

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 и лимитных заявок «снять остаток», «полностью или отклонить», «поставить в очередь» и «скрыть количество» 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, CHFRUB_SPT JPYRUB_TOD, JPYRUB_TOM, JPYRUB_TMS ZARRUB_TOD, ZARRUB_TOM, ZARRUB_TMS USDZAR_TOD, USDZAR_TOM UZSRUB_TOD, UZSRUB_TOM AMDRUB_TOD, AMDRUB_TOM USDAMD_TOD, USDAMD_TOM KGSRUB_TOD, KGSRUB_TOM TJSRUB_TOD, TJSRUB_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, CHFRUB_SPT JPYRUB_TOD, JPYRUB_TOM, JPYRUB_TMS ZARRUB_TOD, ZARRUB_TOM, ZARRUB_TMS USDZAR_TOD, USDZAR_TOM UZSRUB_TOD, UZSRUB_TOM AMDRUB_TOD, AMDRUB_TOM USDAMD_TOD, USDAMD_TOM KGSRUB_TOD, KGSRUB_TOM TJSRUB_TOD, TJSRUB_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_TTTTT_SSS_DDMMYY_NNNNNNNN.xml.p7s.zip.p7e*

со следующими параметрами:

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

TTTTT – 5-символьный тип ЭД (может принимать значения, приведенные ниже в документах);

SSS – 3-символьный код сессии или порядковый номер сессии;

DDMMYY – дата, за которую подготовлены данные в документе;

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	Направлен.	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	Направлен.	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 с указанием признака "только поставить в очередь" с исполнением по разным курсам	LSB
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.

В течение торгового периода основной торговой сессии для режима торгов с кодом SDBP не допускается подача безадресных лимитированных заявок с указанием признака «только поставить в очередь».

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 титულიной 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	Контр агент	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 титულიной 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	Изменение 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	Направление.	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 формируется и направляется 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