

Описание состава и формата данных реестров заявок и сделок

Акции, Облигации, Валютный рынок

В реестрах приводится информация о заявках и сделках за архивный период для каждого инструмента по основному режиму (board) торгов¹.

Реестры содержат данные по основной (дневной) торговой сессии².

Данные предоставляются в формате TXT (CSV - структура файла).

Full Orders Log (тип A)

В реестрах приводится информация обо всех сделках и всех заявках

Спецификация формата данных

Наименование поля	Тип	Описание
NO	<i>Int</i>	Номер записи
SECCODE	<i>String</i>	Код инструмента
BUYSELL ³	<i>Char</i>	Признак купли/продажи
		B= Купить
		S= Продать
TIME ⁴	<i>LongInt</i>	Время в формате HHMMSSZZZXXX с марта 2016
		Время в формате HHMMSSZZZ до марта 2016
ORDERNO	<i>Int</i>	Номер заявки
ACTION	<i>Byte</i>	Тип события:
		0=Снятие заявки
		1=Постановка заявки
2=Сделка		
PRICE ⁵	<i>Float</i>	Цена заявки
VOLUME	<i>Int</i>	Объем
		Для action=1 – видимый объем поставленной заявки
		Для action=2 – объем сделки
		Для action=0 – остаток видимой части заявки

¹ Информацию о том, какой режим является для инструмента основным, можно увидеть в ИСС <https://iss.moex.com/iss/securities/{SECCODE}> в разделе **boards** в поле **is_primary**.

² Справочно доступны данные по дополнительным утренней и вечерней торговой сессии, дополнительной сессии выходного дня, которые могут быть неполными или требовать уточнения, что связано с этапами запуска дополнительных торговых сессий и особенностями формирования архивных файлов в историческом периоде. Биржа не несет ответственности за возможные последствия, возникшие вследствие использования указанных данных без дополнительной верификации (проверки)

³ Значения параметра направленности сделок Buy/Sell доступны с Января 2011г.

⁴ Время (TIME) с точностью до микросекунд с марта 2016 года. До марта 2016 года время в миллисекундах.

⁵ Нулевое значение параметра ЦЕНА (PRICE) означает "рыночную" заявку, которая исполняется лучшей встречной заявкой/заявками, имеющимися в торговой системе на тот момент времени:

4,TGKI,B,103000000,4,1,0,40000000,,

Следующие поля заполняются только для сделок (ACTION=2)		
Наименование поля	Тип	Описание
TRADENO	<i>Int</i>	Номер сделки
TRADEPRICE	<i>Float</i>	Цена сделки

Пример данных Full Orders Log (тип A)

NO	SECCODE	BUYSELL	TIME	ORDERNO	ACTION	PRICE	VOLUME	TRADENO	TRADEPRICE
30818	LSRG	S	100000429850	30789	2	574.9	10	1961689585	575
30819	NLMK	B	100000430356	30790	1	63.21	1780		
30820	ELTZ	S	100000435125	25211	0	824.6	150		

Данные по одному инструменту

Данные по одному инструменту формируются фильтрацией общего реестра (см. Спецификация формата данных Full Orders Log (тип A)) по конкретному инструменту.

Поле «NO» в данном случае представляет номер записи в общем реестре по рынку – и таким образом не является непрерывной последовательностью.

Пример данных Full Orders Log (тип A) – фильтрация по инструменту GAZP

NO	SECCODE	BUYSELL	TIME	ORDERNO	ACTION	PRICE	VOLUME	TRADENO	TRADEPRICE
151014	GAZP	S	70007839855	77592	1	253.7	1000		
151095	GAZP	S	70007846089	77633	1	0	1000		
151096	GAZP	S	70007846089	77633	0	0	1000		
151232	GAZP	B	70007875267	77699	1	0	5000		
151233	GAZP	B	70007875267	77699	2	0	1000	5032996442	253.4
151234	GAZP	S	70007875267	77486	2	253.4	1000	5032996442	253.4

Top of the Book (тип B)

В реестрах приводится информация обо всех сделках и о лучших на каждый момент времени заявках (по одной – лучшей – заявке на покупку и по одной – лучшей – заявке на продажу).

Спецификация формата данных

Наименование поля	Тип	Описание
SECCODE	<i>String</i>	Код инструмента
BUYSELL ¹	<i>Char</i>	Признак купли/продажи B= Купить S= Продать
TIME ²	<i>LongInt</i>	Время в формате HHMMSSZZZXXX с марта 2016 Время в формате HHMMSSZZZ до марта 2016
TRADENO	<i>Int</i>	Номер сделки (заполняется только для сделок)
PRICE	<i>Float</i>	Лучшая котировка (для сделок - цена сделки)
VOLUME	<i>Int</i>	Суммарный объём по лучшей котировке (для сделок - объём сделки)

¹ Значения параметра направленности сделок Buy/Sell доступны с Января 2011г.

² Время (TIME) с точностью до микросекунд с марта 2016 года. До марта 2016 года время в миллисекундах

Пример данных Top of the Book (тип B)

SECCODE	BUYSELL	TIME	TRADENO	PRICE	VOLUME
SBER	S	100000429324		96.47	300
SBER	S	100000430955		96.41	1500
GAZP	B	100000435233	25211	147.56	450

Данные по одному инструменту

Данные по одному инструменту формируются фильтрацией общего реестра (см. Спецификация формата данных Top of the Book (тип B)) по конкретному инструменту.

Срочный рынок

Данные предоставляются в формате сжатого CSV файла.

Full Orders Log (тип A)

В реестрах приводится информация обо всех сделках и всех заявках

Спецификация формата данных

Наименование	Тип	Описание
SYMBOL	<i>String</i>	Код инструмента
SYSTEM	<i>Char</i>	Идентификатор рынка: F- фьючерсы, C(P)- call(put) опционы
TYPE	<i>Char</i>	Тип заявки (B -купить/ S - продать)
MOMENT	<i>LongInt</i>	Дата и Время события YYYYMMDDHHMMSSZZZ
ID	<i>Int</i>	Номер заявки
ACTION	<i>Byte</i>	Статус заявки (0-снята, 1-добавлена, 2-закрыта сделкой)
PRICE	<i>Float</i>	Цена заявки
VOLUME	<i>Int</i>	Объём заявки (в контрактах, в шт.бумаг)
ледующие поля заполняются только для сделок (ACTION=2)		
ID_DEAL	<i>Int</i>	Номер сделки, закрывшей заявку
PRICE_DEAL	<i>Float</i>	Цена сделки

Пример данных Full Orders Log (тип A)

SYMBOL	SYSTEM	TYPE	MOMENT	ID	ACTION	PRICE	VOLUME	ID_DEAL	PRICE_DEAL
RIM1	F	B	20110531190000900	4000649468	0	188030	2		
SRM1	F	S	20110531190000956	4000649496	1	9807	20		
SRM1	F	B	20110531190002130	4000649487	2	9777	3	327626573	9777

Данные по одному инструменту

Данные по одному инструменту формируются фильтрацией общего реестра (см. Спецификация формата данных Full Orders Log (тип A)) по конкретному инструменту.

Top of the Book (тип B)

В реестрах приводится информация обо всех сделках и о лучших на каждый момент времени заявках (по одной – лучшей – заявке на покупку и по одной – лучшей – заявке на продажу). Спецификация формата данных

Наименование	Тип	Описание
SYMBOL	<i>String</i>	Код инструмента
SYSTEM	<i>Char</i>	Тип инструмента: F- фьючерсы, C(P)- call(put) опционы
TYPE	<i>Char</i>	Направление Buy/Sell (B - на купить, S - на продажу)
MOMENT	<i>LongInt</i>	Дата и Время YYYYMMDDHHMMSSZZ
ID_DEAL	<i>Int</i>	Номер сделки
PRICE	<i>Float</i>	Лучшая котировка (для сделок - цена сделки)
VOLUME	<i>Int</i>	Суммарный объём по лучшей котировке (для сделок - объём сделки)

Пример данных Top of the Book (тип B)

SYMBOL	SYSTEM	TYPE	MOMENT	ID_DEAL	PRICE	VOLUME
RIM1	F	B	20110531190000913	188030	2000	
SRM1	F	S	20110531190001900	9807	120	
SRM1	F	B	20110531190002345	327626573	9807	30

Данные по одному инструменту

Данные по одному инструменту формируются фильтрацией общего реестра (см. Спецификация формата данных Top of the Book (тип B)) по конкретному инструменту.

Trades - сделки с информацией об открытых позициях

Наименование	Тип	Описание
SYMBOL	<i>String</i>	Код инструмента
SYSTEM	<i>Char</i>	Идентификатор рынка (борда): F- фьючерсы, C(P)- call(put) опционы
MOMENT	<i>LongInt</i>	Время заключения сделки
ID_DEAL	<i>Int</i>	Номер сделки
PRICE_DEAL	<i>Float</i>	Цена сделки
VOLUME	<i>Int</i>	Объём сделки
OPEN_POS	<i>Int</i>	Количество открытых позиций (в контрактах)
DIRECTION	<i>Char</i>	Направление сделки (сделка закрыта по заявке "купить" или по заявке "продать")

Данные Trades являются дополнением к данным Full Orders Log (Тип A) и Top of the Book (Тип B) для Срочного рынка.