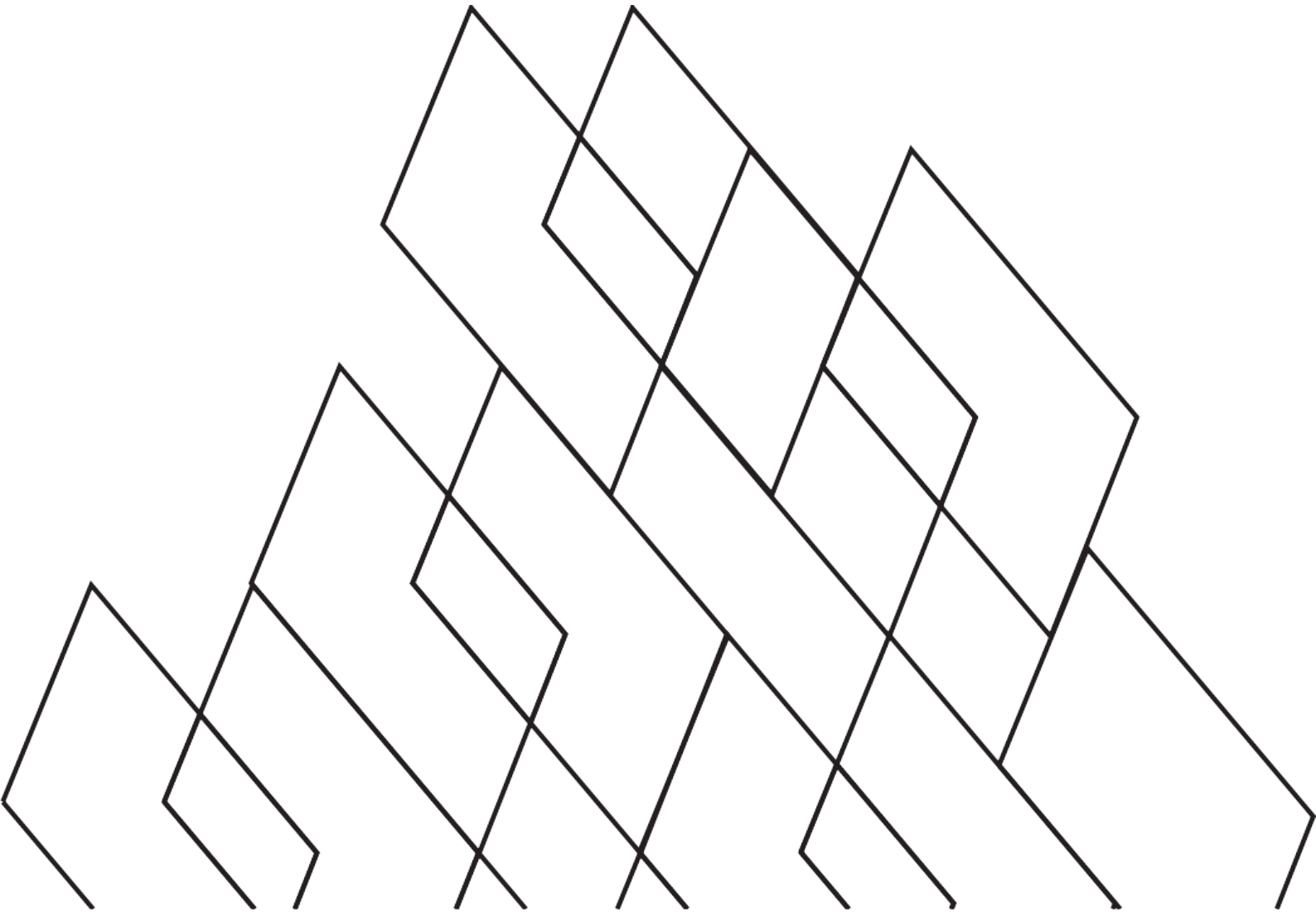
MAR SOLUTIONS

СЕРВИС ПО ВЫЯВЛЕНИЮ МАНИПУЛИРОВАНИЯ РЫНКОМ И ИНСАЙДЕРСКОЙ ТОРГОВЛИ НА ФИНАНСОВЫХ РЫНКАХ

MARTA

Инструкция по получению данных

Версия 1.26.3



Содержание

1. Набор файлов для анализа . . . 1
2. Загрузка потиковых данных по рынкам Московской биржи . . . 2
    2.1. Фондовый рынок . . . 2
    2.2. Валютный рынок . . . 3
    2.3. Срочный рынок . . . 3
3. Загрузка цен бумаг на Московской бирже . . . 3
4. Список сообщений эмитентов от Интерфакс . . . 4
5. Биржевые отчеты Московской биржи . . . 4
6. Биржевые отчеты СПБ Биржи . . . 4
7. Загрузка справочника контрагентов и трейдеров . . . 4
8. Список ценных бумаг, торгуемых на Московской бирже . . . 4
9. Списки ценных бумаг, торгуемых на СПБ Бирже . . . 5
10. Список эмитентов на Московской бирже . . . 5
11. Список инсайдеров . . . 5
12. Сигналы Московской биржи . . . 6

1. Набор файлов для анализа



Указанный ниже порядок загрузки отчетов является обязательным, так как данные могут иметь зависимости. При несоблюдении порядка возможны ошибки при заведении инструментов.

Для выполнения анализа данных сервису MARTA необходим следующий набор файлов за каждый торговый день:

- Фондовый рынок Московской биржи:
  - Текущие цены бумаг. Загрузка возможна в одном из двух вариантов:
    - Из файлов, публикуемых на сайте Мос. биржи после закрытия торгового дня.
    - Из файлов с потиковыми данными по всем сделкам на фондовом рынке. Это более предпочтительный вариант, так как такие данные содержат информацию по всем режимам торгов, а не только по основным рублевым.
  - Список событий по эмитентам от Интерфакса. Возможна настройка сервиса, при которой этот набор данных не будет являться обязательным для выполнения анализа.
  - Биржевой отчет SEM21 (результаты торгов).
  - Биржевой отчет SEM02 (заявки участника торгов). Поддерживаются форматы xml и csv.
  - Биржевой отчет SEM03 (сделки участника торгов).
- Срочный рынок Московской биржи:
  - Биржевой отчет clients (реестр клиента участника торгов).
  - Биржевые отчеты f07 и o07 (результаты торгов).
  - Биржевые отчеты f04 и o04 (сделки участника торгов).
  - Потиковые данные по сделкам.
- Валютный рынок Московской биржи:
  - Биржевой отчет CCX20 (реестр торгово-клиринговых счетов участника торгов).
  - Биржевой отчет CUX22 (заявки участника торгов).
  - Биржевой отчет CUX23 (сделки участника торгов).
  - Потиковые данные по всем сделкам, заключенном на этом рынке.
- Фондовый рынок СПБ Биржи:
  - Биржевой отчет SPB21 (результаты торгов за всю торговую сессию).
  - Биржевой отчет SPB03 (сделки участника торгов за всю торговую сессию).
  - Потиковые данные по всем сделкам, заключенным на этом рынке.
- Дополнительно (но не обязательно) можно загружать:
  - Справочник контрагентов (например, для указания имен клиентов в дополнение к их биржевым кодам).
  - Справочник трейдеров (для указания их имен в дополнение к их биржевым идентификаторам).

- Информация обо всех ценных бумагах, торгуемых на Московской бирже и на СПБ Бирже.
- Информация об эмитентах по ценным бумагам, торгуемым на Московской бирже.
- Списки инсайдеров.
- Заявки срочного рынка МБ (fordlog/oordlog).

Все эти файлы необходимо подложить в директорию /input сервиса MARTA. После загрузки файлы из этой директории удаляются автоматически.

Особенности загрузки файлов:

- Допускается загрузка разных файлов в разное время.
- Допускается повторная загрузка одних и тех же файлов.
- Допускается одновременная загрузка файлов за разные дни.
- Загружаемые файлы могут находиться в zip-архивах, в этом случае сервис распакует их самостоятельно. Не допускается только наличие в архивах директорий.

Далее описан способ получения упомянутых файлов.

2. Загрузка потиковых данных по рынкам Московской биржи

Формирование текущих цен из потиковых данных, предоставляемых Московской биржей по подписке, является предпочтительным, хотя и не единственным, вариантом загрузки цен по всем рынкам этой биржи.

При наличии соответствующей подписки файлы с данными доступны на странице https://www.moex.com/ru/marketdata/archive/ после входа в личный кабинет.

Данные файлы можно загружать вручную с сайта биржи, либо сервис MARTA Data Agent, который по заданному расписанию будет делать это самостоятельно. Для загрузки вручную необходимо зайти на упомянутую страницу, задать фильтр поиска файлов и выбрать из появившегося списка требуемые файлы.

В фильтрах везде необходимо указывать «Реестр сделок», «Последние 30 дней» (если не нужны более ранние данные) и «Формат CSV». Другие параметры фильтрации в зависимости от рынка:

2.1. Фондовый рынок

Необходимо за каждый день загрузить два файла:

1. Фондовый рынок и рынок депозитов / Рынок акций
2. Фондовый рынок и рынок депозитов / Рынок облигаций
3. Фондовый рынок и рынок депозитов / Режим переговорных сделок (подписка на режим переговорных сделок входит в подписку на акции и облигации)

2.2. Валютный рынок

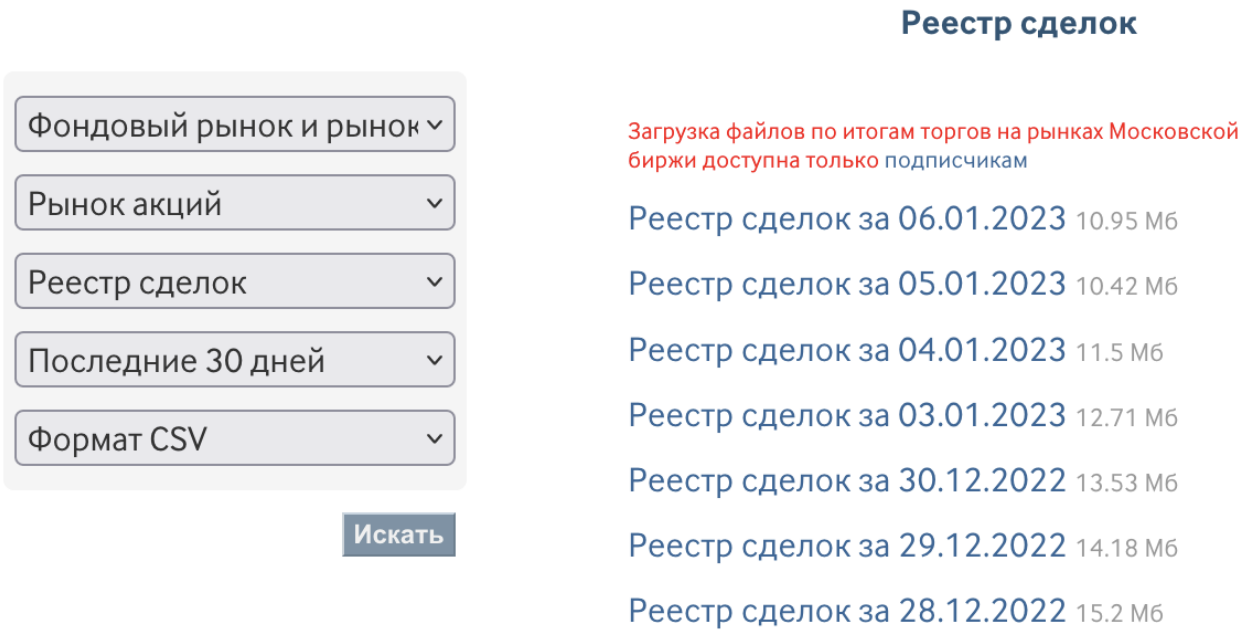
Необходимо загрузить файл по фильтру Валютный рынок / Биржевые сделки с ЦК.

2.3. Срочный рынок

Необходимо за каждый день загрузить два файла:

1. Срочный рынок / ФОРТС
2. Срочный рынок / Опционы ФОРТС

Пример фильтра на загрузку потиковых данных по акциям:



3. Загрузка цен бумаг на Московской бирже

1. Зайти на страницу https://www.moex.com/ru/current-prices.aspx.
2. Выбрать дату, за которую необходимо загрузить цены (обычно максимально доступная дата соответствует предыдущему торговому дню).
3. Выбрать формат данных CSV.
4. Перейти по ссылке «Скачать файл за торговый день».

Загрузка цен бумаг на Московской бирже возможна в автоматическом режиме с помощью сервиса MARTA Data Agent.

4. Список сообщений эмитентов от Интерфакс

Данные Интерфакс по сообщениям эмитентов предоставляются на электронную почту после оформления подписки.

По вопросам подключения необходимо обращаться в НСФР с просьбой подключиться к рассылке информации о раскрытии существенных фактов эмитентами ценных бумаг через Интерфакс: info@rosfinsovet.ru. При обращении необходимо указать адрес электронной почты, на который должны приходить файлы с данными.

5. Биржевые отчеты Московской биржи

Биржевые отчеты `SEM*, f*, o*, clients, CUX*, CCX*` и другие рассылаются по почте всем участникам торгов. Перед загрузкой отчетов в систему их необходимо расшифровать.

По вопросам подписки можно обращаться в службу поддержки Московской биржи: support@moex.com.

6. Биржевые отчеты СПБ Биржи

Биржевые отчеты `SPB*` рассылаются по почте всем участникам торгов. Перед загрузкой отчетов в систему их необходимо расшифровать.

По вопросам подписки можно обращаться в службу поддержки СПБ Биржи: np-help@rts.ru.

7. Загрузка справочника контрагентов и трейдеров

Импорт справочников контрагентов и трейдеров осуществляется с помощью файлового API, подробности работы которого описаны в отдельном документе.

8. Список ценных бумаг, торгуемых на Московской бирже

Загрузка данного списка является опциональной. Обычно информация по инструментам, торгуемым на Московской бирже, получается сервисом из биржевых отчетов, но возможна и отдельная загрузка полного списка, в котором содержится больше информации об инструменте, чем в биржевых отчетах.

Для получения указанного списка необходимо:

1. Зайти на страницу https://www.moex.com/msn/stock-instruments.
2. С помощью фильтров определить интересующий набор инструментов.

3. Нажать кнопку «Экспорт (CSV)».
4. При необходимости переименовать файл в `securities{-любая строка}.csv`.
5. Полученный таким образом файл нужно загрузить в сервис аналогично другим данным.

Загрузка списка ценных бумаг, торгуемых на Московской бирже, возможна в автоматическом режиме с помощью сервиса MARTA Data Agent.

9. Списки ценных бумаг, торгуемых на СПБ Бирже

Загрузка данных списков является опциональной.

Для получения списка иностранных бумаг необходимо:

1. Зайти на страницу https://spbexchange.ru/ru/stocks/inostrannye/Instruments.aspx.
2. Нажать ссылку «Все» в поле «Скачать данные в формате CSV».
3. Сохранить файл с именем ListingSecurityList-spbx-foreign.csv.

Для получения списка российских бумаг необходимо:

1. Зайти на страницу https://spbexchange.ru/ru/stocks/russian/Instruments.aspx.
2. Нажать ссылку «Все» в поле «Скачать данные в формате CSV».
3. Сохранить файл с именем ListingSecurityList-spbx-rus.csv.

Полученные таким образом файлы можно загрузить в сервис аналогично другим данным.

10. Список эмитентов на Московской бирже

Данный список необходим для установки корректных привязок ценных бумаг к эмитентам. Рекомендуется загружать его после загрузки списка бумаг, торгуемых на Московской бирже (см. предыдущий раздел).

Для его получения необходимо:

1. Зайти на страницу https://www.moex.com/ru/listing/securities-list.aspx.
2. Кликнуть на ссылку загрузки в формате «CSV (разделители – запятые)».
3. При необходимости переименовать файл в `ListingSecurityList{-любая строка}.csv`.

Полученный таким образом файл нужно загрузить в сервис аналогично другим данным.

11. Список инсайдеров

Загрузка списка инсайдеров позволяет сократить объем ручной работы по ведению списка инсайдеров в сервисе MARTA.

Для его загрузки необходимо в личном кабинете Московской биржи произвести экспорт списка инсайдеров в файл формата XML. Этот файл необходимо загрузить в сервис аналогично другим данным.

12. Сигналы Московской биржи

В системе возможна загрузка сигналов Московской биржи. Отчеты предоставляются участникам по подписке.

Полученный от биржи архив необходимо загрузить в сервис аналогично другим данным.