование правил торгов	Да	Character		
	BoardNameEN	Наименование правил торгов (eng)	Да	Character		
/RECORDS		(4.8)				
/MAINSEC						
/GROUP						
/SETTLEDATE						
/SECURITY						
/CURRPAIR						
/SESSION						
/TRADEACC						
/SETTLE /CLEARPART						
/CUX23						
/MICEX_DOC						

#### 2.4. Выписка из реестра сделок с начислением Дополнительной комиссии

Файл в виде ЭД формируется и направляется Участнику торгов с рассчитанным Дополнительным комиссионным вознаграждением за организацию торгов до 10:00 следующего рабочего дня посредством системы ЭДО.

#### 2.4.1. Φ*OPMA*

#### Выписка из реестра сделок с начислением Дополнительной комиссии

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 с	пот:		<К	од сделки	і спот>		Валюта лота: <Наименование>									
Дата исп	олнения:			<)	<b>Дата&gt;</b>			Сопряж. валюта: <Наименование> Котировки за: ед. валюты лота						оты лота		
Номер	Время заключен ия сделки	режима	Напра влен.	Курс сделки	лота, ед.	Объем в сопряж. валюте, ед. валюты	1	Номер алгоритми ческого пакета заявок	Сделка с ПФИ		Комисс. вознагр. за организацию торгов, руб.	Дополнительное комиссионное вознаграждение за организацию торгов (справочно), руб		Комиссия всего по сделке с Дополнительным комиссионным вознаграждением за организацию торгов (справочно), руб.	Код ТКС	Краткий код Клиента

Итого покупка: Итого по комиссии:

Уполномоченный представитель Биржи: /ФИО/

### 2.4.2. СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО ДОКУМЕНТА (XML-ФАЙЛ) «ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА СДЕЛОК С НАЧИСЛЕНИЕМ ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ КОМИССИИ» CUX23B

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обяза тельн ость	Тип	Размер	Десяти чные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа	оств			JIIAKII
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла		Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в		Character	1-12	
		системе электронного документооборота				
	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		Character		
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя		Character		
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character		
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES	DIGINITE IIIGI	1110 4210	1101	Character		
CUX23B		Блок данных отчета				
COAZSD	ReportDate	Дата торгов	Па	Date		
	FirmId	дата торгов Идентификатор Участника торгов	<u>Д</u> а Да	Character	0-12	
	FirmName	идентификатор участника торгов Наименование Участника торгов		Character		
CLEADDADT	FirmNameEN	Наименование Участника торгов (eng)	Нет	Character	0-120	
CLEARPART	CI ' E' II	Блок данных по Участнику клиринга		CI.	0.10	
	ClearingFirmId	Идентификатор Участника клиринга	Да	Character		
		Наименование Участника клиринга		Character		
	N	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				
DEBBIOIT	AddSession	Тип сессии: N – Основная сессия; Y –	Да	Character	1	
		Основная сессия (урегулирование неисполненных обязательств)	Да	Character		
	SessionName	Наименование сессии	Да	Character		
	SessionNameEN	Наименование сессии (eng)	Да	Character		
CURRPAIR	Sessionivament	Блок данных валютной пары	Да	Character		
CURRIAIR	CurrencyId	Идентификатор валюты лота	Да	Character	4	
		1 1				
	CurrencyName	Наименование валюты лота	Да	Character		
	CurrencyNameEN	Наименование валюты лота (eng)	Да	Character		
	CoCurrencyId	Идентификатор сопряженной валюты	Да	Character		
	CoCurrencyName	Наименование сопряженной валюты	Да	Character		
SECURITY	•	Наименование сопряженной валюты (eng) Блок данных инструменту	Да	Character		
	SecurityId	Идентификатор инструмента	Да	Character		
	SecShortName	Краткое наименование инструмента	Да	Character		
	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: Т - сделка спот, в т.ч. сделка фикс, средневзвешенная сделка/ поставочный	Да	Character	1	
MAINSEC		фьючерс; S - сделка своп/ своп контракт; Блок данных по типам титульных "лицевых"				
	MainComitaTi	сделок	п	Charry	12	
	MainSecurityId	Идентификатор инструмента титульной сделки своп/ своп контракта	Да	Character	12	

	MainSecShortName	Краткое наименование инструмента	Да	Character	10	
	Trains Contract value	титульной сделки своп/ своп контракта	Α			
RECORDS		Блок данных по сделке				
	TradeNo	Номер сделки	Да	Number	20	0
	BuySell	Направление сделки: В – Покупка; S –	Да	Character	1	
	0.1.17	Продажа;		27 1	20	0
	OrderNo	Номер заявки	Да	Number	20	0
	AlgoOrderNo	Номер алгоритмического пакета заявок	Нет	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	<u>да</u> Нет	Character		-
	Period	Период торгов: О – период открытия; N –	Да	Character	1	
	1 01100	нормальный период; С – период закрытия;	да	Character	1	
	SettleCode	нормальный период; С – период закрытия; Код расчетов	По	Character	12	
	UserId	код расчетов Торговый идентификатор Участника торгов/	<u>Д</u> а Да	Character		
		Идентификатор спонсируемого доступа				
	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
	AddExchComm	Дополнительное комиссионное вознаграждение за организацию торгов (справочно), руб.	Нет	Number	20	2
	ClrComm	Комиссионное вознаграждение за клиринговое обслуживание, руб.	Нет	Number	20	2
	SumComm	Итоговая комиссия с Дополнительным комиссионным вознаграждением за организацию торгов (справочно), руб.	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		
	SubDetails	ИНН или № паспорта клиента субброкера	Нет	Character		
	RepoTradeNo	Номер титульной сделки своп/своп контракта	Нет		20	0
	BoardId	Идентификатор правил торгов	Да	Character		
	BoardName	Наименование правил торгов	Да	Character		
	BoardNameEN	Наименование правил торгов (eng)	Да	Character		
/RECORDS						
/MAINSEC						
/GROUP						
/SETTLEDATE						
/SECURITY						
/CURRPAIR						
/SESSION						
/TRADEACC						
/SETTLE						
/CLEARPART						
/CUX23B						
/MICEX_DOC						

### 2.5. Отчет по Дополнительному комиссионному вознаграждению за организацию торгов по сделкам покупки спот инструментов за месяц

Файл в виде ЭД формируется и направляется Участнику торгов с начисленным Дополнительным комиссионным вознаграждением за организацию торгов не позднее пяти рабочих дней месяца, следующего за отчетным, посредством системы ЭДО.

#### 2.5.1. Φ*OPMA*

### Отчет по Дополнительному комиссионному вознаграждению за организацию торгов по сделкам покупки спот инструментов за месяц Период заключения сделок: <Дата1> - <Дата2>

Биржа: ПАО Московская Биржа

Уполномоченный представитель Биржи:

Участник торгов: «Идентификатор», «Наименование Участника торгов»

Участник клиринга: «Клиринговый идентификатор», «Наименование участника клиринга»

		- 11111111 1001111	311111 W. I	<u> </u>			,											
Дата торгов	1	Время заключе ния сделки	режима	Код инструмента	Нап равл ен.	ЮТЫ	Код сопряж енной валюты	Номер заявки	Номер алго. пакета заявок	Курс сделки	Объем в валюте лота, ед. валюты	Объем в сопряж. валюте, ед. валюты	Оставшийся объем сделки для погашения по контракту, ед. валюты лота	` ,	Доп. комиссия (окончательн ое значение), руб.	Реквизит ы контракта	Погашенный объем сделки по контракту, ед. валюты лота	Изменени е Доп. комиссии , руб.

/ФИО/

Итого по комиссии:

Итого покупка:

# 2.5.2. СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО ДОКУМЕНТА (ХМL-ФАЙЛ) «ОТЧЕТ ПО ДОПОЛНИТЕЛЬНОМУ КОМИССИОННОМУ ВОЗНАГРАЖДЕНИЮ ЗА ОРГАНИЗАЦИЮ ТОРГОВ ПО СДЕЛКАМ ПОКУПКИ СПОТ ИНСТРУМЕНТОВ ЗА МЕСЯЦ» CUX25

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обяза тельн	Тип	Разме р	Десяти чные
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа	ость			знаки
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
DOC_REQUISITES	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_DATE DOC_TIME	Время формирования файла		Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в		Character	1-12	
	DOC_NO	системе электронного документооборота	пег	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документо в системе	Нет	Character	1-12	
		электронного документооборота				
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя		Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	1	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя		Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу		Character	1-120	
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES						
CUX25		Блок данных отчета				
	ReportDate1	Дата начала периода	Да	Date		
	ReportDate2	Дата окончания периода	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)		Character	0-120	
RECORDS	S	Блок данных по сделке				
1200125	TradeDate	Дата торгов	Да	Date		
	TradeNo	Номер сделки	Да	Number	20	0
	TradeTime	Время заключения сделки		Time	20	O
	BoardId	Идентификатор правил торгов	Да	Character	4	
	SecurityId	Идентификатор правил торгов	Да	Character	12	
	SecShortName			Character	10	
		Краткое наименование инструмента	Да		10	
	BuySell	Направление сделки: В – Покупка; S – Продажа;	Да	Character	1	
	CurrencyId	Идентификатор валюты лота	Да	Character	4	
	CoCurrencyId	Идентификатор сопряженной валюты	Да	Character	4	
	FaceValue	Котировка	Да	Number		6
	OrderNo	Номер заявки	Да	Number	20	0
	AlgoOrderNo	Номер алгоритмического пакета заявок	Нет	Number	20	0
	Price	Курс сделки	Да	Number	20	6
	Quantity	Объем в валюте лота, ед. валюты		Number	20	2
	Value	Объем в сопряженной валюте, ед. валюты		Number		2
	QuantityFinal	Оставшийся объем сделки для погашения по контракту, ед. валюты лота	Да	Number		2
	AddExchCommStart	Дополнительная комиссия (начальное значение), руб.	Да	Number	20	2
	AddExchCommFinal	Дополнительная комиссия (окончательное	Да	Number	20	2
CONTRA CT PEO		значение), руб.				
CONTRACT_REQ		Блок данных по контракту	-	CI	0.120	
	ContractRequisites	Реквизиты контракта	Да	Character	0-120	2
	QuantityUtilize	Погашенный объем сделки по контракту, ед. валюты лота	Да	Number		2
	AddExchCommChange	Изменение дополнительной комиссии, руб.	Да	Number	20	2
/CONTRACT_REQ						
/RECORDS						
/CLEARPART						
/CUX25						
/MICEX_DOC						

#### 2.6. 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.

#### 2.6.1. ΦΟΡΜΑ

#### 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

< Код сделки своп / Валюта лота: <Наименование> Сопряж. валюта: <Наименование> Котировки за: своп контракта> ед. валюты лота Объем в Номер Код Объем в Время Краткий Номер режима Направ Базовый Курс валюте сопряж. Номер алгоритмиче Контр Код заключения код торгов валюте, ед. ского пакета сделки лен. курс сделки лота, ед. заявки агент ТКС Клиента сделки валюты валюты\* заявок

Сде.	лки фикс/	$C_{I}$	редневзв	ешенн	ые сделки							
Сделка ф	рикс/	<К	од сделки	фикс/	Валюта лота	: <Наиме	нование>					
средневз	дневзвешенная средневзвешенной Сопряж. валюта: <Наименование>											
сделка		сде	елки>			<11anmci	Кот	тировки за:	ед. ва	люты лот	a	
Номер сделки	Время заключени сделки	Я	•	влен.	фиксинга/	Курс фиксинга/ средневзвеш енная цена	Дисконт (-) /Премия (+) к средневзвешен ной цене	Объем в валюте лота, ед. валюты	Номер заявки		Код ТКС	Краткий код Клиента
			·									

Итого покупка: Итого продажа:

Уполномоченный представитель Биржи	:/0	ФИО/
•		

18

<sup>\* -</sup> указывается объем по инструменту с более поздней датой исполнения

# 2.6.2. СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО ДОКУМЕНТА (XML-ФАЙЛ) «ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА СДЕЛОК (СДЕЛКИ АНАЛИТИЧЕСКОГО УЧЕТА)» CUX33

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обяза тельн ость	Тип	Размер	Десяти чные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML локумента				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла		Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в		Character	1-12	
		системе электронного документооборота				
	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		Character		
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character		
/DOC_REQUISITES		,				
CUX33		Блок данных отчета				
	ReportDate	Дата торгов	Да	Date		
	FirmId	Идентификатор Участника торгов		Character	0-12	
	FirmName	Наименование Участника торгов		Character		
	FirmNameEN	Наименование Участника торгов (eng)		Character		
CLEARPART	Time (and 2)	Блок данных по Участнику клиринга	1101	Character	0 120	
CEETHUTHUT	ClearingFirmId	Идентификатор Участника клиринга	Да	Character	0-12	
	ClearingFirmName	Наименование Участника клиринга		Character		
	ClearingFirmNameEN	Наименование Участника клиринга (eng)	Нет	Character		
SETTLE	Cicaring ininvanichi	Блок информации по расчетному коду	1101	Character	0-120	
SETTLE		Участника клиринга				
	ExtSettleCode	Расчетный код Участника клиринга	Да	Character	20	
TRADEACC	Exiscillecode	Блок информации по расчетному коду	да	Character	20	
TRADEACC		Участника торгов / клиента Участника торгов				
	ExtTradeCode	Расчетный код Участника торгов /	Да	Character	20	
		Расчетный код клиента Участника торгов				
	ExtTradeCodeType	Тип расчетного кода Участника торгов:	Да	Character	10	
		Trade – расчетный код Участника торгов,				
		Client - расчетный код клиента Участника				
		торгов				
SESSION		Блок данных по типу сессии	_		-	
	AddSession	Тип сессии: N - Основная сессия; Y -	Да	Character	1	
		Основная сессия (урегулирование				
	G	неисполненных обязательств)		CI.		
	SessionName	Наименование сессии	Да	Character		
CDOLID	SessionNameEN	Наименование сессии (eng)	Да	Character		
GROUP	T. 1.C	Блок данных по виду сделки		CI	1	
	TradeGroup	Вид сделки: S - сделка своп/ своп контракт;	Да	Character	1	
CLIDDDAID		F- сделка фикс/ средневзвешенная сделка;				
CURRPAIR	C	Блок данных валютной пары	TT.	Clara	4	
	CurrencyId	Идентификатор валюты лота	Да	Character		
	CurrencyName	Наименование валюты лота	Да	Character		
	CurrencyNameEN	Наименование валюты лота	Да	Character		
	CoCurrencyId	Идентификатор сопряженной валюты	Да	Character		
	CoCurrencyName	Наименование сопряженной валюты	Да	Character		
	CoCurrencyNameEN	Наименование сопряженной валюты	Да	Character		(
CECLIDITAL	FaceValue	Котировка	Да	Number	20	6
SECURITY	C	Блок данных инструменту	п	Classic	12	
	SecurityId	Идентификатор инструмента	Да	Character		
DECORDO	SecShortName	Краткое наименование инструмента	Да	Character	10	
RECORDS	To- d-N-	Блок данных по сделке	п	N. 1	20	0
	TradeNo	Номер сделки	Да	Number		0
	BuySell	Направление сделки: В – Покупка; S – Продажа	Да	Character	1	

	OrderNo	Номер заявки	Да	Number	20	0
	AlgoOrderNo	Номер алгоритмического пакета заявок	Нет	Number	20	0
	TradeTime	Время заключения сделки	Да	Time		
	FixingDate	Дата расчета фиксинга/ средневзвешенной	Нет	Date		
		цены				
	FixingRate	Курс фиксинга/ Средневзвешенная цена	Нет	Number	20	6
	TradeType	Тип сделки: T – безадресная; N – адресная; S	Да	Character	1	
		<ul> <li>безадресная, входящая в своп/своп</li> </ul>				
		контракт; W – адресная, входящая в				
		своп/своп контракт;				
	BasePrice	Базовый курс	Нет	Number	20	6
	Decimals	Число значимых знаков после запятой в	Да	Number		
		курсе сделки (атрибут Price)				
	Price	Курс сделки, Дисконт (-) /Премия (+) к	Нет	Number	20	6
	0	средневзвешенной цене		3.7 I	20	
	Quantity	Объем в валюте лота, ед. валюты	Да	Number	20	2
	Value	Объем в сопряженной валюте, ед. валюты	Нет	Number	20	2
	CPFirmId	Контрагент	Нет	Character	1	
	TrdAccId	Код Торгово-клирингового счета	Да	Character	0-12	
		соответствующего уровня				
	ClientCode	Краткий код клиента		Character		
	Details	ИНН или № паспорта клиента		Character		
	SubDetails	ИНН или № паспорта клиента субброкера	Нет		20	
	RepoTradeNo	Номер титульной сделки своп/ своп	Нет	Number	20	0
		контракта				
	BoardId	Идентификатор правил торгов	Да	Character		
	BoardName	Наименование правил торгов	Да	Character		
	BoardNameEN	Наименование правил торгов (eng)	Да	Character	30	
/RECORDS						
/SECURITY						
/CURRPAIR						
/GROUP						
/SESSION						
/TRADEACC						
/SETTLE						
/CLEARPART						
/CUX33						
/MICEX_DOC						

#### 2.7. «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.

#### 2.7.1. ФОРМА

#### Выписка из реестра транзакций

<дата>

Биржа: ПАО Московская Биржа

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

N π/π	Номер алгоритмического пакета заявок	Время	Статус	Причина отказа в регистрации

Уполномоченный представитель Биржи: /ФИО/

## 2.7.2. СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО ДОКУМЕНТА (XML-ФАЙЛ) «ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА ТРАНЗАКЦИЙ» СUX24

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязате льность	Тип	Размер	Десят ичны е 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		
	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
	AlgoOrderNo	Номер алгоритмического пакета заявок	Нет	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.

#### 2.7.3. Φ*OPMA*

#### 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	Уникальный	Время		Номер		Идентиф	Объем в	в валюте	Идентификатор			Время					Причина
п/п	код транзакции (поручения)	подачи поручения	Нап равл ен.	поручения на подачу алгоритмиче ского пакета заявок	Код режима торгов	икатор инструме нта	всего	валюты Скрыто	валюты лота	Предельная цена поручения	Контр агент	снятия поручения ТС	Код ТКС	Краткий код Клиента	Номер поручения на стороне клиента	Статус транзак ции	отклонения поручения/ отказа в регистрации заявки

	Уполномоченный представитель Биржи	:/	ФИО
--	------------------------------------	----	-----

# 2.7.4. СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО ДОКУМЕНТА (ХМL- $\Phi$ АЙЛ) «ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА ТРАНЗАКЦИЙ» СUX34

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязате льность	Тип	Размер	Десятичн ые знаки
MICEX_DOC	ш-рш-, ги	Корневой элемент (root element) XML документа				
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
200_1120	DOC_DATE	Дата формирования файла	Нет	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Нет	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в	Нет	Character	1-12	
		системе электронного документооборота				
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
		Краткое наименование отправителя	Нет		1-12	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет		1-120	
	SIGNAUTHOR	ФИО автора ЭЦП	Нет	Character	1-120	
/DOC DECLUCITES	SIGNAUTHUR	ФИО автора ЭЦП	пет	Character		
/DOC_REQUISITES		Γ				
CUX34	E ( , , D )	Блок данных отчета	п	D 4		
	EntrytDate	Дата торгов	Да	Date	0.12	
	FirmId	Идентификатор Участника торгов	Да		0-12	
	FirmName	Наименование Участника торгов	Да		0-120	
	FirmNameEN	Наименование Участника торгов (eng)	Нет		0-120	
Harb	FirmINN	ИНН Участника торгов	Да	Character	12	
USER				a.	1.0	
negone a	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
	AlgoOrderNo	Номер поручения на подачу	Нет	Number	20	0
		алгоритмического пакета заявок				
	EntryTime	Время подачи поручения	Да	Time		
	Status	Статус транзакции: Ү – заявка по поручению	Да	Character	1	
		зарегистрирована в торговой системе; N –				
		заявка по поручению не зарегистрирована в				
		торговой системе				
	BuySell	Направление поручения: В – Покупка, S – Продажа	Да	Character	1	
	BoardID	Идентификатор режима торгов	Да	Character	4	
	SecurityId	Идентификатор инструмента	Да		12	
	BasePrice	Базовый курс	Нет	Number	20	
	Quantity	Всего объем в валюте лота, ед. валюты	Да	Number	20	2
	QuantityHidden	Скрытый объем в валюте лота, ед. валюты	Нет	Number	20	
	Decimals	Число значимых знаков после запятой в	Да	Number	X	
		предельной цене поручения (атрибут Price)	~			
	Price	Предельная цена поручения	Нет	Number	20	
	AmendTime	Время снятия поручения ТС	Нет	Time		
	CPFirmId	Контрагент	Нет		12	
	ClientCode	Краткий код клиента	Нет		12	
	TrdAccId	Код Торгово-клирингового счета	Да		12	
		соответствующего уровня	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>
	BrokerRef	Номер поручения на стороне клиента (поле	Нет	Character	20	
		ClOrdID при подаче поручения посредством				
		протокола FIX):	<u> </u>		<u> </u>	<u> </u>
	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	регистрации заявки (eng) Содержимое транзакции	Да	Character	1000	
/RECORDS	1v1Cssage	одоржимое транзакции	да	CHALACIEL	1000	
/USER						
/CUX34						
/MICEX_DOC						
* corr Status = N						

<sup>\*</sup> если Status = N, то поле обязательное

#### 2.8. 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.

2.8.1. ΦΟΡΜΑ

#### Отчет по обязательствам Участника торгов по

Дополнительному Комиссионному Сбору (ДКС)

Дата торгов: <дата>

Биржа: ПАО Московская Биржа

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

•	1		1		170	e e	~			T.0
					Количество заявок с	Сумма комиссионного	Сумма			Код
Реквизиты гиперактивного торгового автомата (ГТА)	торгов	Краткий код клиента	ИНН или № паспорта клиента	ИНН или № паспорта клиента субброкера	учетом маркет- мейкерских (округляется при расчете по коэффициентам L1, L2)	вознаграждения для расчета ДКС (информационно), руб.*	комиссионного вознаграждения для расчета ДКС, руб.**	Расчетное значение ДКС (информационно), руб.	Сумма ДКС, руб.	денежной позиции для уплаты ДКС

<sup>\* -</sup> рассчитывается по сделкам, не являющимися внесистемными и не входящими в сделки своп с учетом влияния на ДКС объема в заявках (коэффициенты К1, К2).

. 7	U		т	
VHOHI	CILCILITITI	представитель	HIJ199T/TJ	
<i>y</i>	OWOSCHERIN	пислетавитель	13111111111111	
		110000000000000000000000000000000000000	~~~~~	

<sup>\*\* -</sup> рассчитывается по сделкам, не являющимися внесистемными и не входящими в сделки своп, с учетом влияния на ДКС объема в заявках (коэффициенты К1, К2) и с поправкой на коэффициент учета тарифного плана, выбранного по данному регистрационному коду (коэффициент F).

# 2.8.2. СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО ДОКУМЕНТА (ХМL-ФАЙЛ) «ОТЧЕТ ПО ОБЯЗАТЕЛЬСТВАМ УЧАСТНИКА ТОРГОВ ПО ДОПОЛНИТЕЛЬНОМУ КОМИССИОННОМУ СБОРУ (ДКС)»

MICEX_DOC  ROPEORED SARRHIT (root element) XML  ACRYMICHTS  DOC RATE  ACRYMICHTS  DOC DATE  ACRYMICHTS  DOC TYPE ID  RECREW SEREPTORING ADOXESTION BY  RECREW SERVING AND B	Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязате льность	Тип	Размер	чные
DOC_DATE   Дага формирования файла   Her   Date	MICEX_DOC						знаки
DOC_DATE   Дага формирования файла   Her   Date	DOC_REQUISITES		Блок информации о документе				
DOC TIME   Becas populposaums daina   Her   Doc		DOC_DATE		Нет	Date		
DOC_NO   Унивальный учетный номер документа в системе электрошного документо оборота   Her   Character   1-12				Нет	Time		
DOC. TYPE ID  DOC. TYPE ID  DOC. TYPE ID  AREITIPHISTORY DIBIN ADSWERT BE GERENNE  SENDER ID  MECHANAE  SENDER NAME  KPATROE RIBINETIPHISTORY DETAPRATICES  SENDER NAME  KPATROE RIBINETIPHISTORY DETAPRATICES  REMARKS  TOCKET PRINCE PROPERTIES  CUX16  REPORT DATE  R				Нет	Character	1-12	
DOC. TYPE. ID   Ндентификатор типи документа в системе экспериятеля   Her   Character   1-12		_					
SENDER ID		DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе	Нет	Character	1-12	
SENDER_NAME   Краткое наименование отправителя   Her   Character   1-12		SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
RECEIVER, ID REMARKS R				Нет		1-30	
REMARKS         Текст применания к файлу         Her         Character         1-120           SIGNAUTHOR         ФИО автора ЭЦП         Her         Character           JOOC REQUISITES         BROK данных отчета         Ja         Lean           ReportDate         Дата торгов         Да         Character         0-12           FirmId         Илентификатор Участника торгов         Да         Character         0-120           RECORDS         Данные по ДКС для клиента Участника торгов         Да         Character         0-120           RECORDS         Данные по ДКС для клиента Участника торгов         Да         Character         20           NumOrdersGTA         Реквизиты ГТА (ИНН Участника торгов ИНН         Да         Character         20           InfoSumCommission         Общее количество заявок для расчета ДКС (с учетом коэффициенто II., 12)         Да         Number         20         0           SumCommissionGTA         Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициенто К1, К2), расчитивная по всем системным сделкам, не входящим в своп, с погравкой на коэффициент учета тарифинот плана (коэффициент учета тарифинот плана (коэффициент учета тарифинот плана (коэффициент учета тарифинот плана (коэффициент учета тарифинот для уплаты на коэффициент учета тарифинот для уплаты на кора права (карифинот для уплаты на кора прав				Нет	Character		
SIGNAUTHOR   DHO автора ЭЦП							
CUX16   Sanok данных отчета   Aga   Date   FirmId   Идентификатор Участника торгов   Да   Character   0-12   FirmSame   Hammenosamie Vчастника торгов   Да   Character   0-12   Chara							
ReportDate   Дата торгов   Да   Date	/DOC REQUISITES	BIGINIO III GI	1110 #2109# 0241	1101			
ReportDate   Дата торгов   FirmId   Идентификатор Участника торгов   Да   Да   Спатастег   Спатасте			Блок данных отчета				
FirmIdd Ндентификатор Участника торгов Да Character 0-12 (PirmName Haimenoaame Участника торгов Да Character 0-120 (PirmName Haimenoaame Участника торгов Да Character 0-120 (PirmName Haimenoaame Office as Kineurra Участника торгов (PirmName Haimenoamenoamenoamenoamenoamenoamenoamenoa	03/110	ReportDate		Па	Date		
RECORDS         Даниые по ДКС для клиента Участника торгов         Да         Character         0-120           DetailsGTA         Реквизиты ГТА (ИНН Участника торгов ИНН для № паспорта Клиента)         Да         Character         20           NumOrdersGTA         Общее количество заявок для расчета ДКС (с учетом коэффициентов L1, L2)         Да         Number         20         0           InfoSumCommissionG TA         Общае сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов К1, K2), рассчитания в по всем системным сделкам, не вкодящим в своп, руб.         Да         Number         20         2           SumCommissionGTA         Общае сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов К1, K2), рассчитанная по всем системным сделкам, не вкодящим в своп, с поправкой на коэффициент руб.         Да         Number         20         2           InfoGTACommission         Расчетное значение общей суммы ДКС вымаемого с ГТА, руб.         Да         Number         20         2           BankAceld         Код денежной позиции для уплаты начисленного ДКС         Нет         Character         12         Character         12         Character         12         Character         12         La         Character         12         Character         12         Character         12         La         Character         12         La         Character         12         La						0-12	
RECORDS         Данные по ДКС для клиента Участника торгов         Да           DetailsGTA         Реквизиты ГТА (ИНН Участника торгов / ИНН для № паспорта Клиента)         Да         Character         20           NumOrdersGTA         Общее количество заявок для расчета ДКС (с учетом коэффициентов L1, L2)         Да         Number         20         0           InfoSumCommissionG TA         Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов K1, K2), рассчитанная по всем системным сделкам, не вкодящим в своп, руб.         Да         Number         20         2           SumCommissionGTA         Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициент в колуфициент учета тарифного плана (коэффициент F), руб.         Да         Number         20         2           InfoGTACommission         Расчетное значение общей суммы ДКС         Да         Number         20         2           GTACommission         Общая сумма ДКС взимаемого с ГТА, руб.         Да         Number         20         2           BankAccld         Кол денежной позиции для уплаты начиселеного ДКС         Нет         Character         12           DETAILS         Детальная информация по клиенту         Да         Character         12           Embeddils         ИНН или № паспорта клиента субброксра         Нет         Character         12           Details         <							
DetailsGTA         Реквизиты ГТА (ИНН Участника торгов/ИНН или № паспорта Клиента)         Да         Character         20           NumOrdersGTA         Обще количество заявок для расчета ДКС (с учетом коэффициентов L1, L2)         Да         Number         20         0           InfoSumCommissionG TA         Спава сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов К1, К2), рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп, с поправкой на коэффициент (с учетом коэффициент Бурб.)         Да         Number         20         2           InfoGTACommission Frame InfoGTACommission         Общяз сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициент Бурб.)         Да         Number         20         2           GTACommission Frame InfoGTACommission Frame InfoGTA	DECODE	riffiliname		да	Character	0-120	
NumOrdersGTA	RECURDS	D + 'L CTA		п	Cl	20	
InfoSumCommission			или № паспорта Клиента)				0
TA			учетом коэффициентов L1, L2)				•
Се учетом коэффициентов К1, К2), рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп, с поправкой на коэффициент учета тарифного плана (коэффициент F), руб.			(с учетом коэффициентов К1, К2), рассчитанная по всем системным сделкам, не	Да	Number	20	2
InfoGTACommission   Pacчетное значение общей суммы ДКС   Взимаемого с ГТА (информационно), руб.   Да   Number   20   2		SumCommissionGTA	(с учетом коэффициентов К1, К2), рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп, с поправкой на коэффициент	Да	Number	20	2
GTACommission  Oбщая сумма ДКС взимаемого с ГТА, руб.  BankAccId  Koд денежной позиции для уплаты  начисленного ДКС   DETAILS  FirmINN  ИНН Участника торгов  ClientCode  Краткий код клиента  Details  ИНН или № паспорта клиента  NumOrders  Количество заявок (с учетом коэффициентов L1, L2)  InfoSumCommission  Oбщая 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.  //DETAILS  //DETAILS  //CUX16		InfoGTACommission	Расчетное значение общей суммы ДКС	Да	Number	20	2
ВапкАссId Код денежной позиции для уплаты начисленного ДКС  Детальная информация по клиенту  FirmINN ИНН Участника торгов Да Character 12  ClientCode Краткий код клиента  Details ИНН или № паспорта клиента  SubDetails ИНН или № паспорта клиента  Her Character 12  Character 12  MumOrders  Количество заявок (с учетом коэффициентов L1, L2)  InfoSumCommission Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов К1, К2), рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп, руб.  SumCommission Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов К1, К2), рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп, с поправкой на коэффициент учета тарифного плана (коэффициент F), руб.  //DETAILS //RECORDS //CUX16		GTACommission	Общая сумма ДКС взимаемого с ГТА, руб.	Да	Number	20	2
DETAILS         FirmINN       ИНН Участника торгов       Да       Character       12         ClientCode       Краткий код клиента       Her       Character       12         Details       ИНН или № паспорта клиента       Her       Character       20         SubDetails       ИНН или № паспорта клиента субброкера       Her       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       Да       Претаправкой на коэффициент F), руб.       Да       Претаправкой на коэффициент F), руб.       Да       Претаправкой на коэффициент F), руб.       Да       Претаправкой на коэффициент F)       Да       Претаправкой на коэффициент F)       Да       Претаправкой на коэффициент F)       Претаправкой на коэффициент F)       Претаправкой на коэффициент F)       Претаправкой на коэффициент F)			Код денежной позиции для уплаты	Нет			
FirmINN         ИНН Участника торгов         Да         Character         12           ClientCode         Краткий код клиента         Heт         Character         12           Details         ИНН или № паспорта клиента         Her         Character         20           SubDetails         ИНН или № паспорта клиента субброкера         Her         Character         20           NumOrders         Количество заявок (с учетом коэффициентов L1, L2)         Да         Number         20         0           InfoSumCommission         Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов К1, К2), рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп, руб.         Да         Number         20         2           SumCommission         Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов К1, К2), рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп, с поправкой на коэффициент учета тарифного плана (коэффициент F), руб.         Да         Number         20         2           /DETAILS         (с учетом коэффициент Б), руб.         (с учетом коэффициент F), руб.	DETAILS						
ClientCode       Краткий код клиента       Her       Character       12         Details       ИНН или № паспорта клиента       Her       Character       20         SubDetails       ИНН или № паспорта клиента субброкера       Her       Character       20         NumOrders       Количество заявок (с учетом коэффициентов L1, L2)       Да       Number       20       0         InfoSumCommission       Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов К1, K2), рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп, руб.       Да       Number       20       2         SumCommission       Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов К1, 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       //DETAILS       Кесоrds		FirmINN		Да	Character	12	
Details         ИНН или № паспорта клиента         Her         Character         20           SubDetails         ИНН или № паспорта клиента субброкера         Her         Character         20           NumOrders         Количество заявок (с учетом коэффициентов L1, L2)         Да         Number         20         0           InfoSumCommission         Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов К1, К2), рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп, руб.         Да         Number         20         2           SumCommission         Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов К1, К2), рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп, с поправкой на коэффициент учета тарифного плана (коэффициент F), руб.         Да         Number         20         2           /DETAILS         КЕСОRDS         КСИХ16         КОХ16         Колиента клиента субброкера         Нет         Снагастег         20         2							
SubDetails       ИНН или № паспорта клиента субброкера       Her       Character       20         NumOrders       Количество заявок (с учетом коэффициентов L1, L2)       Да       Number       20       0         InfoSumCommission       Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов К1, К2), рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп, руб.       Да       Number       20       2         SumCommission       Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов К1, К2), рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп, с поправкой на коэффициент учета тарифного плана (коэффициент F), руб.       Да       Number       20       2         /DETAILS       // DETAILS       // CUX16       —<							
NumOrders         Количество заявок (с учетом коэффициентов L1, L2)         Да         Number         20         0           InfoSumCommission         Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов К1, K2), рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп, руб.         Да         Number         20         2           SumCommission         Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов К1, 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         СОХ16         Кесоrbs         СОХ16							
InfoSumCommission         Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов К1, К2), рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп, руб.         Да         Number         20         2           SumCommission         Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов К1, К2), 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         ////> ///> ///> ///> ///> ///> ///> /			Количество заявок (с учетом коэффициентов				0
SumCommission         Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов К1, К2), рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп, с поправкой на коэффициент учета тарифного плана (коэффициент F), руб.         Да         Number         20         2           /DETAILS         /CUX16         —<		InfoSumCommission	Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов K1, K2), рассчитанная по всем системным сделкам, не	Да	Number	20	2
/RECORDS	(DETAIL C	SumCommission	Общая сумма комиссионного вознаграждения (с учетом коэффициентов К1, К2), рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп, с поправкой на коэффициент	Да	Number	20	2
/CUX16							

### 2.9. Коды режимов торгов с учетом совершаемых на них сделок с инструментами

Инструменты	Системный	Внесистемный		
	режим	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			
Сделки фикс	FIXS	FIXN		
Средневзвешенные сделки	WAPS	WAPN		
Сделки своп	Аукцион с	Банком России		
	A	UCB		
Инструменты переводов	TRAN			
Инструменты переводов НКЦ	TRAD			

<sup>\* -</sup> Безадресная сделка типа «всем» в Режиме урегулирования