

Описание формата отчетов в виде табулированных файлов

Общие замечания по форматам сообщений

- Разделителем полей является символ табуляции
- Строка с заголовками столбцов не передается
- Разделителем для дробной части является точка
- Формат даты: YYYY-MM-DD
- Формат времени: HH:MM:SS:mmm
- 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_<FIRM CODE>_YYYY-MM-DD.txt

Наименование поля	Тип поля	Размер	Описание	М/О
ACTION	Текстовый	16	Тип заявки Возможные значения <ul style="list-style-type: none">• New - Новая заявка• Exec - Заключение сделки на основании заявки• Cancel - Заявка отозвана/удалена	М
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
REG_NO	Числовой	20.0	Идентификационный номер заявки, присвоенный организатором торговли в момент ее регистрации в реестре заявок	М
ENTRY_DATE	Дата/время	YYYY-MM-DD	Дата регистрации заявки в торговой системе	М

ENTRY_TIME	Дата/время	HH:MM:SS:mmm	Время регистрации заявки в торговой системе	M
FIRMID	Текстовый	12	Дополнительный код Участника Торгов, присвоенный организатором торгов (код РТС)	M
FIRMCODE	Текстовый	64	Код участника торгов согласно положению ЦБ 437-П	M
CLIENT_CODEID	Текстовый	128	Идентификатор (код) клиента (клиента второго уровня) участника торгов	M
CLIENT_ALIAS	Текстовый	12	Дополнительный код, присвоенный организатором торгов, идентифицирующий клиента участника торгов (клиента второго уровня)	M
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	O
LOGIN	Текстовый	16	Логин трейдера, объявившего заявку	O
TRD_ACCID	Текстовый	12	Номер торгово-клирингового счета, в счет которого поставлена данная заявка	O
CP_FIRMID	Текстовый	12	Дополнительный код Участника Торгов фирмы-контрагента, присвоенный организатором торгов Не заполняется для безадресных заявок	O
CP_FIRMCODE	Текстовый	64	Код Участника Торгов-контрагента согласно положению ЦБ 437-П Не заполняется для безадресных заявок	O
ADDRESS_CODE	Текстовый	12	Идентификатор адресных сделок, присвоенный Участнику торгов, подавшему Заявку Не заполняется для безадресных заявок	O
CP_ADDRESS_CODE	Текстовый	12	Идентификатор адресных сделок, присвоенный Участнику торгов, которому адресована Заявка Не заполняется для безадресных заявок	O
BUY_SELL	Текстовый	1	Направленность заявки Возможные значения <ul style="list-style-type: none"> • В- покупка • S- продажа 	M
ORDER_TYPE	Текстовый	16	Тип заявки Возможные значения <ul style="list-style-type: none"> • рыночная заявка = 1 • лимитная заявка = 2 • скрытая заявка = 100 • заявка-айсберг = 101 • скрытая динамическая заявка = 102 • адресная = 103 • заявка аукциона закрытия = 123 	M

			<ul style="list-style-type: none"> • оффсетная заявка = 124 • котировочная заявка = 125 • некотировочная заявка = 126 • специальная = 127 	
IS_ADDRESS	Текстовый	8	Признак адресности заявки Возможные значения <ul style="list-style-type: none"> • ADDRESS – Адресная заявка • AUCTION – Безадресная заявка 	M
IS_MM	Текстовый	1	Признак заявки маркет-мейкера Возможные значения <ul style="list-style-type: none"> • Y - заявка маркет-мейкера • N - заявка не маркет-мейкера 	M
SECURITYID	Текстовый	12	Идентификационный код ценной бумаги	M
TRADE_MODE	Текстовый	16	Режим торгов Возможные значения <ul style="list-style-type: none"> • MAIN - Режим основных торгов • ADDRESS - Режим переговорных сделок • ADDRESS_REPO - Режим торгов адресное репо • NONADDRESS_REPO - Режим торгов адресное репо • RFQ - Режим торгов RFQ • ADDRESS_IPO - Режим торгов Адресное размещение 	M
TRADE_PERIOD	Текстовый	5	Торговая сессия Возможные значения <ul style="list-style-type: none"> • MAIN - Основная торговая сессия • EVE - Дополнительная торговая сессия 	M
QUOTE_CURRENCY	Текстовый	3	Символьный код валюты цены в заявке Для облигаций указывается PCT - процент от непогашенного номинала облигации	M
CURRENCY	Текстовый	3	Символьный код валюты платежа по инструменту	M
PRICE	Числовой	26.8	Цена одной ценной бумаги, цена первой части сделки РЕПО	O
REPO_PRICE	Числовой	26.8	Ставка РЕПО в отношении Договоров РЕПО	O
QUANTITY	Числовой	26.0	Объем заявки (начальный объем заявки), в единицах	M
QUANTITY_LOT	Числовой	26.0	Объем заявки (начальный объем заявки) , в лотах	M
QUANTITY_REST	Числовой	26.0	Объем оставшейся активной заявки, в единицах	O
QUANTITY_LOT_REST	Числовой	26.0	Объем оставшейся активной заявки, в лотах	O

VOLUME	Числовой	26.2	Объем заявки (первой части сделки РЕПО) в валюте цены	О
STATUS	Текстовый	32	<p>Результат объявления заявки</p> <p>Возможные значения</p> <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 	М
STATUS_REASON	Текстовый	32	<p>Причина отзыва/удаления заявки</p> <p>Возможные значения</p> <ul style="list-style-type: none"> • USER_CANCEL - запрос пользователя • USER_MASS_CANCEL - запрос пользователя на массовое снятие • BROKER_CANCEL - снято брокером • BROKER_MASS_CANCEL - снято брокером в режиме массового снятия • DISCONNECT - снято автоматически в результате потери соединения • EXPIRED - заявка GTD снята при наступлении времени снятия заявки • SESSION - снято торговой системой при наступлении сессионных событий снятия заявки • OPERATOR - снято оператором • EXPIRED_NOTRADES - снятие остатка заявки в результате отсутствия • EXPIRED_CROSSTRADING • 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 • LM_NOTENOUGHDEPOSIT - заявка сервиса ограниченного обеспечения снята биржей • CANCEL_FOR_RFQ - заявка снята для исполнения в режиме RFQ 	М
AMEND_DATE	Дата	YYYY-MM-DD	Дата отмены/изменения заявки в торговой системе	О
AMEND_TIME	Время	HH:MM:SS:mmm	Время отмены/изменения заявки в торговой системе	О
ISSUE_DATE	Дата	YYYY-MM-DD	Дата исполнения заявки в торговой системе	О
ISSUE_TIME	Время	HH:MM:SS	Время исполнения заявки в торговой системе	О
MATCH_REF	Текстовый	12	Дополнительный идентификатор адресной заявки	О

NUM_TRADES	Числовой	20.0	Количество договоров, заключенных на основании поданной заявки	O
SETT_TYPE	Текстовый	16	Код срока расчетов, установленный биржей	M
SPECIAL_PERIOD	Текстовый	255	Дополнительный период Возможные значения <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
CL_ORDERID	Текстовый	256	Клиентский номер заявки	O
EXTRA_REF	Текстовый	4	Дополнительный числовой номер заявки	O
COMMENT	Текстовый	24	Комментарий к заявке	O
TIME_IN_FORCE	Текстовый	8	Время жизни заявки Возможные значения <ul style="list-style-type: none"> • DAY - заявка актуальна до конца основного торгового дня • GTC - заявка актуальна до момента снятия • GTD - заявка актуальна до момента времени, указанного в date_expire. В случае снятия в конце сессии будет перевыставлена с новым order_id и старыми остальными параметрами. • IOC - свести сколько сводится, остаток снять • FOK - свести полностью или не ставить вообще • XN - заявка актуальна до конца торгового дня, включая часы расширенных торгов • OC - On Close • OO - On Open 	M

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:
 - REJECT_[EX|RE]_<FIRM CODE>_YYYY-MM-DD.txt

Наименование поля	Тип поля	Размер	Описание	М/О
ACTION	Текстовый	16	Тип заявки или уведомления <ul style="list-style-type: none"> • New • Cancel 	М
ORDERNO	Числовой	20.0	Регистрационный номер заявки	М
CL_ORDERID	Текстовый	256	Идентификатор заявки, указанный клиентом	О
REJECT_DATE	Дата/время	YYYY-MM-DD	Дата отказа в приеме заявки	М
REJECT_TIME	Дата/время	HH:MM:SS:mmm	Время отказа в приеме заявки	М
FIRMID	Текстовый	12	Дополнительный код Участника Торгов, присвоенный организатором торгов	О
FIRMCODE	Текстовый	64	Код участника торгов согласно положению ЦБ 437-П	О
CLIENT_CODEID	Текстовый	128	Код клиента (клиента второго уровня) согласно положению ЦБ 437-П	О
CLIENT_ALIAS	Текстовый	12	Дополнительный код, присвоенный организатором торгов, идентифицирующий клиента участника торгов (клиента второго уровня)	О
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
LOGIN	Текстовый	16	Логин трейдера	О
TRD_ACCID	Текстовый	12	Номер торгово-клирингового счета, в счет которого поставлена данная заявка	О
BUY_SELL	Текстовый	1	Направленность заявки <ul style="list-style-type: none"> • B- покупка • S- продажа 	О

ORDERTYPE	Текстовый	16	<p>Тип заявки Возможные значения</p> <ul style="list-style-type: none"> • рыночная заявка = 1 • лимитная заявка = 2 • скрытая заявка = 100 • заявка-айсберг = 101 • скрытая динамическая заявка = 102 • адресная = 103 • заявка аукциона закрытия = 123 • оффсетная заявка = 124 • котировочная заявка = 125 • некотировочная заявка = 126 • специальная = 127 	О
IS_ADDRESS	Текстовый	8	<p>Признак адресности заявки</p> <ul style="list-style-type: none"> • ADDRESS • AUCTION 	О
IS_MM	Текстовый	1	<p>Признак заявки маркет-мейкера</p> <ul style="list-style-type: none"> • Y • N 	М
SECURITYID	Текстовый	12	Базовый актив торгового инструмента	О
TRADE_MODE	Текстовый	12	<p>Наименование режима торгов</p> <ul style="list-style-type: none"> • MAIN Режим основных торгов • ADDRESS - Режим переговорных сделок • REPO Режим адресное или безадресное репо 	О

TRADE_PERIOD	Текстовый	5	Период торгов <ul style="list-style-type: none"> • MAIN - Основная торговая сессия • EVE - Дополнительная торговая сессия 	M
QUOTE_CURRENCY	Текстовый	3	Символьный код валюты цены в заявке. Для облигаций указывается PCT - процент от непогашенного номинала облигации	O
CURRENCY	Текстовый	3	Символьный код валюты платежа по инструменту	O
PRICE	Числовой	26.8	Цена за одну ценную бумагу, цена первой части сделки РЕПО	O
REPO_PRICE	Числовой	26.8	Ставка РЕПО	O
QUANTITY	Числовой	26.2	Объём заявки или сделки, в единицах ЦБ	O
QUANTITY_LOT	Числовой	26.0	Объём заявки (начальный объём заявки) , в лотах	O
VOLUME	Числовой	26.2	Объём заявки в валюте платежа	O
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
MATCH_REF	Текстовый	12	Поле «Ссылка»	O
SETT_TYPE	Текстовый	16	Код срока расчетов, установленный биржей	O
COMMENT	Текстовый	24	Комментарий к заявке	O