**Изменения в торговых отчетах валютного рынка, связанные с реализацией проектов «Разделение статусов участников торгов и участников клиринга» и «Сделки SWAP как ПФИ»**

* + - 1. Новые формы и структуры отчетов, связанные с реализацией проектов «Разделение статусов участников торгов и участников клиринга» и «Сделки SWAP как ПФИ» приведены в Приложение 1.
      2. Формы и структуры отчетов на английском языке приведены в Приложение 2. При формировании отчетов на английском языке следует учитывать принятые наименования валют (с сайта Банка России) и металлов:

RUB - Russian Rouble;

USD - US Dollar;

EUR – Euro;

GBP - British Pound Sterling;

CNY - China Yuan;

BYR - Belorussian Rouble;

UAH - Ukrainian Hryvnia;

KZT - Kazakh Tenge;

GLD – gold;

SLV - silver.

* 1. **Выписка из реестра заявок**
     1. *ФОРМА*

**Выписка из реестра заявок**

Дата регистрации заявок: <дата>

Биржа: **ОАО Московская Биржа**

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

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

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

Наименование сессии: **<Тип сессии>**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Инструмент: | | | |  | **<Код сделки спот/**  **поставочного фьючерса>** | | | | | Валюта лота: | | | **<Наименование>** | | | |  |  | | |  | | |
| Дата исполнения: | | | |  | **<Дата>** | | | | | Сопряж. валюта: | | | **<Наименование>** | | | | Котировки за: | | | ед. валюты лота | | |
| Номер заявки | АСП Участника торгов | Время  регистрации  заявки | | | Направлен. | Код режима торгов | 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/своп контрактов*

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



* + 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 |  |
|  | FirmNameEN | Наименование Участника торгов (eng) | Да | Character | 0-120 |  |
| CLEARPART |  | Блок данных по Участнику клиринга |  |  |  |  |
|  | ClearingFirmId | Идентификатор Участника клиринга | Нет | Character | 0-12 |  |
|  | ClearingFirmName | Наименование Участника клиринга | Нет | Character | 0-120 |  |
|  | ClearingFirmNameEN | Наименование Участника клиринга (eng) | Нет | Character | 0-120 |  |
| SETTLE |  | Блок информации по расчетному коду |  |  |  |  |
|  | ExtSettleCode | Расчетный код Участника клиринга | Да | Character | 20 |  |
| 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 |  |  |
| GROUP |  | Блок данных по виду заявки |  |  |  |  |
|  | TradeGroup | Вид заявки: T - обычная заявка; S - заявка на заключение сделки своп; | Да | Character | 1 |  |
| RECORDS |  | Блок данных по заявке |  |  |  |  |
|  | OrderNo | Номер заявки | Да | Number | 20 | 0 |
|  | UserId | АСП Участника торгов | Да | Character | 0-12 |  |
|  | EntryTime | Время регистрации заявки | Да | Time |  |  |
|  | BuySell | Направление заявки B – Покупка S – Продажа | Да | Character | 1 |  |
|  | OrderType | Тип заявки | Да | Character | 3 |  |
|  | BasePrice | Базовый курс | Нет | Number | 20 | 6 |
|  | Quantity | Всего объем в валюте лота, ед. валюты | Да | Number | 20 | 0 |
|  | QuantityHidden | Скрытый объем в валюте лота, ед. валюты | 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 |  |
|  | BoardNameEN | Наименование правил торгов (eng) | Да | Character | 30 |  |
| /RECORDS |  |  |  |  |  |  |
| /GROUP |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLEDATE |  |  |  |  |  |  |
| /SECURITY |  |  |  |  |  |  |
| /CURRPAIR |  |  |  |  |  |  |
| /SESSION |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLE |  |  |  |  |  |  |
| /CLEARPART |  |  |  |  |  |  |
| /CUX22 |  |  |  |  |  |  |

* 1. **Выписка из реестра сделок**
     1. *ФОРМА*

**Выписка из реестра сделок**

Дата заключения сделок: <Дата>

Биржа: **ОАО Московская Биржа**

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

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

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

Наименование сессии**: <Тип сессии>**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Инструмент | | | |  | **<Код сделки спот/ сделки фикс/ поставочного фьючерса>** | | | | Валюта лота | | | **<Наименование>** | | |  | |  | |  | | |
| Дата исполнения | | | |  | **<Дата>** | | | | Сопряж. валюта | | | **<Наименование>** | | | | Котировки за | | | |  | ед. валюты лота | | | |
| Номер сделки | | Время заключения сделки | Код режима торгов | Направлен. | Курс сделки | Объем в валюте лота, ед. валюты | Объем в сопряж. валюте, ед. валюты | | Номер заявки | Сделка с ПФИ | | 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/своп контракт*

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Сделка своп | | |  | **<Код сделки своп/**  **своп контракта >** | | | |
| Номер сделки | | Время заключения сделки | Код режима торгов | Направлен. | Курс сделки | Объем в валюте лота, ед. валюты | Объем в сопряж. валюте, ед. валюты | | Номер заявки | Сделка с ПФИ | 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 |  |
|  | FirmNameEN | Наименование Участника торгов (eng) | Да | Character | 0-120 |  |
| CLEARPART |  |  |  |  |  |  |
|  | ClearingFirmId | Идентификатор Участника клиринга | Да | Character | 0-12 |  |
|  | ClearingFirmName | Наименование Участника клиринга | Да | Character | 0-120 |  |
|  | ClearingFirmNameEN | Наименование Участника клиринга (eng) | Да | Character | 0-120 |  |
| SETTLE |  | Блок информации по расчетному коду |  |  |  |  |
|  | ExtSettleCode | Расчетный код Участника клиринга | 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 |  |  |
|  | 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 - обычная сделка S - сделка своп | 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 |
|  | TradeDeriv | Сделка с ПФИ (Y – Да, N – Нет) | Да | Character | 1 |  |
|  | TradeTime | Время заключения сделки | Да | Time |  |  |
|  | TradeType | Тип сделки: Т – системная; N – внесистемная; S – системная, входящая в своп; W – внесистемная, входящая в своп. | 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 |  |
|  | BoardNameEN | Наименование правил торгов (eng) | Да | Character | 30 |  |
| /RECORDS |  |  |  |  |  |  |
| /MAINSEC |  |  |  |  |  |  |
| /GROUP |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLEDATE |  |  |  |  |  |  |
| /SECURITY |  |  |  |  |  |  |
| /CURRPAIR |  |  |  |  |  |  |
| /SESSION |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLE |  |  |  |  |  |  |
| /CLEARPART |  |  |  |  |  |  |
| /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>**

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

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

Наименование сессии: **<Тип сессии>**

*Сделки своп/своп контракты*

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | | | Валюта лота: | | | |  | **<Наименование>** | | | |  | | |  |  | | | |
|  | | | Сопряж. валюта: | | | |  | **<Наименование>** | | | | Котировки за: | | |  | ед. валюты лота | | | |
|  | | | Сделка своп/своп контракт: | | | |  | **<Код сделки своп/**  **своп контракта >** | | | |  | |  | | |
| 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[[1]](#footnote-1)\* | | | | | Номер заявки | 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 |  |
|  | FirmNameEN | Наименование Участника торгов (eng) | Да | 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) | Да | Character | 0-120 |  |
| SETTLE |  | Блок информации по расчетному коду |  |  |  |  |
|  | ExtSettleCode | Расчетный код Участника клиринга | 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 |  |  |
|  | SessionNameEN | Наименование сессии (eng) | Да | Character |  |  |
| GROUP |  | Блок данных по виду сделки |  |  |  |  |
|  | TradeGroup | Вид сделки: S - сделка своп | Да | Character | 1 |  |
| CURRPAIR |  | Блок данных валютной пары |  |  |  |  |
|  | CurrencyId | Идентификатор валюты лота | Да | Character | 4 |  |
|  | CurrencyName | Наименование валюты лота | Да | Character | 30 |  |
|  | CurrencyNameEN | Наименование валюты лота | Да | Character | 30 |  |
|  | CoCurrencyId | Идентификатор сопряженной валюты | Да | Character | 4 |  |
|  | CoCurrencyName | Наименование сопряженной валюты | Да | Character | 30 |  |
|  | CoCurrencyNameEN | Наименование сопряженной валюты | Да | Character | 30 |  |
|  | FaceValue | Котировка | Да | Number | 20 | 6 |
| SECURITY |  | Блок данных инструменту |  |  |  |  |
|  | SecurityId | Идентификатор инструмента | Да | Character | 12 |  |
|  | SecShortName | Краткое наименование инструмента | Да | Character | 10 |  |
| RECORDS |  | Блок данных по сделке |  |  |  |  |
|  | TradeNo | Номер сделки | Да | Number | 20 | 0 |
|  | BuySell | Направление сделки B – Покупка S – Продажа | Да | Character | 1 |  |
|  | OrderNo | Номер заявки | Да | Number | 20 | 0 |
|  | TradeTime | Время заключения сделки | Да | Time |  |  |
|  | TradeType | Тип сделки: Т – системная; N – внесистемная; S – системная, входящая в своп; W – внесистемная, входящая в своп; | 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 |  |
|  | BoardNameEN | Наименование правил торгов (eng) | Да | Character | 30 |  |
| /RECORDS |  |  |  |  |  |  |
| /SECURITY |  |  |  |  |  |  |
| /CURRPAIR |  |  |  |  |  |  |
| /GROUP |  |  |  |  |  |  |
| /SESSION |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLE |  |  |  |  |  |  |
| /CLEARPART |  |  |  |  |  |  |
| /CUX33 |  |  |  |  |  |  |
| /MICEX\_DOC |  |  |  |  |  |  |



**Вариант отчетов на английском языке**

* 1. **Orders Report**
     1. *THE FORM*

**Orders Report**

Trade date: <Date>

Exchange: **Moscow Exchange**

Trading Participant: **<Registration Code>, <Name of Trading Participant>**

Clearing Participant: **<Clearing Identifier>, <Name of Clearing Participant>**

Settlement code**: <settlement code 1>…<settlement code N>**

Session name: **<Session type>**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Instrument: | | |  | **<Spot code/**  **deliverable futures code>** | | | | | Base currency | | | **<Name>** | | |  | |  | | | |
| Settlement date: | | |  | **<Date>** | | | | | Quote currency | | | **<Name>** | | | Quotes for: | | Base currency unit | | | |
| Order No. | Participant EHS (DS) | Time of order registration | | Board | B/S | Type | Size in base currency, currency units | | | Order price | | Status | Cancellation time | | Unfilled quantity | | Counterparty code | Client code |
| Total | | Hidden |
|  |  |  | |  |  |  |  | |  |  | |  |  | |  | |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |  | |  |  | |  |  | |  | |  |  |

*Swap orders/swap contract orders*

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Swap trade: | |  | | **<Swap code/**  **swap contract code>** | | | |  | | Base currency | | | **<Name>** | | |  | |  |  | | |
|  | |  | |  | | | |  | | Quote currency | | | **<Name>** | | | Quotes for: | |  | Base currency unit | | |
| Order No. | | Participant EHS (DS) | | Time of order registration | | Board | B/S | Type | | Basic rate | | Size in base currency, currency units | Order price | | Status | Cancellation time | | Unfilled quantity | | | Counterparty code | Client code | |
|  | |  | |  | |  |  |  | |  | |  |  | |  |  | |  | | |  |  | |
|  | |  | |  | |  |  |  | |  | |  |  | |  |  | |  | | |  |  | |



* + 1. *THE STRUCTURE OF ELECTRONIC MESSAGE (XML-FILE) “ORDERS REPORT”*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Node name** | **Attribute name** | **Description** | **Required** | **Type** | **Size** | **Decimal places** |
| MICEX\_DOC |  | Document root element |  |  |  |  |
| DOC\_REQUISITES |  | Document metadata |  |  |  |  |
|  | DOC\_DATE | Date of the document | No | Date |  |  |
|  | DOC\_TIME | File generation time | No | Time |  |  |
|  | DOC\_NO | Document unique number in the electronic document exchange system | No | Character | 1-12 |  |
|  | DOC\_TYPE\_ID | Document type ID in the electronic document exchange system | No | Character | 1-12 |  |
|  | SENDER\_ID | Sender ID | No | Character | 1-12 |  |
|  | SENDER\_NAME | Sender short name | No | Character | 1-30 |  |
|  | RECEIVER\_ID | Recipient ID | No | Character | 1-12 |  |
|  | REMARKS | Additional remarks | No | Character | 1-120 |  |
|  | SIGNAUTHOR | Name of the electronic signature author | No | Character |  |  |
| /DOC\_REQUISITES |  |  |  |  |  |  |
| CUX22 |  | Element with report data |  |  |  |  |
|  | ReportDate | Trading date | Yes | Date |  |  |
|  | FirmId | Firm ID | Yes | Character | 0-12 |  |
|  | FirmName | Firm name (rus) | Yes | Character | 0-120 |  |
|  | FirmNameEN | Firm name (eng) | Yes | Character | 0-120 |  |
| CLEARPART |  | Element with data per clearing participant |  |  |  |  |
|  | ClearingFirmId | Clearing Firm ID | Yes | Character | 0-12 |  |
|  | ClearingFirmName | Clearing Firm Name (rus) | Yes | Character | 0-120 |  |
|  | ClearingFirmNameEN | Clearing Firm Name (eng) | Yes | Character | 0-120 |  |
| SETTLE |  | Element with data per settlement code |  |  |  |  |
|  | ExtSettleCode | Firm settlement code | Yes | Character | 20 |  |
| SESSION |  | Element with data per session type |  |  |  |  |
|  | AddSession | Session type (N – main Trading session) | Yes | Character | 1 |  |
|  | SessionName | Session name (rus) | Yes | Character |  |  |
|  | SessionNameEN | Session name (eng) | Yes | Character |  |  |
| CURRPAIR |  | Element with data per currency pair |  |  |  |  |
|  | CurrencyId | Currency ID | Yes | Character | 4 |  |
|  | CurrencyName | Currency name (rus) | Yes | Character | 30 |  |
|  | CurrencyNameEN | Currency name (eng) | Yes | Character | 30 |  |
|  | CoCurrencyId | Related currency ID | Yes | Character | 4 |  |
|  | CoCurrencyName | Related currency name (rus) | Yes | Character | 30 |  |
|  | CoCurrencyNameEN | Related currency name (eng) | Yes | Character | 30 |  |
| SECURITY |  | Element with data per security |  |  |  |  |
|  | SecurityId | Security ID | Yes | Character | 12 |  |
|  | SecShortName | Short security name | Yes | Character | 10 |  |
|  | FaceValue | Quote | Yes | Number | 20 | 6 |
| SETTLEDATE |  | Element with data per settlement date |  |  |  |  |
|  | SettleDate | Settlement date | Yes | Date |  |  |
| GROUP |  | Element with data per order type |  |  |  |  |
|  | TradeGroup | Order type: T - normal order; S - SWAP order; | Yes | Character | 1 |  |
| RECORDS |  | Element with data per each order |  |  |  |  |
|  | OrderNo | Order number | Yes | Number | 20 | 0 |
|  | UserId | Trading Participant’s EHS (Equivalent of Handwritten Signature) DS (Digital Signature) | Yes | Character | 0-12 |  |
|  | EntryTime | Order registration time | Yes | Time |  |  |
|  | BuySell | Order direction: B - buy S - sell | Yes | Character | 1 |  |
|  | OrderType | Order type | Yes | Character | 3 |  |
|  | BasePrice | Base rate | No | Number | 20 | 6 |
|  | Quantity | Value expressed in the currency of the lot, in units of currency | Yes | Number | 20 | 0 |
|  | QuantityHidden | Hidden value expressed in the currency of the lot, in units of currency | Yes | Number | 20 | 0 |
|  | Decimals | Number of decimals in the exchange rate (price field) | Yes | Number |  |  |
|  | Price | Price | Yes | Number | 20 | 6 |
|  | Status | Status | Yes | Character | 1 |  |
|  | AmendTime | Order withdrawal time | No | Time |  |  |
|  | Balance | Non-filled remainder | Yes | Number | 20 | 2 |
|  | CPFirmId | Counterparty Firm ID | No | Character | 0-12 |  |
|  | ClientCode | Client code | No | Character | 12 |  |
|  | Details | Client taxpayer number or passport number | No | Character | 20 |  |
|  | SubDetails | Subbroker taxpayer number or passport number | No | Character | 20 |  |
|  | BoardId | Trading board ID | Yes | Character | 4 |  |
|  | BoardName | Trading board name (rus) | Yes | Character | 30 |  |
|  | BoardNameEN | Trading board name (eng) | Yes | Character | 30 |  |
| /RECORDS |  |  |  |  |  |  |
| /GROUP |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLEDATE |  |  |  |  |  |  |
| /SECURITY |  |  |  |  |  |  |
| /CURRPAIR |  |  |  |  |  |  |
| /SESSION |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLE |  |  |  |  |  |  |
| /CLEARPART |  |  |  |  |  |  |
| /CUX22 |  |  |  |  |  |  |

* 1. **Trades Report**
     1. *THE FORM*

**Trades Report**

Trade date: <Date>

Exchnage: **Moscow Exchange**

Trading Participant: **<Registration Code>, <Name of Trading Participant>**

Clearing Participant: **<Clearing Identifier>, <Name of Clearing Participant>**

Settlement code**: <settlement code 1>…<settlement code N>**

Session name: **<Session type>**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Instrument | | | |  | | **<Spot code/fixed deal code/ deliverable futures code>** | | | | Base currency | | **<Name>** | | |  | |  | | | | |  | | |  | |  | |
| Settlement date | | | |  | | **<Date>** | | | | Quote currency | | **<Name>** | | |  | |  | | | | | Quotes for | | |  | | Base currency unit | | | |
| Trade number | Trade execution time | | | Board | | B/S | Rate | Size in base currency, currency units | | Size in quote currency, cur. units | | | Order No. | | Derivative trade | | Counterparty code | | Trading services fee, RUB | | | IT services fee, RUB | | | Clearing services fee, RUB | | Total fee per trade, RUB | | Client code | |
|  |  | | |  | |  |  |  | |  | | |  | |  | |  | |  | | |  | | |  | |  | |  | |
|  |  | | |  | |  |  |  | |  | | |  | |  | |  | |  | | |  | | |  | |  | |  | |
|  | | | *Total buy trades:* | | | | | |  | | | | Total fee: | | |  | | |  | |  | | |
|  | | | *Total sell trades :* | | | | | |  | | | |  | | |  | | |  | |  | | |

*Swap trades/swap contract trades*

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Trade number | Trade execution time | | Board | B/S | Rate | Size in base currency, currency units | Size in quote currency, cur. units | | Order No. | | Derivative trade | | Counterparty code | | Trading services fee, RUB | | IT services fee, RUB | Clearing services fee, RUB | Total fee, per trade, RUB | Client code |
|  |  | |  |  |  |  |  | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  |
|  |  | |  |  |  |  |  | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  |
|  | | | *Total buy trades:* | | | |  | | Total fee: | |  | |  | |  | |  | |
|  | | | *Total sell trades:* | | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |



**Authorized representative of the Exchange:** \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_/Name/

* + 1. *THE STRUCTURE OF ELECTRONIC DOCUMENT (XML-FILE) “TRADES REPORT”*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Node name** | **Attribute name** | **Description** | **Required** | **Type** | **Size** | **Decimal places** |
| MICEX\_DOC |  | Document root element |  |  |  |  |
| DOC\_REQUISITES |  | Document metadata |  |  |  |  |
|  | DOC\_DATE | Date of the document | No | Date |  |  |
|  | DOC\_TIME | File generation time | No | Time |  |  |
|  | DOC\_NO | Document unique number in the electronic document exchange system | No | Character | 1-12 |  |
|  | DOC\_TYPE\_ID | Document type ID in the electronic document exchange system | No | Character | 1-12 |  |
|  | SENDER\_ID | Sender ID | No | Character | 1-12 |  |
|  | SENDER\_NAME | Sender short name | No | Character | 1-30 |  |
|  | RECEIVER\_ID | Recipient ID | No | Character | 1-12 |  |
|  | REMARKS | Additional remarks | No | Character | 1-120 |  |
|  | SIGNAUTHOR | Name of the electronic signature author | No | Character |  |  |
| /DOC\_REQUISITES |  |  |  |  |  |  |
| CUX23 |  | Element with report data |  |  |  |  |
|  | ReportDate | Trading date | Yes | Date |  |  |
|  | FirmId | Firm ID | Yes | Character | 0-12 |  |
|  | FirmName | Firm name (rus) | Yes | Character | 0-120 |  |
|  | FirmNameEN | Firm name (eng) | Yes | Character | 0-120 |  |
| CLEARPART |  | Element with data per clearing participant |  |  |  |  |
|  | ClearingFirmId | Clearing Firm ID | Yes | Character | 0-12 |  |
|  | ClearingFirmName | Clearing Firm Name (rus) | Yes | Character | 0-120 |  |
|  | ClearingFirmNameEN | Clearing Firm Name (eng) | Yes | Character | 0-120 |  |
| SETTLE |  | Element with data per settlement code |  |  |  |  |
|  | ExtSettleCode | Firm settlement code | Yes | Character | 20 |  |
| SESSION |  | Element with data per session type |  |  |  |  |
|  | AddSession | Session type (Y – Additional session, N – main Trading session) | Yes | Character | 1 |  |
|  | SessionName | Session name (rus) | Yes | Character |  |  |
|  | SessionNameEN | Session name (eng) | Yes | Character |  |  |
| CURRPAIR |  | Element with data per currency pair |  |  |  |  |
|  | CurrencyId | Currency ID | Yes | Character | 4 |  |
|  | CurrencyName | Currency name (rus) | Yes | Character | 30 |  |
|  | CurrencyNameEN | Currency name (eng) | Yes | Character | 30 |  |
|  | CoCurrencyId | Related currency ID | Yes | Character | 4 |  |
|  | CoCurrencyName | Related currency name (rus) | Yes | Character | 30 |  |
|  | CoCurrencyNameEN | Related currency name (eng) | Yes | Character | 30 |  |
| SECURITY |  | Element with data per security |  |  |  |  |
|  | SecurityId | Security ID | Yes | Character | 12 |  |
|  | SecShortName | Short security name | Yes | Character | 10 |  |
|  | FaceValue | Quote | Yes | Number | 20 | 6 |
| SETTLEDATE |  | Element with data per settlement date |  |  |  |  |
|  | SettleDate | Settlement date | Yes | Date |  |  |
| GROUP |  | Element with data per trade type |  |  |  |  |
|  | TradeGroup | Trade type: T - normal trade; S - SWAP; | Yes | Character | 1 |  |
| MAINSEC |  | Element with data per main deals types |  |  |  |  |
|  | MainSecurityId | Main SWAP deal security ID | Yes | Character | 12 |  |
|  | MainSecShortName | Main SWAP deal security short name | Yes | Character | 10 |  |
| RECORDS |  | Element with data per each trade |  |  |  |  |
|  | TradeNo | Trade number | Yes | Number | 20 | 0 |
|  | BuySell | Trade direction: B - buy S - sell | Yes | Character | 1 |  |
|  | OrderNo | Order number | Yes | Number | 20 | 0 |
|  | TradeDeriv | Derivative trade (Y – Yes, N – No) | Yes | Character | 1 |  |
|  | TradeTime | Trade conclusion time | Yes | Time |  |  |
|  | TradeType | Trade type: T - normal trade; N - negotiated deal; S - SWAP; W - negotiated deal SWAP; | Yes | Character | 1 |  |
|  | Decimals | Number of decimals in the exchange rate (price field) | Yes | Number |  |  |
|  | Price | Exchange rate | Yes | Number | 20 | 6 |
|  | Quantity | Volume expressed in the currency of the lot, in units of currency | Yes | Number | 20 | 0 |
|  | Value | Value expressed in the related currency, in units of currency | Yes | Number | 20 | 2 |
|  | CPFirmId | Counterparty Firm ID | No | Character | 0-12 |  |
|  | Period | Trading period: O - open period; N - normal trading; C - close period; | Yes | Character | 1 |  |
|  | SettleCode | Settlement code | Yes | Character | 12 |  |
|  | UserId | User ID | Yes | Character | 0-12 |  |
|  | UserExchangeId | Exchange ID | Yes | Character | 4 |  |
|  | BrokerRef | Additional notes (broker reference) | No | Character | 20 |  |
|  | ExtRef | Notes of the external order management system | No | Character | 12 |  |
|  | ExchComm | Trading commission, in rubles | No | Number | 20 | 2 |
|  | ITSComm | Technical access commission, in rubles | No | Number | 20 | 2 |
|  | ClrComm | Clearing commission, in rubles | No | Number | 20 | 2 |
|  | SumComm | Total commission | No | Number | 20 | 2 |
|  | ClientCode | Client code | No | Character | 12 |  |
|  | Details | Client taxpayer number or passport number | No | Character | 20 |  |
|  | SubDetails | Subbroker taxpayer number or passport number | No | Character | 20 |  |
|  | RepoTradeNo | Main SWAP deal number | No | Number | 20 | 0 |
|  | BoardId | Trading board ID | Yes | Character | 4 |  |
|  | BoardName | Trading board name (rus) | Yes | Character | 30 |  |
|  | BoardNameEN | Trading board name (eng) | Yes | Character | 30 |  |
| /RECORDS |  |  |  |  |  |  |
| /MAINSEC |  |  |  |  |  |  |
| /GROUP |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLEDATE |  |  |  |  |  |  |
| /SECURITY |  |  |  |  |  |  |
| /CURRPAIR |  |  |  |  |  |  |
| /SESSION |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLE |  |  |  |  |  |  |
| /CLEARPART |  |  |  |  |  |  |
| /CUX23 |  |  |  |  |  |  |
| /MICEX\_DOC |  |  |  |  |  |  |

* 1. **Trades report (analytical accounting)**
     1. *THE FORM*

**Trades report (analytical accounting)**

Trade date: <Date>

Exchange: **Moscow Exchange**

Trading Participant: **<Registration Code>, <Name of Trading Participant>**

Clearing Participant: **<Clearing Identifier>, <Name of Clearing Participant>**

Settlement code**: <settlement code 1>…<settlement code N>**

Session name: **<Session type>**

*Swap trades/swap contract trades*

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Swap trades/  swap contract trade: | |  | **<Swap code/**  **swap contract code>** | | | | Base currency: | | **<Name>** |  | | |  | |
|  |  | |  | | Quote currency: | | **<Name>** | Quotes for: | | | Base currency unit | |
| Trade number | Trade execution time | Board | B/S | Basic rate | | Rate | Size in base currency, currency units | Size in quote currency, cur. units\* | | | Order number | Counterparty code | | Client code | |
|  |  |  |  |  | |  |  |  | | |  |  | |  | |
|  |  |  |  |  | |  |  |  | | |  |  | |  | |

Total buy trades:

Total sell trades:



**Authorized representative of the Exchange:** \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_/Name/

*\*Value of a trade with the latest settlement date shall be indicated*

* + 1. *THE STRUCTURE OF ELECTRONIC DOCUMENT (XML-FILE) “TRADES REPORT (ANALYTICAL ACCOUNTING)”*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Node name** | **Attribute name** | **Description** | **Required** | **Type** | **Size** | **Decimal places** |
| MICEX\_DOC |  | Document root element |  |  |  |  |
| DOC\_REQUISITES |  | Document metadata |  |  |  |  |
|  | DOC\_DATE | Date of the document | No | Date |  |  |
|  | DOC\_TIME | File generation time | No | Time |  |  |
|  | DOC\_NO | Document unique number in the electronic document exchange system | No | Character | 1-12 |  |
|  | DOC\_TYPE\_ID | Document type ID in the electronic document exchange system | No | Character | 1-12 |  |
|  | SENDER\_ID | Sender ID | No | Character | 1-12 |  |
|  | SENDER\_NAME | Sender short name | No | Character | 1-30 |  |
|  | RECEIVER\_ID | Recipient ID | No | Character | 1-12 |  |
|  | REMARKS | Additional remarks | No | Character | 1-120 |  |
|  | SIGNAUTHOR | Name of the electronic signature author | No | Character |  |  |
| /DOC\_REQUISITES |  |  |  |  |  |  |
| CUX33 |  | Element with report data |  |  |  |  |
|  | ReportDate | Report generation date | Yes | Date |  |  |
|  | FirmId | Firm ID | Yes | Character | 0-12 |  |
|  | FirmName | Firm name (rus) | Yes | Character | 0-120 |  |
|  | FirmNameEN | Firm name (eng) | Yes | Character | 0-120 |  |
| CLEARPART |  | Element with data per clearing participant |  |  |  |  |
|  | ClearingFirmId | Clearing Firm ID | Yes | Character | 0-12 |  |
|  | ClearingFirmName | Clearing Firm Name (rus) | Yes | Character | 0-120 |  |
|  | ClearingFirmNameEN | Clearing Firm Name (eng) | Yes | Character | 0-120 |  |
| SETTLE |  | Element with data per settlement code |  |  |  |  |
|  | ExtSettleCode | Firm settlement code | Yes | Character | 20 |  |
| SESSION |  | Element with data per session type |  |  |  |  |
|  | AddSession | Session type (Y – Additional session,  N – main Trading session) | Yes | Character | 1 |  |
|  | SessionName | Session name (rus) | Yes | Character |  |  |
|  | SessionNameEN | Session name (eng) | Yes | Character |  |  |
| GROUP |  | Element with data per trade type |  |  |  |  |
|  | TradeGroup | Trade type: S - acknowledgement for trades that form a SWAP trade; | Yes | Character | 1 |  |
| CURRPAIR |  | Element with data per currency pair |  |  |  |  |
|  | CurrencyId | Currency ID | Yes | Character | 4 |  |
|  | CurrencyName | Currency name | Yes | Character | 30 |  |
|  | CurrencyNameEN | Currency name (eng) | Yes | Character | 30 |  |
|  | CoCurrencyId | Related currency ID | Yes | Character | 4 |  |
|  | CoCurrencyName | Related currency name | Yes | Character | 30 |  |
|  | CoCurrencyNameEN | Related currency name (eng) | Yes | Character | 30 |  |
|  | FaceValue | Quote | Yes | Number | 20 | 6 |
| SECURITY |  | Element with data per security |  |  |  |  |
|  | SecurityId | Security ID | Yes | Character | 12 |  |
|  | SecShortName | Short security name | Yes | Character | 10 |  |
| RECORDS |  | Element with data per trade |  |  |  |  |
|  | TradeNo | Trade number | Yes | Number | 20 | 0 |
|  | BuySell | Trade direction: B - buy S - sell | Yes | Character | 1 |  |
|  | OrderNo | Order number | Yes | Number | 20 | 0 |
|  | TradeTime | Trade conclusion time | Yes | Time |  |  |
|  | TradeType | Trade type: T - normal trade; N - negotiated deal; S - SWAP; W - negotiated deal SWAP; | Yes | Character | 1 |  |
|  | BasePrice | Base rate | No | Number | 20 | 6 |
|  | Decimals | Number of decimals in the exchange rate (price field) | Yes | Number |  |  |
|  | Price | Exchange rate | Yes | Number | 20 | 6 |
|  | Quantity | Volume expressed in the currency of the lot, in units of currency | Yes | Number | 20 | 0 |
|  | Value | Value expressed in the related currency, in units of currency | Yes | Number | 20 | 2 |
|  | CPFirmId | Counterparty Firm ID | No | Character | 0-12 |  |
|  | ClientCode | Client code | No | Character | 12 |  |
|  | Details | Client taxpayer number or passport number | No | Character | 20 |  |
|  | SubDetails | Subbroker taxpayer number or passport number | No | Character | 20 |  |
|  | RepoTradeNo | Main SWAP trade number | No | Number | 20 | 0 |
|  | BoardId | Trading board ID | Yes | Character | 4 |  |
|  | BoardName | Trading board name (rus) | Yes | Character | 30 |  |
|  | BoardNameEN | Trading board name (eng) | Yes | Character | 30 |  |
| /RECORDS |  |  |  |  |  |  |
| /SECURITY |  |  |  |  |  |  |
| /CURRPAIR |  |  |  |  |  |  |
| /GROUP |  |  |  |  |  |  |
| /SESSION |  |  |  |  |  |  |
| /SETTLE |  |  |  |  |  |  |
| /CLEARPART |  |  |  |  |  |  |
| /CUX33 |  |  |  |  |  |  |
| /MICEX\_DOC |  |  |  |  |  |  |

1. \* *- указывается объем по инструменту с более поздней датой исполнения* [↑](#footnote-ref-1)