

*Приложение 3 к Порядку предоставления ПАО «Санкт-Петербургская 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:mmm.
- Кодировка отчетов WIN1251.
- Отчеты передаются в ZIP-архиве.
- Обязательное поле указывается признаком M (mandatory), необязательное – признаком O(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	M/O
1	ACTION	Текстовый	16	Тип заявки: <ul style="list-style-type: none">• New - Новая Заявка.• Exec - Заключение Договора на основании Заявки.• Cancel - Заявка отозвана/удалена.	M
2	ORDER_NO	Числовой	20.0	Уникальный код Заявки, присвоенный в соответствии с пунктом 1.14 ПоПоложения 437-П (может совпадать с идентификационным номером заявки). Соответствует шлюзовому полю order_id.	M

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: mmm	Время регистрации заявки в Системе проведения торгов.	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"> • В- покупка. • S- продажа. 	М
18	ORDER_TYPE	Текстовый	16	Тип заявки:	М

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

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

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

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

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	M/O
1	ACTION	Текстовый	16	Тип Заявки или уведомления: <ul style="list-style-type: none"> • New – новая Заявка. • Cancel – Заявка отозвана/удалена. 	M
2	ORDERNO	Числовой	20.0	Регистрационный номер заявки.	M
3	CL_ORDERID	Текстовый	256	Идентификатор Заявки, указанный Клиентом.	O

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

15	IS_ADDRESS	Текстовый	8	Признак адресности заявки: <ul style="list-style-type: none"> • ADDRESS – адресная Заявка. • AUCTION – безадресная Заявка. 	O
16	IS_MM	Текстовый	1	Признак Заявки, поданной во исполнение обязательств Маркет-мейкера: <ul style="list-style-type: none"> • Y – Заявка подана во исполнение обязательств Маркет-мейкера; • N – признак Заявки, поданной во исполнение обязательств Маркет-мейкера, не указан. 	M
17	SECURITYID	Текстовый	12	Базовый актив торгового инструмента.	O
18	TRADE_MODE	Текстовый	12	Наименование режима торгов: <ul style="list-style-type: none"> • MAIN – Режим основных торгов. • ADDRESS – Режим переговорных сделок. • REPO – Режим адресное или безадресное репо. 	O
19	TRADE_PERIOD	Текстовый	5	Период торгов: <ul style="list-style-type: none"> • MAIN – Основная торговая сессия. • EVE – Дополнительная вечерняя торговая сессия. • MORN – Дополнительная утренняя сессия. 	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	Объем Заявки или Договора, в единицах ЦБ.	O
25	QUANTITY_LOT	Числовой	26.0	Объем Заявки (начальный объем Заявки), в лотах.	O
26	VOLUME	Числовой	26.2	Объем Заявки в валюте платежа.	O
27	REJECT_REASON	Текстовый	32	Причина отказа в приеме Заявки: <ul style="list-style-type: none"> • 0=CLEARING_RULES_VIOLATION - нарушение Правил клиринга. • 1=EXCHANGE_RULES_VIOLATION - нарушение Правил торгов. 	M

28	MATCH_REF	Текстовый	12	Поле «Ссылка».	0
29	SETT_TYPE	Текстовый	16	Код расчетов.	0
30	COMMENT	Текстовый	24	Комментарий к Заявке.	0
31	TIME_IN_FORCE	Текстовый	8	<p>Вид Заявки. Возможные значения:</p> <ul style="list-style-type: none"> • DAY - Заявка, действующая до определённого времени в течение Торговго дня. • GTC - Заявка, действующая до снятияпользователем. • GTD – Заявка, действующая до указанного в ней момента времени и даты. • IOC - Заявка, допускающая частичное исполнение. • FOK - Заявка, не допускающая частичногоисполнения. • ХН - Заявка, действующая до конца Торговогодня. • OC - On Close • OO - On Open 	0