

**Описание процедур экспорта данных
о результатах торгов энергетическими фьючерсами
в форматах XML и CSV на Московской энергетической бирже**

Москва 2012 г.

1. Процедура получения данных об итогах торгов энергетическими фьючерсами за период

Для получения данных о результатах торгов энергетическими фьючерсами в формате XML или CSV с сайта Московской энергетической биржи необходимо обратиться по ссылке:

http://mosenex.ru/futures_export_result.asp?result_type={xml|csv}&isin=<Код инструмента>&period_type={M|Q|Y}&begin_date=DD.MM.YYYY&end_date=DD.MM.YYYY

Описание параметров:

result_type – должен принимать одно из двух значений: xml или csv. Если параметр не задан (или принимает другое значение), то по умолчанию программа выдает результат в формате csv.
isin – задает код инструмента (параметр не является обязательным и может быть опущен).
period_type – период обращения контрактов: М-месячный; Q-квартальный; Y-годовой (параметр не является обязательным, и если он не задан, то отчет строится по всем типам контрактов).
begin_date – дата начала отчетного периода (задается в формате: DD.MM.YYYY).
end_date – дата окончания отчетного периода (задается в формате: DD.MM.YYYY).

При обращении к странице futures_export_result.asp обязательно должен быть задан код контракта либо отчетный период.

Если при обращении к странице предполагается указание отчетного периода, то обе даты begin_date и end_date должны быть заданы. При этом контролируется, что количество дней в периоде не должно превышать 500 дней.

При неверном обращении к странице будет выдано диагностическое сообщение об ошибке.

2. Описание XML-формата для представления данных о результатах торгов энергетическими фьючерсами

Формат:

```
<message class="MOSENEX-FUTURES-RESULT" version="1.0"
message_date="YYYYMMDDHHMISS">
  <futures_result trade_day="DD. MM. YYYY" isin="32x" final_calc_day="DD. MM. YYYY"
  first_price="10n" min_price="10n" max_price="10n" last_price="10n" calc_price="10n"
  price_delta="12.2d" deal_qnt="10n" contract_qnt="10n" deal_amount="26.1d" pos_qnt="10n"
  pos_amount="26.1d"/>
</message>
```

Пояснения к тегам:

message – головной тег сообщения:

- **class** – всегда принимает значение MOSENEX-FUTURES-RESULT
- **version** – всегда принимает значение 1.0
- **message_date** – дата и время формирования XML-файла;

futures_result – множественный тег, содержащий данные с итогами торгов по контрактам за день:

- **trade_day** – дата торгов;
- **isin** – код контракта;
- **final_calc_day** – дата исполнения контракта;
- **first_price** – цена первой сделки;

- **min_price** – минимальная цена сделки;
- **max_price** – максимальная цена сделки;
- **last_price** – цена последней сделки;
- **calc_price** – расчетная цена последнего клиринга;
- **price_delta** – приращение цены;
- **deal_qnt** – количество сделок;
- **contract_qnt** – объем торгов в контрактах;
- **deal_amount** – объем торгов в рублях;
- **pos_qnt** – объем открытых позиций в контрактах;
- **pos_amount** – объем открытых позиций в рублях.

Пример сообщения:

```
<?xml version="1.0" encoding="windows-1251" ?>
<message class="MOSENEX-FUTURES-RESULT" version="1.0"
  message_date="20121029181716">
  <futures_result trade_day="03.02.2011" isin="ECPM-2.11" final_calc_day="01.03.2011"
    first_price="1000" min_price="1000" max_price="1000" last_price="1000"
    calc_price="1001" price_delta="2.14" deal_qnt="1" contract_qnt="100"
    deal_amount="2470000.0" pos_qnt="202" pos_amount="4994389.4" />
</message>
```

В csv-файле поля располагаются в следующей последовательности (в первой строке файла всегда выводятся названия этих полей):

trade_day	isin	final_calc_day	first_price	min_price	max_price	last_price	calc_price	price_delta
03.02.2011	ECPM-2.11	01.03.2011	1000	1000	1000	1000	1001	2.14

deal_qnt	contract_qnt	deal_amount	pos_qnt	pos_amount		
1	100	2470000	202	4994389.4		

3. Процедура получения данных о сделках по энергетическим фьючерсам за период

Для получения данных о сделках, сформированных в ходе торгов энергетическими фьючерсами, в формате XML или CSV с сайта Московской энергетической биржи необходимо обратиться по ссылке:

http://mosenex.ru/futures_export_deal.asp?result_type={xml|csv}&isin=<Код инструмента>&begin_date=DD.MM.YYYY&end_date=DD.MM.YYYY

Описание параметров:

result_type – должен принимать одно из двух значений: xml или csv. Если параметр не задан (или принимает другое значение), то по умолчанию программа выдает результат в формате csv.

isin – задает код инструмента (параметр является обязательным).

begin_date – дата начала отчетного периода (задается в формате: DD.MM.YYYY).

end_date – дата окончания отчетного периода (задается в формате: DD.MM.YYYY).

При обращении к странице futures_export_deal.asp обязательно должен быть задан код контракта.

Если при обращении к странице предполагается указание отчетного периода, то обе даты begin_date и end_date должны быть заданы. При этом контролируется, что количество дней в периоде не должно превышать 500 дней.

При неверном обращении к странице будет выдано диагностическое сообщение об ошибке.

4. Описание XML-формата для представления данных о сделках по результатам торгов энергетическими фьючерсами

Формат:

```
<message class="MOSENEX-FUTURES-DEAL " version="1.0" message_date="YYYYMMDDHHMISS">  
<futures_deal trade_day="DD.MM.YYYY" id_deal="16n" deal_date="DD.MM.YYYY HH:MM:SS"  
isin="32x" price="10n" contract_qnt="10n" />
```

Пояснения к тегам:

message – головной тег сообщения:

- **class** – всегда принимает значение MOSENEX-FUTURES-DEAL
- **version** – всегда принимает значение 1.0
- **message_date** – дата и время формирования XML-файла;

futures_deal – множественный тег, содержащий данные по сделке:

- **trade_day** – дата торгов;
- **id_deal** – идентификатор сделки;
- **deal_date** – дата сделки;
- **isin** – код контракта;
- **price** – цена сделки;
- **contract_qnt** – количество контрактов в сделке.

Пример сообщения:

```
<?xml version="1.0" encoding="windows-1251" ?>  
<message class="MOSENEX-FUTURES-DEAL" version="1.0"  
/message_date="20121029180828">  
<futures_deal trade_day="20.01.2012" id_deal="53715893" deal_date="20.01.2012  
12:01:33" isin="ECBM-2.12" price="879" contract_qnt="12" />  
<futures_deal trade_day="20.01.2012" id_deal="53716509" deal_date="20.01.2012  
12:01:47" isin="ECBM-2.12" price="879" contract_qnt="12" />  
</message>
```

В csv-файле поля располагаются в следующей последовательности (в первой строке файла всегда выводятся названия этих полей):

trade_day	id_deal	deal_date	isin	price	contract_qnt
25.01.2011	9984751	25.01.2011 13:01	ЕСРМ-2.11	1030	1
25.01.2011	9986155	25.01.2011 13:01	ЕСРМ-2.11	970	1
25.01.2011	10014469	25.01.2011 16:01	ЕСРМ-2.11	970	1