

Приложение 3 к Порядку предоставления ПАО «СПБ Биржа»  
дополнительных отчетов Участникам торгов

Описание формата отчетов в виде табулированных  
файлов

Общие замечания по форматам сообщений

- Разделителем полей является символ табуляции.
- Разделитель строк chr(13) + chr(10).
- Строка с заголовками столбцов не передается.
- Разделителем для дробной части является точка.
- Формат даты: DD.MM.YYYY.
- Формат времени: HH:MM:SS:[mmmmmm].
- Кодировка отчетов WIN1251.
- Отчеты передаются в ZIP-архиве.
- Обязательное поле указывается признаком М (mandatory), необязательное – признаком О(optional).

ORDERS – Выписка из реестра заявок

- Имена файлов в архиве имеют формат:
  - orders-ORDERS\_<FIRM CODE>-YYYY-MM-DD.txt

№	Наименование поля	Тип поля	Размер	Описание	М/О
1	ACTION	Текстовый	16	Тип заявки: <ul style="list-style-type: none"> <li>• New - Новая Заявка.</li> <li>• Exec - Заключение Договора на основании Заявки.</li> <li>• Cancel - Заявка отозвана/удалена.</li> </ul>	М
2	ORDER_NO	Числовой	20.0	Уникальный код Заявки, присвоенный в соответствии с пунктом 1.14 Положения 437-П (может совпадать с идентификационным номером заявки). Соответствует шлюзовому полю order_id.	М

3	REG_NO	Числовой	20.0	Идентификационный номер Заявки, присвоенный Биржей в момент ее регистрации в реестре Заявок.	М
4	ENTRY_DATE	Дата/время	DD.MM. YYYY	Дата регистрации Заявки в Системе проведения торгов.	М
5	ENTRY_TIME	Дата/время	HH:MM:SS: mmmmmm	Время регистрации заявки в Системе проведения торгов. (точность до микросекунды)	М
6	FIRMID	Текстовый	12	Дополнительный код Участника торгов, присвоенный Биржей.	М
7	FIRMCODE	Текстовый	64	Код Участника торгов согласно Положению 437-П.	М
8	CLIENT_CODEID	Текстовый	128	Код Клиента участника торгов.	М
9	CLIENT_ALIAS	Текстовый	12	Дополнительный код, присвоенный Биржей, идентифицирующий Клиента.	М
10	CLIENT_COUNTRY	Текстовый	3	Трехзначный цифровой код иностранного государства, в котором зарегистрировано юридическое лицо или гражданином которого является это лицо, соответствующий Общероссийскому классификатору стран мира.	О
11	LOGIN	Текстовый	16	Имя Участника торгов.	О
12	TRD_ACCID	Текстовый	12	Номер торгово-клирингового счета, в счет которого поставлена данная Заявка.	О
13	CP_FIRMID	Текстовый	12	Дополнительный код Участника торгов фирмы-контрагента, присвоенный Биржей. Не заполняется для безадресных Заявок.	О
14	CP_FIRMCODE	Текстовый	64	Код Участника Торгов-контрагента согласно Положению 437-П. Не заполняется для безадресных Заявок.	О
15	ADDRESS_CODE	Текстовый	12	Идентификатор адресных сделок, присвоенный Участнику торгов, подавшему Заявку. Не заполняется для безадресных Заявок.	О
16	CP_ADDRESS_CODE	Текстовый	12	Идентификатор адресных сделок, присвоенный Участнику торгов, которому адресована Заявка. Не заполняется для безадресных Заявок.	О
17	BUY_SELL	Текстовый	1	Направленность Заявки: <ul style="list-style-type: none"> <li>• В- покупка.</li> <li>• S- продажа.</li> </ul>	М
18	ORDER_TYPE	Текстовый	16	Тип заявки:	М

				<ul style="list-style-type: none"> <li>• рыночная Заявка = 1.</li> <li>• лимитная Заявка = 2.</li> <li>• Скрытая Заявка = 100.</li> <li>• Скрытая Заявка с динамической ценой = 102.</li> <li>• адресная Заявка = 103.</li> <li>• Заявка аукциона закрытия = 123.</li> <li>• Оффсетная Заявка = 124.</li> <li>• Котировочная Заявка = 125.</li> <li>• Некотировочная Заявка = 126.</li> <li>• специальная = 127</li> </ul>	
19	IS_ADDRESS	Текстовый	8	<p>Признак адресности Заявки:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• ADDRESS – адресная Заявка.</li> <li>• AUCTION – безадресная Заявка.</li> </ul>	М
20	IS_MM	Текстовый	1	<p>Признак Заявки, поданной во исполнение обязательств Маркет-мейкера:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Y - Заявка подана во исполнение обязательств Маркет-мейкера.</li> <li>• N – признак Заявки, поданной во исполнение обязательств Маркет-мейкера, не указан.</li> </ul>	М
21	SECURITYID	Текстовый	12	Идентификационный код ценной бумаги.	М
22	TRADE_MODE	Текстовый	16	<p>Режим торгов:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• MAIN - Режим основных торгов.</li> <li>• ADDRESS - Режим переговорных сделок.</li> <li>• ADDRESS_REPO - Режим торгов адресное репо.</li> <li>• NONADDRESS_REPO - Режим торгов безадресное репо.</li> <li>• RFQ - Режим торгов RFQ.</li> <li>• ADDRESS_IPO - Режим торгов Адресное размещение.</li> </ul>	М
23	TRADE_PERIOD	Текстовый	5	<p>Торговая сессия:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• MAIN - Основная торговая сессия.</li> <li>• EVE – Дополнительная вечерняя торговая сессия.</li> <li>• MORN - Дополнительная утренняя торговая сессия.</li> </ul>	М

24	QUOTE_CURRENCY	Текстовый	3	Символьный код валюты цены в Заявке. Для облигаций указывается PCT - процент от непогашенного номинала облигации.	М
25	CURRENCY	Текстовый	3	Символьный код валюты платежа по инструменту.	М
26	PRICE	Числовой	26.8	Цена одной ценной бумаги, цена первой части Договора репо.	О
27	REPO_PRICE	Числовой	26.8	Ставка репо.	О
28	QUANTITY	Числовой	26.0	Объём Заявки (начальный объём Заявки), в единицах.	М
29	QUANTITY_LOT	Числовой	26.0	Объём Заявки (начальный объём Заявки), в лотах.	М
30	QUANTITY_REST	Числовой	26.0	Объём оставшейся активной Заявки, в единицах.	О
31	QUANTITY_LOT_REST	Числовой	26.0	Объём оставшейся активной Заявки, в лотах.	О
32	VOLUME	Числовой	26.2	Объём Заявки (первой части Договора репо) в валюте цены.	О
33	STATUS	Текстовый	32	Результат объявления Заявки: <ul style="list-style-type: none"> <li>• NEW - Заявка добавлена.</li> <li>• FILLED - Заявка исполнена полностью.</li> <li>• PARTFILLED - Заявка исполнена частично.</li> <li>• PARTCANCELLED - Оставшаяся часть Заявки отозвана/удалена.</li> <li>• CANCELLED - Заявка отозвана/удалена.</li> </ul>	М
34	STATUS_REASON	Текстовый	32	Причина аннулирования Заявки: <ul style="list-style-type: none"> <li>• USER_CANCEL - запрос пользователя.</li> <li>• USER_MASS_CANCEL - запрос пользователя на массовое снятие.</li> <li>• BROKER_CANCEL - снята брокером.</li> <li>• BROKER_MASS_CANCEL - снята брокером в режиме массового снятия.</li> <li>• DISCONNECT - снята автоматически в результате потерисоединения.</li> <li>• EXPIRED - Заявка GTD снята при наступлении времени снятия Заявки</li> <li>• SESSION - снята Системой проведения торгов при наступлении сессионных событий снятия Заявки.</li> <li>• OPERATOR - снята оператором.</li> <li>• EXPIRED_NOTRADES - снятие остатка Заявки в результате отсутствия.</li> </ul>	М

				<ul style="list-style-type: none"> <li>• EXPIRED_CROSSTRADE</li> <li>• EXPIRED_ORDERBOOK_CROSS</li> <li>• CTRPARTY_DECLINE - адресная Заявка отвергнута контрагентом.</li> <li>• FILLED - адресная Заявка сведена в сделку.</li> <li>• EXT_REJECTED - поручение или его часть сняты по причине отказа в обработке на Бирже.</li> <li>• EXT_EXPIRED - поручение или его часть сняты по причине экспирации Заявки на Бирже.</li> <li>• CANCEL_FOR_RFQ - Заявка снята для исполнения в Режиме торгов RFQ.</li> </ul>	
35	AMEND_DATE	Дата	DD.MM. YYYY	Дата отмены/изменения Заявки в Системе проведения торгов.	○
36	AMEND_TIME	Время	HH:MM:SS: mmmmmm	Время отмены/изменения Заявки в Системе проведения торгов. (точность до микросекунды)	○
37	ISSUE_DATE	Дата	DD.MM. YYYY	Дата исполнения Заявки в Системе проведения торгов.	○
38	ISSUE_TIME	Время	HH:MM:SS. mmmmmm	Время исполнения Заявки в Системе проведения торгов. (точность до микросекунды)	○
39	MATCH_REF	Текстовый	12	Дополнительный идентификатор адресной Заявки.	○
40	NUM_TRADES	Числовой	20.0	Количество Договоров, заключенных на основании поданной Заявки.	○
41	SETT_TYPE	Текстовый	16	Код расчетов.	М
42	SPECIAL_PERIOD	Текстовый	255	Периоды проведения торгов: <ul style="list-style-type: none"> <li>• CLOSE – Аукцион закрытия.</li> <li>• EXTRA – Период стандартной дополнительной ликвидности.</li> <li>• EXTRA_HIGH – Период повышенной дополнительной ликвидности.</li> <li>• NO EXTRA – Период без дополнительной ликвидности.</li> <li>• EXTRA_AFTERMARKET – Период с дополнительной ликвидностью.</li> <li>• EXTRA_ONLY – Период без основной ликвидности.</li> </ul>	○
43	CL_ORDERID	Текстовый	256	Клиентский номер Заявки.	○

44	EXTRA_REF	Текстовый	4	Дополнительный числовой номер Заявки.	О
45	COMMENT	Текстовый	24	Комментарий к Заявке.	О
46	TIME_IN_FORCE	Текстовый	8	Вид Заявки: <ul style="list-style-type: none"> <li>• DAY – Заявка, действующая до определённого времени в течение Торгового дня.</li> <li>• GTC – Заявка, действующая до снятия пользователем.</li> <li>• GTD – Заявка, действующая до указанного в ней момента времени и даты.</li> <li>• IOC – Заявка, допускающая частичное исполнение.</li> <li>• FOK – Заявка, не допускающая частичного исполнения.</li> <li>• XN – Заявка, действующая до конца Торгового дня.</li> <li>• OC – On Close</li> <li>• OO – On Open</li> </ul>	М
47	EXTRA_ORDER_NO	Текстовый	256	Дополнительный номер Заявки, соответствует шлюзовому полю exchorder_id.	О

#### REJECT - Выписка из реестра отвергнутых Заявок

- Данные об отвергнутых Заявках передаются в одном или двух файлах, в зависимости от модуля, в котором произошел отказ выставленной Заявки.
- Заявки, не прошедшие синтаксический разбор, в отчет не включаются.
- Имена файлов в архиве имеют формат:

orders-REJECT\_[EX|RE]\_<FIRM CODE>-YYYY-MM-DD.txt

№	Наименование поля	Тип поля	Размер	Описание	М/О
1	ACTION	Текстовый	16	Тип Заявки или уведомления: <ul style="list-style-type: none"> <li>• New – новая Заявка.</li> <li>• Cancel – Заявка отозвана/удалена.</li> </ul>	М
2	ORDERNO	Числовой	20.0	Регистрационный номер заявки.	М
3	CL_ORDERID	Текстовый	256	Идентификатор Заявки, указанный Клиентом.	О

4	REJECT_DATE	Дата/время	DD.MM. YYYY	Дата отказа в приеме Заявки.	М
5	REJECT_TIME	Дата/время	HH:MM:SS: mmmmmm	Время отказа в приеме Заявки.(точность до микросекунды)	М
6	FIRMID	Текстовый	12	Дополнительный код Участника Торгов, присвоенный Биржей.	О
7	FIRMCODE	Текстовый	64	Код Участника торгов согласно Положению 437-П.	О
8	CLIENT_CODEID	Текстовый	128	Код Клиента согласно Положению 437-П.	О
9	CLIENT_ALIAS	Текстовый	12	Дополнительный код, присвоенный Биржей, идентифицирующий Клиента.	О
10	LOGIN	Текстовый	16	Имя Участника торгов.	О
11	TRD_ACCID	Текстовый	12	Номер торгово-клирингового счета, в счет которого поставлена данная Заявка.	О
12	CP_FIRMID	Текстовый	12	Дополнительный код Участника торгов фирмы-контрагента, присвоенный Биржей.	О
13	BUY_SELL	Текстовый	1	Направленность Заявки: <ul style="list-style-type: none"> <li>• В- покупка.</li> <li>• S- продажа.</li> </ul>	О
14	ORDERTYPE	Текстовый	16	Тип заявки: <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> рыночная Заявка (MARKET) = 1.</li> <li><input type="checkbox"/> лимитная Заявка (LIMIT) = 2.</li> <li><input type="checkbox"/> Скрытая Заявка (HIDDEN) = 100.</li> <li><input type="checkbox"/> Скрытая Заявка с динамической ценой (HIDDEN_DYNAMIC) = 102.</li> <li><input type="checkbox"/> адресная Заявка (NEGOTIATED) = 103.</li> <li><input type="checkbox"/> Заявка аукциона закрытия (CLOSING_AUCTION) = 123.</li> <li><input type="checkbox"/> Оффсетная Заявка (CLOSING_OFFSET) = 124.</li> <li><input type="checkbox"/> Котировочная Заявка (PROTO-RFQ-INITIATE) = 125.</li> <li><input type="checkbox"/> Некотировочная Заявка (PROTO-RFQ-CONFIRM) = 126.</li> <li><input type="checkbox"/> специальная = 127</li> </ul>	О

15	IS_ADDRESS	Текстовый	8	Признак адресности заявки: <ul style="list-style-type: none"> <li>• ADDRESS – адресная Заявка.</li> <li>• AUCTION – безадресная Заявка.</li> </ul>	O
16	IS_MM	Текстовый	1	Признак Заявки, поданной во исполнение обязательств Маркет-мейкера: <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> Y – Заявка подана во исполнение обязательств Маркет-мейкера;</li> <li><input type="checkbox"/> N – признак Заявки, поданной во исполнение обязательств Маркет-мейкера, не указан.</li> </ul>	M
17	SECURITYID	Текстовый	12	Базовый актив торгового инструмента.	O
18	TRADE_MODE	Текстовый	12	Наименование режима торгов: <ul style="list-style-type: none"> <li>• MAIN – Режим основных торгов.</li> <li>• ADDRESS – Режим переговорных сделок.</li> <li>• REPO – Режим адресное или безадресное репо.</li> </ul>	O
19	TRADE_PERIOD	Текстовый	5	Период торгов: <ul style="list-style-type: none"> <li>• MAIN – Основная торговая сессия.</li> <li>• EVE – Дополнительная вечерняя торговая сессия.</li> <li>• MORN – Дополнительная утренняя сессия.</li> </ul>	M
20	QUOTE_CURRENCY	Текстовый	3	Символьный код валюты цены в заявке. Для облигаций указывается PCT - процент от непогашенного номинала облигации.	O
21	CURRENCY	Текстовый	3	Символьный код валюты платежа по инструменту.	O
22	PRICE	Числовой	26.8	Цена за одну ценную бумагу, цена первой части Договора репо.	O
23	REPO_PRICE	Числовой	26.8	Ставка репо.	O
24	QUANTITY	Числовой	26.2	Объём Заявки или Договора, в единицах ЦБ.	O
25	QUANTITY_LOT	Числовой	26.0	Объём Заявки (начальный объём Заявки), в лотах.	O
26	VOLUME	Числовой	26.2	Объём Заявки в валюте платежа.	O
27	REJECT_REASON	Текстовый	32	Причина отказа в приеме Заявки: <ul style="list-style-type: none"> <li>• 0=CLEARING_RULES_VIOLATION - нарушение Правил клиринга.</li> <li>• 1=EXCHANGE_RULES_VIOLATION - нарушение Правил торгов.</li> </ul>	M



28	MATCH_REF	Текстовый	12	Поле «Ссылка».	○
29	SETT_TYPE	Текстовый	16	Код расчетов.	○
30	COMMENT	Текстовый	24	Комментарий к Заявке.	○
31	TIME_IN_FORCE	Текстовый	8	<p>Вид Заявки. Возможные значения:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• DAY - Заявка, действующая до определённого времени в течение Торгового дня.</li> <li>• GTC - Заявка, действующая до снятия пользователем.</li> <li>• GTD – Заявка, действующая до указанного в ней момента времени даты.</li> <li>• IOC - Заявка, допускающая частичное исполнение.</li> <li>• FOK - Заявка, не допускающая частичного исполнения.</li> <li>• XN - Заявка, действующая до конца Торгового дня.</li> <li>• OC - On Close</li> <li>• OO - On Open</li> </ul>	○