

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 i -й итерации:

$$V_{\text{ост}i} = V - \sum_{j=1}^{i-1} V_{\text{факт}j},$$

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

где $V_{\text{факт}_j}$ – объем, фактически исполненный при выставлении связанной заявки на j -й итерации. На итерации $i=1$ $V_{\text{ост}_i} = V$.

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

$$M_i = \text{Min} \left(N - i + 1, \text{Floor} \left(\frac{V_{\text{ост}_i}}{V_{\text{min}}} \right) \right)$$

1.7.4. Средний объем заявки из алгоритмического пакета заявок:

$$V_{\text{сп}_i} = \text{Floor} \left(\begin{cases} M_i = 0 : V_{\text{ост}_i} \\ M_i \neq 0 : \frac{V_{\text{ост}_i}}{M_i} \end{cases} \right)$$

1.7.5. Минимальный объем заявки из алгоритмического пакета заявок:

$$V_{\text{min}_i} = \begin{cases} V_{\text{сп}_i} = 0 : 0 \\ V_{\text{сп}_i} \neq 0 : \text{Max} \left(\text{Floor} \left(V_{\text{сп}_i} \times \left(1 - \frac{K_r \text{exp}}{2} \right) \right), V_{\text{min}} \right) \end{cases}$$

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

1.7.6. Максимальный объем заявки из алгоритмического пакета заявок:

$$V_{\text{max}_i} = \text{Ceil} \left(V_{\text{сп}_i} \times \left(1 + \frac{K_r \text{exp}}{2} \right) \right)$$

1.7.7. Случайный объем заявки из алгоритмического пакета заявок:

$$V_{\text{rand}_i} = \text{Random}(V_{\text{min}_i}, V_{\text{max}_i})$$

Границы диапазона включаются.

При равномерном распределении ($K_r = K_r \text{exp} = 0$) V_{rand_i} всегда будет равно $V_{\text{сп}_i}$.

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

$$V_{\text{min ост}_i} = \text{Min}(V_{\text{rand}_i}, V_{\text{ост}_i} - V_{\text{min}} \times \text{Max}(M_i - 1, 0))$$

1.7.9. Дополнение остатка (если в результате исполнения i -й итерации (при условии полного исполнения заявки в ТС) в алгоритмическом пакете остается объем $< V_{\text{min}}$, то остаток прибавляется к объему текущей итерации):

$$V_{\text{доп}_i} = \begin{cases} V_{\text{ост}_i} - V_{\text{min ост}_i} \geq V_{\text{min}} : V_{\text{min ост}_i \\ V_{\text{ост}_i} - V_{\text{min ост}_i} < V_{\text{min}} : V_{\text{ост}_i} \end{cases}$$

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

$$V_{\text{план}_i} = \begin{cases} V_{\text{доп}_i} \geq V_{\text{min}} : V_{\text{доп}_i \\ V_{\text{доп}_i} < V_{\text{min}} : 0 \end{cases}$$

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 – $K_r = 0, \dots, 1$ 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 - $V_{\text{сп}_i}$).

Величина случайного отклонения заявок рассчитывается следующим образом:

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

где $K_r \text{exp}$ – 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 необходимости проведения коррекции его параметров. Если в дальнейшем при исполнении алгоритмического пакета и пересчете его остатка объем заявки в какой-либо 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 объем одной заявки, содержащейся в данном 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_TMS, CNYRUB_SPT USDCHF_TOD, USDCHF_TOM, USDCHF_SPT BYNRUB_TOD, BYNRUB_TOM, BYNRUB_TMS GBPRUB_TOD, GBPRUB_TOM, GBPRUB_TMS HKDRUB_TOD, HKDRUB_TOM, HKDRUB_TMS USDKZT_TOD, USDKZT_TOM, USDKZT_SPT USDTRY_TOD, USDTRY_TOM, USDTRY_SPT USDJPY_TOD, USDJPY_TOM, USDJPY_SPT KZTRUB_TOD, KZTRUB_TOM, KZTRUB_TMS, KZTRUB_SPT | 1,00% |

| | |
|--|--|
| TRYRUB_TOD, TRYRUB_TOM, TRYRUB_TMS CHFRUB_TOD, CHFRUB_TOM, CHFRUB_TMS JPYRUB_TOD, JPYRUB_TOM, JPYRUB_TMS 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 | |
|--|--|

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_TMS, CNYRUB_SPT USDCHF_TOD, USDCHF_TOM, USDCHF_SPT BYNRUB_TOD, BYNRUB_TOM, BYNRUB_TMS GBPRUB_TOD, GBPRUB_TOM, GBPRUB_TMS HKDRUB_TOD, HKDRUB_TOM, HKDRUB_TMS USDKZT_TOD, USDKZT_TOM, USDKZT_SPT USDTRY_TOD, USDTRY_TOM, USDTRY_SPT USDJPY_TOD, USDJPY_TOM, USDJPY_SPT KZTRUB_TOD, KZTRUB_TOM, KZTRUB_TMS, KZTRUB_SPT TRYRUB_TOD, TRYRUB_TOM, TRYRUB_TMS CHFRUB_TOD, CHFRUB_TOM, CHFRUB_TMS JPYRUB_TOD, JPYRUB_TOM, JPYRUB_TMS 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 | 0,50% |

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_TTTT_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.

TTTT – 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: *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 | Торговый идентификатор Участника торгов, используемый для формирования ПЭП | Время регистрации заявки | Направление. | Номер алгоритмического пакета заявок | 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 | Торговый идентификатор Участника торгов, используемый для формирования ПЭП | Время регистрации заявки | Направление. | Номер алгоритмического пакета заявок | 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 |
| | AlgoOrderNo | Номер алгоритмического пакета заявок | Нет | Number | 20 | 0 |

| | | | | | | |
|--|----------------|--|-----|-----------|------|---|
| | IsActualMM | Маркет-мейкерская заявка соответствует условиям маркет-мейкерского договора (Y – Да, M – Нет) | 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: 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 | 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: *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 | Напра влен. | Курс сделки | Объем в валюте лота, ед. валюты | Объем в сопряж. валюте, ед. валюты | Номер заявки | Номер алгоритмического пакета заявок | 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 | Номер алгоритмического пакета заявок | Сделка с ПФИ | Контрагент | 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 титальной 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 |
| | AlgoOrderNo | Номер алгоритмического пакета заявок | Нет | Number | 20 | 0 |
| | IsActualMM | Маркет-мейкерская заявка соответствует условиям маркет-мейкерского договора (Y – Да, M – Нет) | Нет | string | 1-1 | |
| | 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 | 2 |
| | 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 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. ФОРМА

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 спот:

<Код сделки спот>

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 | Номер алгоритмического пакета заявок | Сделка с ПФИ | Контрагент | Комисс. вознагражд. за организацию торгов, руб. | Дополнительное комиссионное вознаграждение за организацию торгов (справочно), руб.. | Комисс. вознагражд. за клиринг. обслуживание, 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 | 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 | | | | | | |
| CUX23B | | 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: B – Покупка; S – Продажа; | Да | Character | 1 | |
| | 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 | 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 |
| | 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 | 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 | | | | | |
| | /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. ФОРМА

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

Период заключения сделок: <Дата1> - <Дата2>

Биржа: ПАО Московская Биржа

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

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

| Дата торгов | Номер сделки | Время заключения сделки | Код режима торгов | Код инструмента | Направление. | Код валюты лота | Код сопряженной 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 (начальное значение), руб. | Доп. комиссия (окончательное значение), руб. | Реквизиты контракта | Погашенный объем сделки по контракту, ед. валюты лота | Изменения Доп. комиссии, руб. |
|-------------|--------------|-------------------------|-------------------|-----------------|--------------|-----------------|------------------------|--------------|---------------------------|-------------|---------------------------------|------------------------------------|---|--|--|---------------------|---|-------------------------------|
| | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

Итого покупка:

Итого по комиссии:

Уполномоченный представитель Биржи: _____ **/ФИО/**

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

| 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 | | | | | | |
| 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) | Нет | Character | 0-120 | |
| RECORDS | | Блок данных по сделке | | | | |
| | TradeDate | Дата торгов | Да | Date | | |
| | TradeNo | Номер сделки | Да | Number | 20 | 0 |
| | TradeTime | Время заключения сделки | Да | Time | | |
| | BoardId | Идентификатор правил торгов | Да | Character | 4 | |
| | SecurityId | Идентификатор инструмента | Да | Character | 12 | |
| | SecShortName | Краткое наименование инструмента | Да | Character | 10 | |
| | BuySell | Направление сделки: B – Покупка; S – Продажа; | Да | Character | 1 | |
| | CurrencyId | Идентификатор валюты лота | Да | Character | 4 | |
| | CoCurrencyId | Идентификатор сопряженной валюты | Да | Character | 4 | |
| | FaceValue | Котировка | Да | Number | 20 | 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 | Да | Number | 20 | 2 |
| | Value | Объем в сопряженной валюте, ед. валюты | Да | Number | 20 | 2 |
| | QuantityFinal | Оставшийся объем сделки для погашения по контракту, ед. валюты лота | Да | Number | 20 | 2 |
| | AddExchCommStart | Дополнительная комиссия (начальное значение), руб. | Да | Number | 20 | 2 |
| | AddExchCommFinal | Дополнительная комиссия (окончательное значение), руб. | Да | Number | 20 | 2 |
| CONTRACT_REQ | | Блок данных по контракту | | | | |
| | ContractRequisites | Реквизиты контракта | Да | Character | 0-120 | |
| | QuantityUtilize | Погашенный объем сделки по контракту, ед. валюты лота | Да | Number | 20 | 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. 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

<Код сделки своп / Валюта лота: <Наименование>

своп контракта> Сопряж. валюта: <Наименование>

Котировки за:

ед. валюты лота

| Номер сделки | Время заключения сделки | Код режима торгов | Направлен. | Базовый курс | Курс сделки | Объем в валюте лота, ед. валюты | Объем в сопряж. валюте, ед. валюты* | Номер заявки | Номер алгоритмического пакета заявок | Контрагент | Код ТКС | Краткий код Клиента |
|--------------|-------------------------|-------------------|------------|--------------|-------------|---------------------------------|-------------------------------------|--------------|--------------------------------------|------------|---------|---------------------|
| | | | | | | | | | | | | |

Сделки фикс/ Средневзвешенные сделки

Сделка фикс/ <Код сделки фикс/ Валюта лота: <Наименование>

средневзвешенная <Код сделки фикс/ Валюта лота: <Наименование>

сделка <Код сделки фикс/ Валюта лота: <Наименование>

Котировки за: ед. валюты лота

| Номер сделки | Время заключения сделки | Код режима торгов | Направлен. | Дата расчета фиксинга/ средневзвешенной цены | Курс фиксинга/ средневзвешенная цена | Дисконт (-) /Премия (+) к средневзвешенной цене | 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

2.6.2. 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 |
| | AlgoOrderNo | Номер алгоритмического пакета заявок | Нет | Number | 20 | 0 |
| | TradeTime | Время заключения сделки | Да | Time | | |
| | FixingDate | Дата расчета фиксинга/ средневзвешенной цены | Нет | Date | | |
| | FixingRate | Курс фиксинга/ Средневзвешенная цена | Нет | Number | 20 | 6 |
| | 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, Дисконт (-) /Премия (+) к средневзвешенной цене | Нет | Number | 20 | 6 |
| | 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 | 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 | | | | | |

2.7. «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 п/п | Уникальный код заявки | 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» CUX24

| Название ноды | Название атрибута | Описание | Обязательность | Тип | Размер | Десятичные знаки |
|-----------------|-------------------|--|----------------|-----------|--------|------------------|
| MICEX_DOC | | Корневой элемент (root element) XML документа | | | | |
| DOC_REQUISITES | | Блок информации о документе | | | | |
| | DOC_DATE | Дата формирования файла | Нет | Date | | |
| | DOC_TIME | Время формирования файла | Нет | Time | | |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота | Нет | Character | 1-12 | |
| | DOC_TYPE_ID | Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота | Нет | Character | 1-12 | |
| | SENDER_ID | Идентификатор отправителя | Нет | Character | 1-12 | |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | Нет | Character | 1-30 | |
| | RECEIVER_ID | Идентификатор получателя | Нет | Character | 1-12 | |
| | REMARKS | Текст примечания к файлу | Нет | Character | 1-120 | |
| | SIGNAUTHOR | ФИО автора ЭЦП | Нет | Character | | |
| /DOC_REQUISITES | | | | | | |
| CUX24 | | Блок данных отчета | | | | |
| | EntrytDate | Дата торгов | Да | Date | | |
| | FirmId | Идентификатор Участника торгов | Да | Character | 0-12 | |
| | FirmName | Наименование Участника торгов | Да | Character | 0-120 | |
| | FirmNameEN | Наименование Участника торгов (eng) | Нет | Character | 0-120 | |
| RECORDS | | Блок данных по заявке | | | | |
| | RecNo | Номер по порядку | Да | Number | 11 | 0 |
| | TransNo | Уникальный код заявки (номер транзакции) | Да | Number | 20 | 0 |
| | 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. 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. | Номер поручения на подачу алгоритмического пакета заявок | Код режима торгов | Идентификатор инструмента | Объем в валюте лота, ед. валюты | | Идентификатор валюты лота | Предельная цена поручения | Контр агент | Время снятия поручения ТС | 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/

2.7.4. 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 |
| | AlgoOrderNo | Номер поручения на подачу алгоритмического пакета заявок | Нет | 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 | 2 |
| | 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

2.8. 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 формируются и направляются посредством системы ЭДО только Участникам торгов валютного рынка.

2.8.1. 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) | Суммарный оборот сделок ГТА для расчета ДКС, руб.* | Доля ГТА в суммарном обороте сделок по всему рынку за день, %** | Количество заявок, компенсированное оборотом сделок ГТА (округляется при расчете по коэффициенту К) | Сумма ДКС, руб. | Код денежной позиции для уплаты ДКС |
|---|----------------------|---------------------|----------------------------|---------------------------------------|--|--|---|---|-----------------|-------------------------------------|
| | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | |

* - рассчитывается по сделкам ГТА, не являющимися внесистемными и не входящими в сделки своп, а также сделками по инструментам пары BYNRUB (белорусский рубль/ российский рубль).

** - рассчитывается по всем сделкам за день, не являющимися внесистемными и не входящими в сделки своп, а также сделками по инструментам пары BYNRUB (белорусский рубль/ российский рубль).

Уполномоченный представитель Биржи _____

2.8.2. 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 |
| | TurnoverGTA | Суммарный оборот сделок ГТА, рассчитанный по всем системным сделкам, не входящим в своп и в пару BYNRUB, руб. | Да | Number | 20 | 2 |
| | MarketShareGTA | Доля ГТА в суммарном обороте сделок по всему рынку за день, рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп и в пару BYNRUB, % | Да | Number | 3 | 2 |
| | NumOrdersGTAOffset | Количество заявок, компенсированное оборотом сделок ГТА (с учетом коэффициента К) | Да | Number | 20 | 0 |
| | 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 |
| | Turnover | Суммарный оборот сделок ГТА, рассчитанный по всем системным сделкам, не входящим в своп и в пару BYNRUB, руб. | Да | Number | 20 | 2 |
| | MarketShare | Доля ГТА в суммарном обороте сделок по всему рынку за день, рассчитанная по всем системным сделкам, не входящим в своп и в пару BYNRUB, % | Да | Number | 3 | 2 |
| | NumOrdersOffset | Количество заявок, компенсированное оборотом сделок ГТА (с учетом коэффициента К) | Да | Number | 20 | 0 |
| /DETAILS | | | | | | |
| /RECORDS | | | | | | |
| /CUX16 | | | | | | |
| /MICEX_DOC | | | | | | |

2.9. 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 | |
| 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