**Утверждены Правлением**

**ОАО Московская Биржа**

**11 октября 2013 г. (Протокол №88)**

**Параметры заявок и отчетные документы валютного рынка и рынка драгоценных металлов**

1. **Параметры заявок**
   1. Среднее допустимое количество действий[[1]](#footnote-1)\* в секунду, выполняемых в Торговой системе с использованием торгового идентификатора на протяжении 5 минут, – 150.
   2. Среднее допустимое количество сообщений об ошибке в секунду, формируемых в Торговой системе вследствие ошибочных действий, выполняемых с использованием торгового идентификатора на протяжении 5 минут, – 10.
   3. Минимальное количество лотов, указываемых в заявке типа «скрыть количество» и отображаемых в окне текущих котировок, – 5 000.
   4. Максимальное соотношение количества лотов, скрытых в заявке типа «скрыть количество», к количеству лотов, отображаемых в окне текущих котировок, – 100:1.
2. **Отчетные документы** 
   1. **Порядок наименования файлов с электронными документами (ЭД) и электронными сообщениями (ЭС) в формате XML.**

**Формат:** файлы в формате XML (ЭД - подписанный электронной подписью документ, ЭС – неподписанное электронной подписью сообщение);

**Наименование**: *MMNNNNN\_TTTTT\_SSS\_DDMMYY\_NNNNNNNNN.xml.p7s* со следующими параметрами:

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

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

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

*DDMMYY* – дата, за которую подготовлены данные в документе;

*NNNNNNNNN* - 8-символьный уникальный номер ЭД или ЭС.

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

* 1. **Выписка из реестра заявок**

Пример имени файла: ***MB12345\_CUX22\_000\_031011\_12345678.xml***

Код сессии (параметр ***SSS*** в имени файла) всегда принимает значение ***000*.**

Файл в виде ЭС формируется и направляется по требованию Участника торгов посредством электронных каналов связи.

* + 1. *ФОРМА*

**Выписка из реестра заявок**

Дата регистрации заявок: <дата>

Биржа: **ОАО Московская Биржа**

Участник торгов: **<Регистрационный код>, <Наименование участника торгов>**

Расчетный код: **<Расчетный код 1>…<Расчетный код N>**

Наименование сессии: **Основная сессия**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Инструмент: | | **<Код инструмента>** | | Валюта лота: | | **<Наименование>** | |  | |  | |  | |
| Дата исполнения: | | **<Дата>** | | Сопряж. валюта: | | **<Наименование>** | | Котировки за: | |  | | ед. валюты лота | |
| Номер заявки | АСП трейдера/Участника торгов | Время  регистрации  заявки | Направлен. | Тип | Объем в валюте лота, ед. валюты | | Предельная цена заявки | Сост. | Время  снятия | | Остаток заявки | Код конечного контрагента | Краткий код Клиента |
| Всего | Скрыто |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | |  |  |  |

*Заявки на заключение сделок своп*

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Сделка своп: | | **<Код сделки своп >** | |  | | | Валюта лота: | | **<Наименование>** | |  | |  | |  | |
|  | | | Сопряж. валюта: | | **<Наименование>** | | Котировки за: | |  | | ед. валюты лота | |
| Номер заявки | АСП трейдера/Участника торгов | | Время  регистрации  заявки | Направлен. | Тип | Базовый курс | | Объем в валюте лота, ед. валюты | | Предельная цена заявки | Сост. | Время  снятия | Остаток заявки | Код конечного контрагента | | Краткий код Клиента |
|  |  | |  |  |  |  | |  | |  |  |  |  |  | |  |
|  |  | |  |  |  |  | |  | |  |  |  |  |  | |  |

*Заявки на заключение сделок с Бивалютной корзиной*

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Инструмент: | | **<Код инструмента>** | | Валюта лота: | | **<Наименование>, <Наименование>** | |  | |  |  | |
| Сопряж. валюта: | | **<Наименование>** | | Котировки за: | |  | ед. валюты лота | |
| Номер заявки | АСП трейдера/Участника торгов | Время  регистрации  заявки | Направлен. | Тип | Объем в валюте лота, ед. валюты | | Предельная цена заявки | Сост. | Время  снятия | Остаток заявки | Код конечного контрагента | Краткий код Клиента |
| Всего | Скрыто |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

* + 1. *СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО СООБЩЕНИЯ (XML-ФАЙЛ) «ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА ЗАЯВОК»*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 | Регистрационный код Участника торгов | Да | Character | 0-12 |  |
|  | FirmName | Наименование Участника торгов | Да | Character | 0-120 |  |
| SETTLE |  | Блок информации по расчетному коду |  |  |  |  |
|  | ExtSettleCode | Расчетный код Участника торгов | Да | Character | 20 |  |
| SESSION |  | Блок данных по типу сессии |  |  |  |  |
|  | AddSession | Тип сессии (N - Основная сессия) | Да | Character | 1 |  |
|  | SessionName | Наименование сессии | Да | Character |  |  |
| CURRPAIR |  | Блок данных валютной пары |  |  |  |  |
|  | CurrencyId | Идентификатор валюты лота | Да | Character | 4 |  |
|  | CurrencyName | Наименование валюты лота | Да | Character | 30 |  |
|  | CoCurrencyId | Идентификатор сопряженной валюты | Да | Character | 4 |  |
|  | CoCurrencyName | Наименование сопряженной валюты | 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 |  |  |
| GROUP |  | Блок данных по виду заявки |  |  |  |  |
|  | TradeGroup | Вид заявки: T - обычная заявка; S - заявка на заключение сделки своп; B - заявка на заключение сделки с Бивалютной корзиной; | Да | Character | 1 |  |
| RECORDS |  | Блок данных по заявке |  |  |  |  |
|  | OrderNo | Номер заявки | Да | Number | 20 | 0 |
|  | UserId | АСП трейдера/Участника торгов | Да | Character | 0-12 |  |
|  | EntryTime | Время регистрации заявки | Да | Time |  |  |
|  | BuySell | Направление заявки B – Покупка S – Продажа | Да | Character | 1 |  |
|  | OrderType | Тип заявки | Да | Character | 3 |  |
|  | BasePrice | Базовый курс | Нет | Number | 20 | 6 |
|  | Quantity | Всего объем в валюте лота, ед. валюты | Да | Number | 20 | 0 |
|  | QuantityHidden | Скрытый объем в валюте лота, ед. валюты | Да | Number | 20 | 0 |
|  | Decimals | Число значимых знаков после запятой в предельной цене заявки (атрибут Price) | Да | Number |  |  |
|  | Price | Предельная цена заявки | Да | Number | 20 | 6 |
|  | Status | Состояние | Да | Character | 1 |  |
|  | AmendTime | Время снятия заявки | Нет | Time |  |  |
|  | Balance | Остаток заявки | Да | Number | 20 | 2 |
|  | CPFirmId | Идентификатор конечного контрагента | Нет | 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 |  |
| /RECORDS |  |  |  |  |  |  |
| /GROUP |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLEDATE |  |  |  |  |  |  |
| /SECURITY |  |  |  |  |  |  |
| /CURRPAIR |  |  |  |  |  |  |
| /SESSION |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLE |  |  |  |  |  |  |
| /CUX22 |  |  |  |  |  |  |

* 1. **Выписка из реестра подтверждений КЦ**

Пример имени файла: ***MB12345\_CUX07\_000\_031011\_12345678.xml***

Код сессии (параметр ***SSS*** в имени файла) всегда принимает значение ***000*.**

Файл в виде ЭС формируется и направляется по требованию Участника торгов посредством электронных каналов связи.

* + 1. *ФОРМА*

**Выписка из реестра подтверждений КЦ**

Дата заключения сделок: <Дата>

Биржа: **ОАО Московская Биржа**

Участник торгов: **<Регистрационный код>, <Наименование участника торгов>**

Расчетный код: **<Расчетный код 1>…<Расчетный код N>**

Наименование сессии: **Основная сессия**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Инструмент: | | **<Код инструмента>** | | Валюта лота: | | **<Наименование>** | |  |  | |  | |
| Дата исполнения: | | **<Дата>** | | Сопряж. валюта: | | **<Наименование>** | | Котировки за: |  | | ед. валюты лота | |
| Номер заявки | Номер подтверждения КЦ | | Время регистрации подтверждения КЦ | | Направлен. | Курс сделки | Объем в валюте лота, ед. валюты | Объем в сопряженной валюте, ед. валюты | | АСП трейдера Клирингового центра | | Краткий код Клиента |
|  |  | |  | |  |  |  |  | |  | |  |
|  |  | |  | |  |  |  |  | |  | |  |
| *Итого покупка:* | | | | | | |  |  | |
| *Итого продажа:* | | | | | | |  |  | |

*Подтверждения КЦ по сделкам, входящим в сделку своп*

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Сделка своп | **<Код сделки своп >** | | |  |
| Номер заявки | Номер подтверждения КЦ | | Время регистрации подтверждения КЦ | | Направлен. | Базовый курс | Курс сделки | Объем в валюте лота, ед. валюты | Объем в сопряженной валюте, ед. валюты | АСП трейдера Клирингового центра | Краткий код Клиента |
|  |  | |  | |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  | |  | |  |  |  |  |  |  |  |
|  | | *Итого покупка:* | | | | | |  |  |
|  | | *Итого продажа:* | | | | | |  |  |

*Подтверждения КЦ по сделкам, входящим в сделки с Бивалютной корзиной*

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Номер заявки | Номер подтверждения КЦ | Время регистрации подтверждения КЦ | Направлен. | Курс сделки | Объем в валюте лота, ед. валюты | Объем в сопряженной валюте, ед. валюты | АСП трейдера Клирингового центра | Краткий код Клиента |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| *Итого покупка:* | | | | |  |  |
| *Итого продажа:* | | | | |  |  |

* + 1. *СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО СООБЩЕНИЯ (XML-ФАЙЛ) «ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА ПОДТВЕРЖДЕНИЙ КЦ»*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 |  |  |  |  |  |  |
| CUX07 |  | Блок данных отчета |  |  |  |  |
|  | ReportDate | Дата торгов | Да | Date |  |  |
|  | FirmId | Регистрационный код Участника торгов | Да | Character | 0-12 |  |
|  | FirmName | Наименование Участника торгов | Да | Character | 0-120 |  |
|  | ExchangeId | Идентификатор биржи | Да | Character | 4 |  |
|  | ExchangeName | Наименование биржи | Да | Character | 120 |  |
| SETTLE |  | Блок информации по расчетному коду |  |  |  |  |
|  | ExtSettleCode | Расчетный код Участника торгов | Да | Character | 20 |  |
| SESSION |  | Блок данных по типу сессии |  |  |  |  |
|  | AddSession | Тип сессии (N - Основная сессия) | Да | Character | 1 |  |
|  | SessionName | Наименование сессии | Да | Character |  |  |
| CURRPAIR |  | Блок данных валютной пары |  |  |  |  |
|  | CurrencyId | Идентификатор валюты лота | Да | Character | 4 |  |
|  | CurrencyName | Наименование валюты лота | Да | Character | 30 |  |
|  | CoCurrencyId | Идентификатор сопряженной валюты | Да | Character | 4 |  |
|  | CoCurrencyName | Наименование сопряженной валюты | 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 подтверждения КЦ |  |  |  |  |
|  | TradeGroup | Вид заявки: T - подтверждение КЦ по обычным сделкам; S - подтверждение КЦ по сделкам, входящим в сделку своп; B - подтверждение КЦ по сделкам, входящим в сделку с Бивалютной корзиной; | Да | Character | 1 |  |
| MAINSEC |  | Блок данных по типам титульных "лицевых" сделок |  |  |  |  |
|  | MainSecurityId | Идентификатор инструмента титульной сделки своп | Да | Character | 12 |  |
|  | MainSecShortName | Краткое наименование инструмента титульной сделки своп | Да | Character | 10 |  |
| RECORDS |  | Блок данных по подтверждению КЦ |  |  |  |  |
|  | OrderNo | Номер заявки | Да | Number | 20 | 0 |
|  | AcceptNo | Номер подтверждения КЦ | Да | Character | 21 |  |
|  | TradeTime | Время регистрации подтверждения КЦ | Да | Time |  |  |
|  | BuySell | Направление сделки B – Покупка S – Продажа | 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 | 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 |
|  | UserId | АСП Клирингового центра | 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 |  |
| /RECORDS |  |  |  |  |  |  |
| /MAINSEC |  |  |  |  |  |  |
| /GROUP |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLEDATE |  |  |  |  |  |  |
| /SECURITY |  |  |  |  |  |  |
| /CURRPAIR |  |  |  |  |  |  |
| /SESSION |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLE |  |  |  |  |  |  |
| /CUX07 |  |  |  |  |  |  |
| /MICEX\_DOC |  |  |  |  |  |  |

* 1. **Выписка из реестра сделок**

Пример имени файла: ***MB12345\_CUX23\_D01\_031011\_12345678.xml.p7s***

Код сессии (параметр ***SSS*** в имени файла) принимает значения: **DNN/MNN/ADD** в зависимости от сессии:

**DNN** – выдается Участникам торгов по окончании основной сессии по инструментам с датами исполнения обязательств, совпадающими с датой проведения торгов, и/или Участникам торгов, предоставившими Клиринговому центру Постоянное поручение на проведение ранних расчетов или Запрос на проведение ранних расчетов в соответствии с Временным регламентом проведения торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов (NN – порядковый номер сессии),

**MNN** – выдается Участникам торгов после 19:00, по окончании основной сессии по инструментам с датами исполнения обязательств, превышающими дату проведения торгов, и/или Участникам торгов, предоставившими Клиринговому центру Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром или Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром в соответствии с Временным регламентом проведения торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов (NN – порядковый номер сессии),

**ADD** – выдается Участникам торгов по окончании дополнительной сессии 2-го типа.

Файлы в виде ЭД формируются и направляются Участнику торгов ежедневно по окончании соответствующих сессий посредством системы ЭДО.

* + 1. *ФОРМА*

**Выписка из реестра сделок**

Дата заключения сделок: <Дата>

Биржа: **ОАО Московская Биржа**

Участник торгов: **<Регистрационный код>, <Наименование участника торгов>**

Расчетный код: **<Расчетный код 1>…<Расчетный код N>**

Наименование сессии: **Основная сессия/Дополнительная сессия**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Инструмент | | **<Код инструмента>** | | | Валюта лота | | | **<Наименование>** | | |  | |  | |  |
| Дата исполнения | | **<Дата>** | | | Сопряж. валюта | | | **<Наименование>** | | | Котировки за | |  | | ед. валюты лота |
| Номер сделки | Время заключения сделки | Направлен. | Курс сделки | Объем в валюте лота, ед. валюты | | Объем в сопряж. валюте, ед. валюты | Номер заявки | | Номер подтверждения КЦ | Код конечного  контрагента | | Комисс. вознагр. за организацию торгов, руб. | | Вознаграждение за предоставление ИТС, руб. | | | Комисс. вознагр. за клиринг. обслуживание, руб. | Комиссия всего по сделке, руб. | Краткий код Клиента |
|  |  |  |  |  | |  |  | |  |  | |  | |  | | |  |  |  |
|  |  |  |  |  | |  |  | |  |  | |  | |  | | |  |  |  |
| Итого покупка: | | | |  | |  | Итого по комиссии: | | | | |  | |  | | |  |  |
| Итого продажа: | | | |  | |  |

*Сделки, входящие в сделку своп*

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Сделка своп | | **<Код сделки своп >** | | |
| Номер сделки | Время заключения сделки | Направлен. | Курс сделки | Объем в валюте лота, ед. валюты | | Объем в сопряж. валюте, ед. валюты | Номер заявки | Номер подтверждения КЦ | Код конечного  контрагента | Комисс. вознагр. за организацию торгов, руб. | Вознаграждение за предоставление ИТС, руб. | Комисс. вознагр. за клиринг. обслуживание, руб. | Комиссия всего по сделке, руб. | Краткий код Клиента |
|  |  |  |  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Итого покупка: | | | |  | |  | Итого по комиссии: | | |  |  |  |  |
| Итого продажа: | | | |  | |  |

*Сделки, входящие в сделку с Бивалютной корзиной*

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Номер сделки | Время заключения сделки | Направлен. | Курс сделки | Объем в валюте лота, ед. валюты | Объем в сопряж. валюте, ед. валюты | Номер заявки | Номер подтверждения КЦ | Код конечного  контрагента | Комисс. вознагр. за организацию торгов, руб. | Вознаграждение за предоставление ИТС, руб. | Комисс. вознагр. за клиринг. обслуживание, руб. | Комиссия всего по сделке, руб. | Краткий код Клиента |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Итого покупка: | | | |  |  | Итого по комиссии: | | |  |  |  |  |
| Итого продажа: | | | |  |  |

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

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

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 | Регистрационный код Участника торгов | Да | Character | 0-12 |  |
|  | FirmName | Наименование Участника торгов | Да | Character | 0-120 |  |
|  | ExchangeId | Идентификатор биржи | Да | Character | 4 |  |
|  | ExchangeName | Наименование биржи | Да | Character | 120 |  |
| SETTLE |  | Блок информации по расчетному коду |  |  |  |  |
|  | ExtSettleCode | Расчетный код Участника торгов | Да | Character | 20 |  |
| SESSION |  | Блок данных по типу сессии |  |  |  |  |
|  | AddSession | Тип сессии (Y - Дополнительная сессия, N - Основная сессия) | Да | Character | 1 |  |
|  | SessionName | Наименование сессии | Да | Character |  |  |
| CURRPAIR |  | Блок данных валютной пары |  |  |  |  |
|  | CurrencyId | Идентификатор валюты лота | Да | Character | 4 |  |
|  | CurrencyName | Наименование валюты лота | Да | Character | 30 |  |
|  | CoCurrencyId | Идентификатор сопряженной валюты | Да | Character | 4 |  |
|  | CoCurrencyName | Наименование сопряженной валюты | 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 - обычная сделка S - сделка своп B - сделка с Бивалютной корзиной | Да | Character | 1 |  |
| MAINSEC |  | Блок данных по типам титульных "лицевых" сделок |  |  |  |  |
|  | MainSecurityId | Идентификатор инструмента титульной сделки своп | Да | Character | 12 |  |
|  | MainSecShortName | Краткое наименование инструмента титульной сделки своп | 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 |
|  | AcceptNo | Номер подтверждения КЦ | Да | Character | 21 |  |
|  | TradeTime | Время заключения сделки | Да | Time |  |  |
|  | TradeType | Тип сделки: Т – системная; N – внесистемная; S – системная, входящая в своп; W – внесистемная, входящая в своп; E – входящая в сделку с Бивалютной корзиной; K – внесистемная, входящая в сделку с Бивалютной корзиной. | 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 | Идентификатор конечного контрагента | 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 | 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 системам | 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 |
|  | 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 | Нет | Number | 20 | 0 |
|  | BoardId | Идентификатор правил торгов | Да | Character | 4 |  |
|  | BoardName | Наименование правил торгов | Да | Character | 30 |  |
| /RECORDS |  |  |  |  |  |  |
| /MAINSEC |  |  |  |  |  |  |
| /GROUP |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLEDATE |  |  |  |  |  |  |
| /SECURITY |  |  |  |  |  |  |
| /CURRPAIR |  |  |  |  |  |  |
| /SESSION |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLE |  |  |  |  |  |  |
| /CUX23 |  |  |  |  |  |  |
| /MICEX\_DOC |  |  |  |  |  |  |

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

Пример имени файла: ***MB12345\_CUX33\_000\_031011\_12345678.xml.p7s***

Код сессии (параметр ***SSS*** в имени файла) всегда принимает значение ***000*.**

Файл в виде ЭД формируется и направляется по требованию Участника торгов посредством системы ЭДО.

* + 1. *ФОРМА*

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

Дата заключения сделок: <Дата>

Биржа: **ОАО Московская Биржа**

Участник торгов: **<Регистрационный код>, <Наименование участника торгов>**

Расчетный код: <**Расчетный код 1**> … <**Расчетный код N**>

Наименование сессии: **Основная сессия/Дополнительная сессия**

*Сделки своп*

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Валюта лота: | | |  | | **<Наименование>** | | |  | | |  | | |  | | |
| Сопряж. валюта: | | |  | | **<Наименование>** | | | Котировки за: | | |  | | | ед. валюты лота | | |
| Сделка своп: | | |  | | **<Код сделки своп >** | | |  | | | |  | | |
| Номер сделки | | Время заключения сделки | | Направлен. | | Базовый курс | Курс сделки | | Объем в валюте лота, ед. валюты | Объем в сопряж. валюте, ед. валюты[[2]](#footnote-2)\* | | | Номер заявки | | | Номер подтверждения КЦ | | Код конечного  контрагента | Краткий код Клиента |
|  | |  | |  | |  |  | |  |  | | |  | | |  | |  |  |
|  | |  | |  | |  |  | |  |  | | |  | | |  | |  |  |
|  | Итого покупка: | | | | | | | |  |  | | |
|  | Итого продажа: | | | | | | | |  |  | | |

*Сделки с Бивалютной корзиной*

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Валюта лота: | | **<Наименование>, <Наименование>** | | |  | | |  |  | | |
| Сопряж. валюта: | | **<Наименование>** | | | Котировки за: | | |  | ед. валюты лота | | |
| Инструмент: | | **<Код инструмента>** | | |
| Номер сделки | Время заключения сделки | | Направлен. | Курс сделки | | Объем в валюте лота, ед. валюты | Объем в сопряж. валюте, ед. валюты | | | Номер заявки | Номер подтверждения КЦ | | Код конечного  контрагента | Краткий код Клиента |
|  |  | |  |  | |  |  | | |  |  | |  |  |
|  |  | |  |  | |  |  | | |  |  | |  |  |
| Итого покупка: | | | | | |  |  | | |
| Итого продажа: | | | | | |  |  | | |

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

* + 1. *СТРУКТУРА ЭЛЕКТРОННОГО ДОКУМЕНТА (XML-ФАЙЛ) «ВЫПИСКА ИЗ РЕЕСТРА СДЕЛОК (СДЕЛКИ АНАЛИТИЧЕСКОГО УЧЕТА)»*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 | Регистрационный код Участника торгов | Да | Character | 0-12 |  |
|  | FirmName | Наименование Участника торгов | Да | Character | 0-120 |  |
|  | ExchangeId | Идентификатор биржи | Да | Character | 4 |  |
|  | ExchangeName | Наименование биржи | Да | Character | 120 |  |
| SETTLE |  | Блок информации по расчетному коду |  |  |  |  |
|  | ExtSettleCode | Расчетный код Участника торгов | Да | Character | 20 |  |
| SESSION |  | Блок данных по типу сессии |  |  |  |  |
|  | AddSession | Тип сессии (Y - Дополнительная сессия, N - Основная сессия) | Да | Character | 1 |  |
|  | SessionName | Наименование сессии | Да | Character |  |  |
| GROUP |  | Блок данных по виду сделки |  |  |  |  |
|  | TradeGroup | Вид сделки: S - сделка своп B - сделка с Бивалютной корзиной | Да | Character | 1 |  |
| CURRPAIR |  | Блок данных валютной пары |  |  |  |  |
|  | CurrencyId | Идентификатор валюты лота | Да | Character | 4 |  |
|  | CurrencyName | Наименование валюты лота | Да | Character | 30 |  |
|  | CoCurrencyId | Идентификатор сопряженной валюты | Да | Character | 4 |  |
|  | CoCurrencyName | 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 |
|  | AcceptNo | Номер подтверждения КЦ | Да | Character | 21 |  |
|  | TradeTime | Время заключения сделки | Да | Time |  |  |
|  | TradeType | Тип сделки: Т – системная; N – внесистемная; S – системная, входящая в своп; W – внесистемная, входящая в своп; E – входящая в сделку с Бивалютной корзиной; K – внесистемная, входящая в сделку с Бивалютной корзиной. | 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 | 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 | Идентификатор конечного контрагента | Нет | 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 | Нет | Number | 20 | 0 |
|  | BoardId | Идентификатор правил торгов | Да | Character | 4 |  |
|  | BoardName | Наименование правил торгов | Да | Character | 30 |  |
| /RECORDS |  |  |  |  |  |  |
| /SECURITY |  |  |  |  |  |  |
| /CURRPAIR |  |  |  |  |  |  |
| /GROUP |  |  |  |  |  |  |
| /SESSION |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLE |  |  |  |  |  |  |
| /CUX33 |  |  |  |  |  |  |
| /MICEX\_DOC |  |  |  |  |  |  |

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