

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	13
SPB21. Биржевая информация об итогах торгов	19
SPB82. Уведомление о клиентах участник торгов, зарегистрированных на бирже	26

Перечень изменений

Дата изменений	Версия формата	Описание изменений
08.12.2014	1	<ul style="list-style-type: none"> Первая версия документа Добавлен 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 SPB03M Изменен формат отчета SPB21 в связи с приведением в соответствие с 437-П Добавлен отчет SPB82
22.12.2015	3	<ul style="list-style-type: none"> В отчет SPB21 добавлен атрибуты CurrencyId и CurrencyName Изменен список режимов торгов и список групп инструментов
06.05.2016	3	<ul style="list-style-type: none"> Отчеты SPB03, SPB03M Добавлен атрибут SpecialPeriod
10.05.2016	3	<ul style="list-style-type: none"> Отчеты SPB03, SPB03M <ul style="list-style-type: none"> Добавлен атрибут IsMM

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-ММ-YYYY
Time	Время. Строка в формате: ss:hh:mm
DateTime	Дата и время. Строка в формате: DD-ММ-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 показываются обе части
- Включает договора основной и дополнительной сессии торгового дня

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 SPB03	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	
SPB03		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	

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/2 от 10.05.2016г.)

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 № 42/2 от 10.05.2016г.)

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-INITIATE) = 125 	О	1	Integer

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/2 от 10.05.2016г.)

Название элемента	Название атрибута	Описание	М/О	Rev	Тип
		<ul style="list-style-type: none"> некотировочная заявка (PROTO-CONFIRM) = 126 			
	UserId	Логин из заявки	O	1	String(0-16)
	Comment	Комментарий	O	1	WString(0-64)
	IsMM	Признак маркет-мейкерской заявки <ul style="list-style-type: none"> Y – маркет-мейкерская заявка N – немаркет-мейкерская заявка 	O	3	Char
	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 	M	2	WString(0-64)

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/2 от 10.05.2016г.)

Название элемента	Название атрибута	Описание	М/О	Rev	Тип
		<ul style="list-style-type: none"> • 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 			
	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

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/2 от 10.05.2016г.)

Название элемента	Название атрибута	Описание	М/О	Rev	Тип
	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 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	О	1	Integer
/RECORDS			М	1	
/BOARD			М	1	
/SECURITY			М	1	
/SETTLEDATE			М	1	
/CURRENCY			М	1	
/SUBCLRACC			М	1	
/CLRACC			М	1	
/SPB03			М	1	
/RTS_DOC			М	1	

УТВЕРЖДЕНЫ

Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/2 от 10.05.2016г.)

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 № 42/2 от 10.05.2016г.)

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 № 42/2 от 10.05.2016г.)

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-INITIATE) = 125 • некотировочная заявка (PROTO-CONFIRM) = 126 	O	1	Integer
	UserId	Логин из заявки	O	1	String(0-16)
	Comment	Комментарий	O	1	WString(0-64)
	IsMM	Признак маркет-мейкерской заявки <ul style="list-style-type: none"> • Y – маркет-мейкерская заявка 	O	3	Char

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/2 от 10.05.2016г.)

Название элемента	Название атрибута	Описание	M/O	Rev	Тип
		<ul style="list-style-type: none"> N – немаркет-мейкерская заявка 			
	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	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

УТВЕРЖДЕНЫ
Генеральным директором ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (приказ № 42/2 от 10.05.2016г.)

Название элемента	Название атрибута	Описание	М/О	Rev	Тип
	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 2 – вторая часть договора РЕПО	O	1	Integer
	RepoPeriod	Срок РЕПО в календарных днях	O	1	Integer
	Type	Тип договора, заключенной в целях урегулирования неисполнения обязательств или исполнения	O	1	Integer

Название элемента	Название атрибута	Описание	М/О	Rev	Тип
		<p>обязательств по договорам с частичным обеспечением:</p> <p>1 – договор РЕПО в случае неисполнения обязательств Участником клиринга;</p> <p>2 – договор купли-продажи в случае неисполнения обязательств Участником клиринга;</p> <p>3 – договор РЕПО в случае неисполнения обязательств Клиринговым центром;</p> <p>4 – договор купли-продажи в случае неисполнения обязательств Клиринговым центром;</p> <p>5 – договор РЕПО, заключенный Клиринговым центром с целью привлечения активов для урегулирования неисполнения обязательств;</p> <p>6 – договор купли-продажи, заключенный Клиринговым центром с целью принудительного закрытия позиции Участника клиринга;</p> <p>7 – договор купли-продажи, заключенный в целях исполнения обязательств (договор, заключаемый в целях переноса позиции на другого организатора торгов);</p> <p>9 – договор, заключенный в результате исполнения опционного контракта</p>			
/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 № 42/2 от 10.05.2016г.)

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 № 42/2 от 10.05.2016г.)

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 № 42/2 от 10.05.2016г.)

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 № 42/2 от 10.05.2016г.)

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 № 42/2 от 10.05.2016г.)

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 № 42/2 от 10.05.2016г.)

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 № 42/2 от 10.05.2016г.)

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 № 42/2 от 10.05.2016г.)

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					