

Формы биржевых отчетов

Оглавление

Перечень изменений	2
Форматы XML документов	3
Пролог XML документа	3
Элементы XML документа	3
Атрибуты элементов XML документа	4
Условные обозначения	4
Типы данных	4
Документы ЭДО РТС в формате XML	5
Спецификация форматов отчетов.....	6
SPB03. Выписка из реестра договоров, заключенных Участником торгов.....	6
SPB03M. Реестр торговых договоров основной сессии	12
SPB21. Биржевая информация об итогах торгов	18
SPB82. Уведомление о клиентах участник торгов, зарегистрированных на бирже	25

Перечень изменений

Дата изменений	Версия формата	Описание изменений
08.12.2014	1	<ul style="list-style-type: none">Первая версия документаДобавлен отчет SPB03
01.03.2015	1	<ul style="list-style-type: none">Добавлен отчет SPB21
		<ul style="list-style-type: none">Изменены атрибуты в SPB21, расширен список значений в SPB03
		<ul style="list-style-type: none">Изменено описание полей SPB21
04.08.2015	2	<ul style="list-style-type: none">Добавлен отчет SPB03MИзменен формат отчета SPB21 в связи с приведением в соответствие с 437-ПДобавлен отчет SPB82
22.12.2015	3	<ul style="list-style-type: none">В отчет SPB21 добавлен атрибуты CurrencyId и CurrencyNameИзменен список режимов торгов и список групп инструментов
06.05.2016	3	<ul style="list-style-type: none">Отчеты SPB03, SPB03M<ul style="list-style-type: none">Добавлен атрибут SpecialPeriod

Форматы XML документов

Обмен информацией между клиентским и серверным приложениями происходит сообщениями в формате XML версии 1.0. Полная спецификация языка XML версии 1.0 приводится в документе Extensible Markup Language (XML) 1.0 (Second Edition), разработанном W3C и опубликованном в сети Интернет адресу <http://www.w3.org/TR/REC-xml>.

В главе приводится краткое описание структуры XML документа версии 1.0.

Пролог XML документа

Пролог XML документа предназначен для описания глобальных параметров XML документа, а также для передачи инструкций программе обработки данного документа. Пролог может содержать несколько инструкций, каждая из которых начинается с последовательности символов `<?` и заканчивается последовательностью символов `?>` Первой строкой пролога всегда идёт объявление XML с указанием кодировки символов, используемых в документе.

Пример пролога:

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>  
<?xml-stylesheet type='text/xsl' href='form_individual.xsl'?>
```

, где первая строка – это объявление XML с указанием используемой кодовой таблицы, вторая строка – инструкция программе обработки сообщения.

Ограничение: кодировка документа должна быть исключительно “UTF-8”.

Элементы XML документа

Каждый XML документ содержит один или несколько элементов, границы которых обозначаются либо парой начальный тэг (`<elem>`) - конечный тэг (`</elem>`), либо тэгом пустого элемента (`<elem />`), если элемент не имеет содержимого. Содержимым элемента называется текст между начальным и конечным тегами. Каждый элемент имеет определенный тип, который опознается по имени и называется "общим идентификатором" элемента. Тип элемента в конечном тэге должен соответствовать типу элемента в начальном тэге. Каждый элемент может иметь набор спецификаций атрибутов. Каждая спецификация атрибута имеет имя и значение. Имя атрибута в начальном тэге или тэге пустого элемента может присутствовать только один раз.

Пример непустого элемента без атрибутов:

```
<elem> содержание элемента </elem>
```

Пример пустого элемента с двумя атрибутами:

```
<elem attr1="значение атрибута 1" attr2="значение атрибута 2" />
```

Документ XML всегда содержит один единственный корневой элемент, который включает в себя любое число других элементов. Каждый элемент может содержать любое количество других элементов. Такие документы называются дочерними элементами по отношению к данному элементу.

Пример дочернего элемента:

```
<parent>
<child> содержание дочернего элемента </child>
</parent>
```

Атрибуты элементов XML документа

Каждый элемент может содержать любое количество атрибутов. Атрибуты предназначены для передачи дополнительной информации об элементе. Атрибуты могут располагаться только в начальных тегах и тегах пустых элементов сразу после имени элемента в виде пар атрибут – значение. Значения атрибутов не могут содержать символов левая угловая скобка (<), правая угловая скобка (>), амперсанд (&), апостроф (') и двойная кавычка ("). Данные символы кодируются последовательностями "<", ">", "&", "'", """ соответственно.

Пример пустого элемента с атрибутом:

```
<elem attr="значение атрибута" />
```

Условные обозначения

В таблицах, описывающих прикладные и служебные элементы, в колонке **М/О** символ **М** означает, что соответствующий атрибут или подэлемент является обязательным, а символ **О** – что необязательным. Если какой-либо элемент не указывается, то его атрибуты также не указываются, даже если помечены как обязательные.

В колонке **Rev** указывается номер версии спецификации отчетов, в котором введен в действие данный элемент/атрибут.

Типы данных

Тип	Описание
Integer	Целочисленное значение
Boolean	Логическое значение (True или False)
Numeric(M,N)	Вещественное значение с фиксированной точкой
Char	Один символ (символы кириллицы не допускаются)
String(M-N)	Строковое значение (символы кириллицы не допускаются) M-минимально допустимое число символов. Если не указано, то поле фиксированной длины N-максимально допустимое число символов

WString(M-N)	Строковое значение, включая символы кириллицы M-минимально допустимое число символов. Если не указано, то поле фиксированной длины N-максимально допустимое число символов
Date	Дата. Строка в формате: DD-MM-YYYY
Time	Время. Строка в формате: ss:hh:mm
DateTime	Дата и время. Строка в формате: DD-MM-YYYY ss:hh:mm

Документы ЭДО РТС в формате XML

Для сообщений системы электронного документооборота ЭДО РТС в формате XML корневой элемент имеет значение **RTS_DOC**

Каждое сообщение ЭДО РТС (включая отчеты МФБ) имеет следующую структуру

Название элемента	Название атрибута	Описание	М/О	Тип
RTS_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа	М	
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе	М	
	DOC_DATE	Дата формирования документа	М	Date
	DOC_TIME	Время формирования документа	М	Time
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе ЭДО	М	String(0-20)
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе ЭДО	М	String(0-20)
	SENDER_ID	Код ЭДО РТС отправителя	М	String(3-7)
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	О	WString(0-120)
	RECEIVER_ID	Код ЭДО РТС получателя	М	String(3-7)
	REMARKS	Текст примечания к документу	О	WString(0-120)
/DOC_REQUISITES			О	
< Идентификатор типа документа в системе ЭДО/>		Дочерний элемент, содержащий бизнес-данные документа	М	Элемент
/RTS_DOC		Корневой элемент	М	

Спецификация форматов отчетов

SPB03. Выписка из реестра договоров, заключенных Участником торгов

- Формируется по итогам торгового дня в 3-30
- Для РЕПО показывается обе части
- Включает договора основной и дополнительной сессии торгового дня

Название элемента	Название атрибута	Описание	M/O	Rev	Тип
RTS_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа	M	1	
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе	M	1	
	DOC_DATE	Дата формирования документа	M	1	Date
	DOC_TIME	Время формирования документа	M	1	Time
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в отчетной системе	M	1	String(0-20)
	DOC_TYPE_ID	Всегда SPB03	M	1	String(0-20)
	SENDER_ID	Код биржи в системе ЭДО	M	1	String(3-7)
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	O	1	WString(0-120)
	RECEIVER_ID	Код ЭДО получателя	M	1	String(3-7)
	REMARKS	Текст примечания к документу. Пустой документ содержит текст «На отчетную дату данных нет»	O	1	WString(0-120)
/DOC_REQUISITES			M	1	
SPB03		Блок данных отчета	M	1	
	ReportDate	Дата отчета	M	1	Date
	ReportDesc	Описание отчета	O	1	WString(0-128)
	ReportVersion	Версия формата отчета	O	1	String(1-3)
	Weekday	День недели для даты отчета	O	1	WString(0-20)
	FirmId	Идентификатор участника торгов	M	1	String(0-16)
	FirmName	Наименование участника торгов	M	1	WString(0-120)
	FirmINN	ИНН участника торгов	O	1	String(0-12)
CLRACC		Блок данных по ТКС	M	1	
	ClrAccCode	Код ТКС	M	1	String(0-12)
SUBCLRACC		Блок данных по подразделу ТКС (не указывается для договоров по основному ТКС)	O	1	

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/1 от 06.05.2016г.)

Название элемента	Название атрибута	Описание	М/О	Rev	Тип
	SubClrAccCode	Код подраздела ТКС	О	1	String(0-16)
CURRENCY		Блок данных по валюте котирования	М	1	
	CurrencyId	Идентификатор валюты котирования	М	1	String(0-4)
	CurrencyName	Наименование валюты котирования	О	1	WString(0-30)
BOARD		Блок данных по группе инструментов	М	1	
	BoardId	Идентификатор группы инструментов <ul style="list-style-type: none"> • EQR – Российские ЦБ • EQF – Иностранные ЦБ • BOND – Еврооблигации 	М	2	Integer
	BoardType	Номер группы инструментов <ul style="list-style-type: none"> • если EQR, то 1 • если EQF, то 2 • если EBOND, то 5 	О	2	String(0-15)
	BoardName	Наименование группы инструментов	О	1	WString(0-30)
SETTLEDATE		Блок данных по дате расчётов	М	1	
	SettleDate	Фактическая дата расчётов (дата исполнения)	М	1	Date
SECURITY		Блок данных по инструменту	М	1	
	SecurityId	Идентификатор инструмента	М	1	String(0-32)
	SecShortName	Краткое наименование инструмента	М	1	WString(0-64)
	ISIN	Международный идентификатор инструмента	О	1	String(0-20)
	RegNumber	Государственный регистрационный номер	О	1	WString(0-64)
	FaceValue	Номинал	О	1	Numeric(20,2)
	SecCurrencyId	Валюта номинала	О	1	String(0-3)
	SecurityType	Категория ЦБ: 101 - Акции обыкновенные 102 - Акции привилегированные 103 - Пай открытого ПИФ 104 - Пай закрытого ПИФ 105 - ETF 106 - RDR 107 - ADR 108 - GDR	О	1	Integer

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/1 от 06.05.2016г.)

Название элемента	Название атрибута	Описание	М/О	Rev	Тип
		109 - Пай интервального ПИФ 110 – Ипотечный Вексель (Mortgage Note) 201 - Государственные Облигации 202 - Муниципальные Облигации 203 – Облигации Центрального Банка 204 - Корпоративные Облигации 205 – Облигации Кредитной Организации 206 – Корзина Облигаций (ETF)			
	PriceType	CASH - цена указана в валюте расчета PERC - цена указана в процентах от номинала	М	1	String(0-4)
RECORDS		Блок данных по договору	М	1	
	RecNo	Номер по порядку в отчете	М	1	Integer
	TradeNo	Номер договора в Системе торгов	М	1	Integer
	TradeDate	Дата регистрации договора	М	1	Date
	TradeTime	Время регистрации договора в Системе торгов	М	1	Time
	TradePeriod	Торговая сессия <ul style="list-style-type: none"> • MAIN – Основная торговая сессия • EVE – Дополнительная торговая сессия (кроме аукциона закрытия) 	М	1	String(0-7)
	SpecialPeriod	Особые торговые периоды <ul style="list-style-type: none"> • CLOSE – Аукцион закрытия • EXTRA - Период дополнительной ликвидности 	О	3	String(0-7)
	OrderID	Идентификатор заявки, присвоенный биржей	О	1	Integer
	OrderType	Тип заявки <ul style="list-style-type: none"> • рыночная заявка (MARKET) = 1 • лимитная заявка (LIMIT) = 2 • скрытая заявка (HIDDEN) = 100 • заявка-айсберг (ICEBERG) = 101 • скрытая динамическая заявка (HIDDEN_DYNAMIC) = 102 • адресная (NEGOTIATED) = 103 • внеаукционная заявка (OUT-OF-BOOK) = 104 • котировочная заявка (PROTO-RFQ-INITIATE) = 125 	О	1	Integer

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/1 от 06.05.2016г.)

Название элемента	Название атрибута	Описание	М/О	Rev	Тип
		<ul style="list-style-type: none"> некотировочная заявка (PROTO-RFQ-CONFIRM) = 126 			
	UserId	Логин из заявки	O	1	String(0-16)
	Comment	Комментарий	O	1	WString(0-64)
	BuySell	Направленность заявки (покупка (B) / продажа (S))	M	1	Char
	TradeType	Тип договора: T – заключен на основании безадресной заявки N – заключен на основании адресной заявки D – заключен без подачи заявки	O	1	Char
	TradeInstrumentType	Тип торгового инструмента: 1 – фьючерсные инструменты 9 - инструменты с полным обеспечением 5 – связанные договора купли-продажи валюты 4 – репо 3 - инструменты с частичным обеспечением 2 – опционы	M	1	Integer
	TradeModelId	Режим торгов (номер режима) 1 - Режим основных торгов 2 - Режим переговорных сделок 3 - Режим торгов адресное репо 4 - Режим торгов Аукцион размещения 5 - Режим торгов Адресное размещение 6 - Режим торгов Аукцион по выкупу 7 - Режим торгов Адресный выкуп 8 - Режим торгов РПС без ЦК 9 - Режим торгов адресное репо без ЦК	M	2	Integer
	TradeModeName	Наименование режима торгов <ul style="list-style-type: none"> Режим основных торгов Режим переговорных сделок Режим торгов адресное репо Режим торгов Аукцион размещения Режим торгов Адресное размещение 	M	2	WString(0-64)

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/1 от 06.05.2016г.)

Название элемента	Название атрибута	Описание	М/О	Rev	Тип
		<ul style="list-style-type: none"> • Режим торгов Аукцион по выкупу • Режим торгов Адресный выкуп • Режим торгов РПС без ЦК • Режим торгов адресное репо без ЦК 			
	Decimals	Число значимых знаков после запятой в ценах	O	1	Integer
	Price	Цена за единицу инструмента	M	1	Numeric(20,6)
	Quantity	Объём договора, в лотах	M	1	Numeric(20,0)
	Value	Объём договора, в валюте котирования	M	1	Numeric(20,2)
	Amount	Обязательство по денежным средствам, в валюте котирования	M	1	Numeric(20,2)
	Balance	Обязательство по ценным бумагам	M	1	Numeric(20,0)
	ExchComm	Комиссионное вознаграждение за организацию торгов, в валюте котирования	O	1	Numeric(20,2)
	ClientDetails	ИНН или № паспорта клиента или иной код	O	1	WString(0-41)
	CcpCode	Код Центрального Контрагента («МФВМ» - КЦ МФБ)	O	1	String(0-16)
	CPFirmId	Идентификатор контрагента (только для адресных заявок)	O	1	String(0-16)
	CPFirmShortName	Краткое наименование контрагента (только для адресных заявок)	O	1	WString(0-256)
	OtcCodeInitiator	Идентификатор адресных договоров Участника торгов, подавшего Заявку (только для адресных заявок)	O	1	String(0-16)
	OtcCodeConfirmator	Идентификатор адресных договоров Участника торгов, которому адресована Заявка (только для адресных заявок)	O	1	String(0-16)
	ClientCode	Краткий код клиента или клиента субброкера	O	1	WString(0-16)
	Acclnt	Накопленный купонный доход, рассчитанный в соответствии с количеством актива договора, в валюте котирования	O	1	Numeric(20,2)
	Price2	Цена второй части РЕПО	O	1	Numeric(20,6)
	RepoRate	Ставка РЕПО	O	1	Integer
	RepoPart	Часть РЕПО 1 – первая часть договора РЕПО	O	1	Integer

Название элемента	Название атрибута	Описание	М/О	Rev	Тип
		2 – вторая часть договора РЕПО			
	RepoPeriod	Срок РЕПО в календарных днях	O	1	Integer
	Type	Тип договора, заключенной в целях урегулирования неисполнения обязательств или исполнения обязательств по договорам с частичным обеспечением: 1 – договор РЕПО в случае неисполнения обязательств Участником клиринга; 2 – договор купли-продажи в случае неисполнения обязательств Участником клиринга; 3 – договор РЕПО в случае неисполнения обязательств Клиринговым центром; 4 – договор купли-продажи в случае неисполнения обязательств Клиринговым центром; 5 – договор РЕПО, заключенный Клиринговым центром с целью привлечения активов для урегулирования неисполнения обязательств; 6 – договор купли-продажи, заключенный Клиринговым центром с целью принудительного закрытия позиции Участника клиринга; 7 – договор купли-продажи, заключенный в целях исполнения обязательств (договор, заключаемый в целях переноса позиции на другого организатора торгов); 9 – договор, заключенный в результате исполнения опционного контракта	O	1	Integer
/RECORDS			M	1	
/BOARD			M	1	
/SECURITY			M	1	
/SETTLEDATE			M	1	
/CURRENCY			M	1	
/SUBCLRACC			M	1	
/CLRACC			M	1	
/SPB03			M	1	
/RTS_DOC			M	1	

SPB03M. Реестр торговых договоров основной сессии

- Формируется по итогам основной сессии торгового дня
- Для РЕПО показываются обе части

Название элемента	Название атрибута	Описание	М/О	Rev	Тип
RTS_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа	М	1	
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе	М	1	
	DOC_DATE	Дата формирования документа	М	1	Date
	DOC_TIME	Время формирования документа	М	1	Time
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в отчетной системе	М	1	String(0-20)
	DOC_TYPE_ID	Всегда SPB03M	М	1	String(0-20)
	SENDER_ID	Код биржи в системе ЭДО	М	1	String(3-7)
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	О	1	WString(0-120)
	RECEIVER_ID	Код ЭДО получателя	М	1	String(3-7)
	REMARKS	Текст примечания к документу. Пустой документ содержит текст «На отчетную дату данных нет»	О	1	WString(0-120)
/DOC_REQUISITES			М	1	
SPB03M		Блок данных отчета	М	1	
	ReportDate	Дата отчета	М	1	Date
	ReportDesc	Описание отчета	О	1	WString(0-128)
	ReportVersion	Версия формата отчета	О	1	String(1-3)
	Weekday	День недели для даты отчета	О	1	WString(0-20)
	FirmId	Идентификатор участника торгов	М	1	String(0-16)
	FirmName	Наименование участника торгов	М	1	WString(0-120)
	FirmINN	ИНН участника торгов	О	1	String(0-12)
CLRACC		Блок данных по ТКС	М	1	
	ClrAccCode	Код ТКС	М	1	String(0-12)
SUBCLRACC		Блок данных по подразделу ТКС (не указывается для договоров по основному ТКС)	О	1	
	SubClrAccCode	Код подраздела ТКС	О	1	String(0-16)
CURRENCY		Блок данных по валюте котирования	М	1	
	CurrencyId	Идентификатор валюты котирования	М	1	String(0-4)

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/1 от 06.05.2016г.)

Название элемента	Название атрибута	Описание	М/О	Rev	Тип
	CurrencyName	Наименование валюты котирования	O	1	WString(0-30)
BOARD		Блок данных по группе инструментов	M	1	
	BoardId	Идентификатор группы инструментов <ul style="list-style-type: none"> • EQR – Российские ЦБ • EQF – Иностранные ЦБ • BOND – Еврооблигации 	M	1	Integer
	BoardType	Номер группы инструментов <ul style="list-style-type: none"> • если EQR, то 1 • если EQF, то 2 • если EBOND, то 5 	O	1	String(0-15)
	BoardName	Наименование группы инструментов	O	1	WString(0-30)
SETTLEDATE		Блок данных по дате расчётов	M	1	
	SettleDate	Фактическая дата расчётов (дата исполнения)	M	1	Date
SECURITY		Блок данных по инструменту	M	1	
	SecurityId	Идентификатор инструмента	M	1	String(0-32)
	SecShortName	Краткое наименование инструмента	M	1	WString(0-64)
	ISIN	Международный идентификатор инструмента	O	1	String(0-20)
	RegNumber	Государственный регистрационный номер	O	1	WString(0-64)
	FaceValue	Номинал	O	1	Numeric(20,2)
	SecCurrencyId	Валюта номинала	O	1	String(0-3)
	SecurityType	Категория ЦБ: 101 - Акции обыкновенные 102 - Акции привилегированные 103 - Пай открытого ПИФ 104 - Пай закрытого ПИФ 105 - ETF 106 - RDR 107 - ADR 108 - GDR 109 - Пай интервального ПИФ 110 – Ипотечный Вексель (Mortgage Note) 201 - Государственные Облигации	O	1	Integer

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/1 от 06.05.2016г.)

Название элемента	Название атрибута	Описание	М/О	Rev	Тип
		202 - Муниципальные Облигации 203 – Облигации Центрального Банка 204 - Корпоративные Облигации 205 – Облигации Кредитной Организации 206 – Корзина Облигаций (ETF)			
	PriceType	CASH - цена указана в валюте расчета PERC - цена указана в процентах от номинала	M	1	String(0-4)
RECORDS		Блок данных по договору	M	1	
	RecNo	Номер по порядку в отчете	M	1	Integer
	TradeNo	Номер договора в Системе торгов	M	1	Integer
	TradeDate	Дата регистрации договора	M	1	Date
	TradeTime	Время регистрации договора в Системе торгов	M	1	Time
	TradePeriod	Торговый период <ul style="list-style-type: none"> • Всегда MAIN - основной 	M	1	String(0-7)
	SpecialPeriod	Особые торговые периоды <ul style="list-style-type: none"> • CLOSE – Аукцион закрытия • EXTRA - Период дополнительной ликвидности 	O	3	String(0-7)
	OrderID	Идентификатор заявки, присвоенный биржей	O	1	Integer
	OrderType	Тип заявки <ul style="list-style-type: none"> • рыночная заявка (MARKET) = 1 • лимитная заявка (LIMIT) = 2 • скрытая заявка (HIDDEN) = 100 • заявка-айсберг (ICEBERG) = 101 • скрытая динамическая заявка (HIDDEN_DYNAMIC) = 102 • адресная (NEGOTIATED) = 103 • внеаукционная заявка (OUT-OF-BOOK) = 104 • котировочная заявка (PROTO-RFQ-INITIATE) = 125 • некотировочная заявка (PROTO-RFQ-CONFIRM) = 126 	O	1	Integer
	UserId	Логин из заявки	O	1	String(0-16)
	Comment	Комментарий	O	1	WString(0-64)
	BuySell	Направленность заявки (покупка (B) / продажа (S))	M	1	Char

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/1 от 06.05.2016г.)

Название элемента	Название атрибута	Описание	М/О	Rev	Тип
	TradeType	Тип договора: T – заключен на основании безадресной заявки N – заключен на основании адресной заявки D – заключен без подачи заявки	O	1	Char
	TradeInstrumentType	Тип торгового инструмента: 1 – фьючерсные инструменты 9 - инструменты с полным обеспечением 5 – связанные договора купли-продажи валюты 4 – репо 3 - инструменты с частичным обеспечением 2 – опционы	M	1	Integer
	TradeModelId	Режим торгов (номер режима) 1 - Режим основных торгов 2 - Режим переговорных сделок 3 - Режим торгов адресное репо 4 - Режим торгов Аукцион размещения 5 - Режим торгов Адресное размещение 6 - Режим торгов Аукцион по выкупу 7 - Режим торгов Адресный выкуп 8 - Режим торгов РПС без ЦК 9 - Режим торгов адресное репо без ЦК	M	1	Integer
	TradeModeName	Наименование режима торгов <ul style="list-style-type: none"> • Режим основных торгов • Режим переговорных сделок • Режим торгов адресное репо • Режим торгов Аукцион размещения • Режим торгов Адресное размещение • Режим торгов Аукцион по выкупу • Режим торгов Адресный выкуп • Режим торгов РПС без ЦК • Режим торгов адресное репо без ЦК 	M	1	WString(0-64)
	Decimals	Число значимых знаков после запятой в ценах	O	1	Integer
	Price	Цена за единицу инструмента	M	1	Numeric(20,6)

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/1 от 06.05.2016г.)

Название элемента	Название атрибута	Описание	М/О	Rev	Тип
	Quantity	Объём договора, в лотах	М	1	Numeric(20,0)
	Value	Объём договора, в валюте котирования	М	1	Numeric(20,2)
	Amount	Обязательство по денежным средствам, в валюте котирования	М	1	Numeric(20,2)
	Balance	Обязательство по ценным бумагам	М	1	Numeric(20,0)
	ExchComm	Комиссионное вознаграждение за организацию торгов, в валюте котирования	О	1	Numeric(20,2)
	ClientDetails	ИНН или № паспорта клиента или иной код	О	1	WString(0-41)
	CcpCode	Код Центрального Контрагента («МФВМ» - КЦ МФБ)	О	1	String(0-16)
	CPFirmId	Идентификатор контрагента (только для адресных заявок)	О	1	String(0-16)
	CPFirmShortName	Краткое наименование контрагента (только для адресных заявок)	О	1	WString(0-256)
	OtcCodeInitiator	Идентификатор адресных договоров Участника торгов, подавшего Заявку (только для адресных заявок)	О	1	String(0-16)
	OtcCodeConfirmator	Идентификатор адресных договоров Участника торгов, которому адресована Заявка (только для адресных заявок)	О	1	String(0-16)
	ClientCode	Краткий код клиента или клиента субброкера	О	1	WString(0-16)
	Acclnt	Накопленный купонный доход, рассчитанный в соответствии с количеством актива договора, в валюте котирования	О	1	Numeric(20,2)
	Price2	Цена второй части РЕПО	О	1	Numeric(20,6)
	RepoRate	Ставка РЕПО	О	1	Integer
	RepoPart	Часть РЕПО 1 – первая часть договора РЕПО 2 – вторая часть договора РЕПО	О	1	Integer
	RepoPeriod	Срок РЕПО в календарных днях	О	1	Integer
	Type	Тип договора, заключенной в целях урегулирования неисполнения обязательств или исполнения обязательств по договорам с частичным обеспечением: 1 – договор РЕПО в случае неисполнения обязательств Участником	О	1	Integer

Название элемента	Название атрибута	Описание	М/О	Rev	Тип
		клиринга; 2 – договор купли-продажи в случае неисполнения обязательств Участником клиринга; 3 – договор РЕПО в случае неисполнения обязательств Клиринговым центром; 4 – договор купли-продажи в случае неисполнения обязательств Клиринговым центром; 5 – договор РЕПО, заключенный Клиринговым центром с целью привлечения активов для урегулирования неисполнения обязательств; 6 – договор купли-продажи, заключенный Клиринговым центром с целью принудительного закрытия позиции Участника клиринга; 7 – договор купли-продажи, заключенный в целях исполнения обязательств (договор, заключаемый в целях переноса позиции на другого организатора торгов); 9 – договор, заключенный в результате исполнения опционного контракта			
/RECORDS			М	1	
/BOARD			М	1	
/SECURITY			М	1	
/SETTLEDATE			М	1	
/CURRENCY			М	1	
/SUBCLRACC			М	1	
/CLRACC			М	1	
/SPB03M			М	1	
/RTS_DOC			М	1	

SPB21. Биржевая информация об итогах торгов

- Формируется по итогам торгового дня одновременно с Отчетом о договорах, заключенных Участником торгов

Название элемента	Название атрибута	Описание	М/О	Rev	Тип
RTS_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа	М	1	
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе	М	1	
	DOC_DATE	Дата формирования документа	М	1	Date
	DOC_TIME	Время формирования документа	М	1	Time
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе ЭДО	М	1	String(0-20)
	DOC_TYPE_ID	Всегда SPB21	М	1	String(0-20)
	SENDER_ID	Всегда SPBXM	М	1	String(3-7)
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	О	1	WString(0-120)
	RECEIVER_ID	Код ЭДО РТС получателя	М	1	String(3-7)
	REMARKS	Текст примечания к документу	О	1	WString(0-120)
/DOC_REQUISITES			М	1	
SPB21		Блок данных отчета	М	1	
	TradeDate	Дата торгов			Date
	ReportDesc	Описание отчета	О	2	WString(0-128)
	ReportVersion	Версия формата отчета	О	2	String(1-3)
	Weekday	День недели для даты отчета	О	2	WString(0-20)
BOARD		Блок данных о секции	М	1	

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/1 от 06.05.2016г.)

Название элемента	Название атрибута	Описание	M/O	Rev	Тип
	BoardId	Идентификатор группы инструментов	M	1	Integer
	BoardType	Номер группы инструментов <ul style="list-style-type: none"> • если EQR, то 1 • если EQF, то 2 • если Commodity, то 3 • если CRCY_F, то 4 	O	1	String(0-15)
	BoardName	Наименование группы инструментов	O	1	WString(0-30)
SECURITY		Блок данных о ценной бумаге			
	SecurityId	Идентификатор (код) инструмента	M	1	String(0-32)
	SecShortName	Краткое наименование инструмента	M	1	WString(0-64)
	ISIN	Международный идентификатор инструмента (ISIN)	O	1	String(0-20)
	RegNumber	Государственный регистрационный номер выпуска	O	1	WString(0-64)
	FaceValue	Номинал	O	1	Numeric(20,2)
	SecCurrencyId	Валюта номинала инструмента	O	1	String(0-3)
	SecurityType	Вид и тип ЦБ: <ul style="list-style-type: none"> • Акции обыкновенные • Акции привилегированные • Пай открытого ПИФ • Пай закрытого ПИФ • ETF • RDR • ADR • GDR • Пай интервального ПИФ 	O	1	WString(0-128)

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/1 от 06.05.2016г.)

Название элемента	Название атрибута	Описание	M/O	Rev	Тип
		<ul style="list-style-type: none"> • Ипотечный Вексель • Государственные Облигации • Муниципальные Облигации • Облигации Центрального Банка • Корпоративные Облигации • Облигации Кредитной Организации • Корзина Облигаций (ETF) 			
	IssuerName	Наименование эмитента	O	1	WString(0-255)
	IssuerDetails	ИНН эмитента (управляющей компании)	O	1	String(0-32)
	QuoteList	Котировальный список	O	1	WString(0-64)
	Decimal	Число значимых знаков после запятой в ценах	O	1	Integer
	CurrencyId	Код валюты цены	M	2	String(3)
	CurrencyName	Наименование валюты цены	O	2	String(0-32)
TRADE_PERIOD		Блок данных о торговом периоде			
	TradePeriod	Торговый период <ul style="list-style-type: none"> • MAIN - основная торговая сессия • EVE - дополнительная торговая сессия 	M	1	String(0-4)
MARKET_TRADE		Блок данных о рыночных договорах	M	1	
	SettType	Код расчетов, установленный биржей	M	2	String(0-4)
	TradeMode	Наименование режима торгов	M	2	WString(0-32)
	PeriodTotalAmount	Общее количество ценных бумаг по заключенным договорам, шт.	M	1	Numeric(20,0)

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/1 от 06.05.2016г.)

Название элемента	Название атрибута	Описание	M/O	Rev	Тип
	PeriodTotalVolume	Общий объём договоров, валюта инструмента	M	1	Numeric(20,2)
	PeriodTotalCount	Общее количество заключенных договоров, шт	M	1	Numeric(20,0)
	PeriodOpenPrice	Первый договор, цена, валюта инструмента	M	1	Numeric(20,2)
	PeriodOpenVolume	Первый договор, объем, валюта инструмента	M	1	Numeric(20,2)
	PeriodLastPrice	Последний договор, цена, валюта инструмента	M	1	Numeric(20,2)
	PeriodLastVolume	Последний договор, объем, валюта инструмента	M	1	Numeric(20,2)
	PeriodCurrentPrice	Последняя текущая цена	M	1	Numeric(20,2)
	PeriodMaxDealPrice	Минимальная цена договора за период, валюта инструмента	O	2	Numeric(20,2)
	PeriodMinDealPrice	Максимальная цена договора за период, валюта инструмента	O	2	Numeric(20,2)
	PeriodWAPrice	Срневзвешенная цена, валюта инструмента	M	2	Numeric(20,2)
/MARKET_TRADE				1	
ADDRESS_TRADE		Блок данных об адресных договорах	M	1	
	SettType	Код расчетов, установленный биржей	M	2	String(0-4)
	TradeMode	Наименование режима торгов	M	2	WString(0-32)
	AddressPeriodTotalAmount	Общее количество ценных бумаг по заключенным договорам, шт.	M	1	Numeric(20,0)
	AddressPeriodTotalVolume	Общий объём договоров, валюта инструмента	M	1	Numeric(20,2)
	AddressPeriodTotalCount	Общее количество заключенных договоров, шт	M	1	Numeric(20,0)

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/1 от 06.05.2016г.)

Название элемента	Название атрибута	Описание	M/O	Rev	Тип
	AddressPeriodOpenPrice	Первый договор, цена, валюта инструмента	M	1	Numeric(20,2)
	AddressPeriodOpenVolume	Первый договор, объем, валюта инструмента	M	1	Numeric(20,2)
	AddressPeriodLastPrice	Последний договор, цена, валюта инструмента	M	1	Numeric(20,2)
	AddressPeriodLastVolume	Последний договор, объем, валюта инструмента	M	1	Numeric(20,2)
	AddressPeriodCurrentPrice	Последняя текущая цена	M	1	Numeric(20,2)
	AddressPeriodMaxDealPrice	Минимальная цена договора за период, валюта инструмента	O	2	Numeric(20,2)
	AddressPeriodMinDealPrice	Максимальная цена договора за период, валюта инструмента	O	2	Numeric(20,2)
	AddressPeriodWAPrice	Срневзвешенная цена, валюта инструмента	M	2	Numeric(20,2)
/ADDRESS_TRADE				1	
/TRADE_PERIOD				1	
RESULT		Блок данных об итоговых ценах	M	1	
	TotalAmount	Общее количество ценных бумаг по заключенным договорам, шт.	O	1	Numeric(20,0)
	TotalVolume	Общий объём договоров, валюта инструмента	O	1	Numeric(20,2)
	MaxDealPrice	Минимальная цена договоров за день, валюта инструмента	O	1	Numeric(20,2)
	MinDealPrice	Максимальная цена договоров за день, валюта инструмента	O	1	Numeric(20,2)

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/1 от 06.05.2016г.)

Название элемента	Название атрибута	Описание	M/O	Rev	Тип
	ClosePrice	Цена закрытия торгового дня, валюта инструмента	M	1	Numeric(20,2)
	PrevClose	Цена закрытия предыдущего торгового дня, валюта инструмента	O	1	Numeric(20,2)
	TrendClose	Изменение цены закрытия торгового дня по сравнению с ценой закрытия предыдущего торгового дня, %	O	1	Numeric(20,2)
	WAPrice	Средневзвешенная цена, валюта инструмента	O	1	Numeric(20,2)
	CurrentPrice	Текущая цена, валюта инструмента	M	1	Numeric(20,2)
	AdmittedQuote	Признаваемая котировка, валюта инструмента	O	1	Numeric(20,2)
	AdmittedQuoteVolume	Объем договоров для расчета признаваемой котировки, валюта инструмента	O	1	Numeric(20,2)
	MarketPrice2	Рыночная цена (2), валюта инструмента	O	1	Numeric(20,2)
	MP2Volume	Объем договоров для расчета рыночной цены (2), валюта инструмента	O	1	Numeric(20,2)
	MarketPrice3	Рыночная цена (3), валюта инструмента	O	1	Numeric(20,2)
	MP3Volume	Объем договоров для расчета рыночной цены (3), валюта инструмента	O	1	Numeric(20,2)
/RESULT					
/SECURITY					
/BOARD					
/SPB21					

УТВЕРЖДЕНЫ

Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/1 от 06.05.2016г.)

SPB82. Уведомление о клиентах участник торгов, зарегистрированных на бирже

- текущая версия 1
- Отчет предназначен для информирования о зарегистрированных на бирже СПБ клиентах Участников Торгов и их реквизитах
- Отчет формируется однократно в конце торгового дня от лица биржи
- Отчет направляется Участникам Торгов
- В отчет включаются только клиенты, по которым произошли изменения в прошедший торговый день

Название элемента	Название атрибута	Описание	M/O	Rev	Тип
RTS_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа.		1	
DOC_REQUISITES		Блок информации о документе		1	
	DOC_DATE	Дата формирования файла	O	1	Date
	DOC_TIME	Время формирования файла	O	1	Time
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	O	1	Character
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	O	1	Character
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	O	1	Character
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	O	1	Character
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	O	1	Character
	REMARKS	Текст примечания к файлу	O	1	Character
/DOC_REQUISITES				1	
SPB82		Блок данных отчета		1	

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/1 от 06.05.2016г.)

Название элемента	Название атрибута	Описание	M/O	Rev	Тип
	ReportDate	Мта отчета	M	1	Date
	ReportDesc	Описание отчета	O	1	Character
	ReportVersion	Версия отчета	O	1	Character
	Weekday	День недели даты отчета	O	1	Character
FIRM		Блок данных по участнику торгов	M	1	
	FirmID	Идентификатор участника торгов	M	1	Character
	FirmName	Краткое наименование участника торгов	M	1	Character
	FirmDetails	Реквизиты УТ	M	1	Character
RECORDS		Блок данных о клиентах участников торгов		1	
	ClientCode	Краткий код клиента УТ (клиента второго уровня)	M	1	Character
	Type	Тип клиента УТ (клиента второго уровня)	M	1	Character
	Details	Реквизиты клиента УТ (клиента второго уровня)	M	1	Character
	CountryCode	Код страны клиента УТ (клиента второго уровня)	O	1	Character
	RegulatorCode	Идентификатор клиента в соответствии с Положением №437-П	M	1	Character
	Q_Investor	Признак квалифицированного инвестора: Y – Является квалифицированным инвестором N – Не является квалифицированным инвестором	O	1	Character

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/1 от 06.05.2016г.)

Название элемента	Название атрибута	Описание	M/O	Rev	Тип
	Status	Статус клиента A - добавлен сегодня U – изменен сегодня D - удален сегодня	M	1	Character
	CheckCrossMarket	Признак разрешения на совершение кросс-маркетных сделок: N – не допускается совершение кросс-маркетных сделок Y – допускается совершение кросс-маркетных сделок	O	1	Character
	IndividualInvestmentAccount	Признак ИИС: Y – с клиентом заключен договор о ведении ИИС N – с клиентом не заключен договор о ведении ИИС	O	1	Character
/RECORDS					
/FIRM					
/SPB82					
/RTS_DOC					