

Moscow Exchange

FIX-протокол для сервиса Request for Stream

Руководство пользователя

Московская биржа
Version 1.0.1
08 июня 2020

Оглавление

Оглавление.....	2
Введение	4
Назначение документа.....	4
Принцип работы сервиса.....	5
История изменений.....	6
Группы полей	6
Заголовок (Header)	6
Трейлер (Trailer).....	7
Группа Parties	7
Сообщения сессионного уровня	8
Logon (A).....	8
Logout (5)	9
Heartbeat (0)	10
Test Request (1)	10
Resend Request (2)	11
Sequence Reset (4).....	12
Reject (3).....	12
Сценарии установления и сброса сессии.....	14
Установка соединения	14
Механизм переотправки сообщений.....	14
Проверка состояния FIX соединения.....	15
Сброс порядковых номеров сообщений	15
Завершение FIX сессии	16
Переустановка сессии после сбоя	16

Сообщения общие для ролей Maker и Taker	17
Security List Request (x).....	17
Security List Request (y).....	17
Сообщения от клиента к серверу. Роль:	
Maker	18
RFQ Request (AH).....	18
QuoteRequestReject (AG)	19
Quote ('S').....	19
QuoteCancel ('Z')	21
Сообщения от сервера к клиенту. Роль:	
Maker	22
Quote Request ('R')	22
Quote Response ('AJ').....	23
Execution Report ('8')	24
QuoteStatusReport ('AI').....	25
Quote ('S').....	26
Сообщения от клиента к серверу. Роль:	
Taker	27
Quote Request ('R')	27
Quote Response ('AJ').....	29
Сообщения от сервера к клиенту. Роль:	
Taker	30
Quote ('S').....	30
Quote Request Reject ('AG').....	31
Quote Response ('AJ').....	31
Execution Report ('8')	33

Введение

Назначение документа

В данном документе представлено описание протокола FIX Московской Биржи для подключения к торгам для участия в аукционах Request for Stream (RFS). Описание основывается на спецификации стандартного FIX (Financial Information Exchange) версии 4.4. Предполагается, что пользователь уже знаком с основами этого протокола. В данную спецификацию не входят административный и технические аспекты организации сетевого подключения, а также способы обеспечения его безопасности. Пользователю рекомендуется придерживаться данной спецификации при формировании FIX сообщений, в противном случае, результат обработки данных сообщений сервисом может отличаться от ожидаемого пользователем.

Каждое сообщение (группа) описывается таблицей. Каждая строка в таблице это - поле сообщения группы. Для каждого поля указаны:

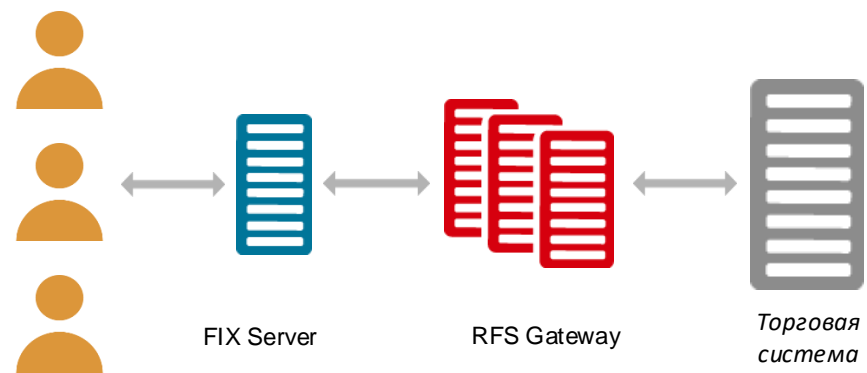
- Tag – число, которое непосредственно используется при формировании FIX сообщения.
- Поле – приведено имя поля, которое не используется при формировании FIX сообщения; введено для удобства, в качестве краткого описания. В документации FIX поле может быть указано как с использованием Tag, так и с использованием Field name.
- Наличие – атрибут поля, который показывает, должно ли поле обязательно присутствовать в сообщении.
 - «O» - обязательное поле;
 - «H» - необязательное поле;
 - «U» - обязательное при определенном условии.
 - «O*» - обязательное поле для MOEX, но необязательное по стандарту протокола FIX 4.4;
 - «H*» - необязательное поле для MOEX, но обязательное или условно обязательное по стандарту протокола FIX 4.4;
 - «U*» - условно обязательное для MOEX, но необязательное по стандарту протокола FIX 4.4.
- Тип – тип поля.
- Допустимые значения – дополнительные ограничения на тип поля.
- Примечание – детальное описание поля.

Принцип работы сервиса

Основные функции сервиса:

- Авторизация \ аутентификация пользователя в торговой системе
- Инициация аукциона RFS
- Получение \ отправка котировок
- Подтверждения намерения о заключении сделки

Схематично работа сервиса представлена на схеме ниже.



История изменений

Версия	Дата	Описание
1.0.1	08.06.2020	Добавление поля Anonymity(6101) в сообщение QuoteRequest.

Группы полей

Заголовок (Header)

Стандартный заголовок, который должно содержать каждое сообщение.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
8	BeginString	O	String (7)	'FIX.4.4'	Определяет начало нового сообщения и версию протокола. Всегда содержит незашифрованные данные, должно быть первым полем в сообщении.
9	BodyLength	O	Length		Длина сообщения. Рассчитывается в соответствии со стандартом. Всегда содержит незашифрованные данные, должно быть вторым полем в сообщении.
35	MsgType	O	String (10)		Определяет тип сообщения. Всегда содержит незашифрованные данные, должно быть третьим полем в сообщении.
49	SenderCompID	O	String (12)		Идентификатор фирмы – отправителя сообщения. Всегда содержит незашифрованные данные. Если сообщение отправляется в MOEX, это поле должно содержать идентификатор пользователя (USERID), присвоенное брокеру на MOEX.
56	TargetCompID	O	String		Идентификатор фирмы – получателя сообщения. Всегда содержит незашифрованные данные. Если сообщение отправляется с MOEX, это поле должно содержать идентификатор пользователя (USERID), присвоенное брокеру на MOEX.

34	MsgSeqNum	O	SeqNum		Порядковый номер сообщения. Может быть встроен в блок зашифрованных данных.
52	SendingTime	O	UTCTimestamp		Время передачи сообщения (выражено во временной зоне UTC). Формат поля YYYYMMDD-НН:ММ:SS.sss. Секция миллисекунд sss всегда содержит 3 символа.
122	OrigSendingTime	H	UTCTimestamp		Настоящее/оригинальное время передачи сообщения при пересылке сообщений в ответ на запрос о пересылке (сообщение Resend Request (2)), выражено в UTC формате. Формат поля YYYYMMDD-НН:ММ:SS.sss. Обязательное, если сообщение пересылается в ответ на запрос о пересылке (сообщение Resend Request (2)).

Трейлер (Trailer)

Стандартное окончание сообщения, которое должно содержать каждое сообщение.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
10	Checksum	O	String(3)		Контрольная сумма сообщения (3 байта). Всегда содержит незашифрованные данные, должно быть последним полем в сообщении.

Группа Parties

Группа «Parties» позволяет указать клиентский код в соответствующих сообщениях.

- Чтобы отправить заявку от имени клиента, нужно задать:

PartyID (448) = <код клиента>, PartyIDSource (447) = 'D', PartyRole (452) = '3';

Остальные значения поля 452 используются в информационных целях, и появляются исключительно в сообщениях Execution Report (8)

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
453	NoPartyID	O*	NumInGroup		Количество элементов в PartyIDs группе.
448	=> PartyID	Y	String (12)		Идентификатор или код стороны. Обязательный, если определен класс/тип или источник идентификаторов сторон (PartyIDSource(447)). Обязательное, если количество элементов в PartyIDs группе > 0.
447	=> PartyIDSource	Y	char	'D' (Частный/специальный код)	Класс/тип или источник идентификаторов сторон. Обязательный, если определен идентификатор стороны (PartyID (448)) или если количество элементов в PartyIDs группе > 0. Для каждой определенной стороны, поле должно содержать константное значение 'D' (Частный/специальный код).
452	=> PartyRole	Y	int	'1' (Фирма-исполнитель) '3' (Идентификатор клиента) '12' (Треjder-исполнитель) '17' (Фирма-контрагент)	Роль или тип стороны, код которой определен в поле PartyID (448). Обязательное, если количество элементов в PartyIDs группе > 0. '1' (Фирма-исполнитель) – используется для фирмы; '3' (Идентификатор клиента) – используется для указания в заявке кода клиента; '12' (Треjder-исполнитель) – используется для пользователя; '17' (Фирма-контрагент) – используется для указания фирмы-партнера, выступающей второй стороной в сделке.

Сообщения сессионного уровня

Сообщения сессионного уровня используются для установления FIX сессии, ее поддержки, контроля состояния соединения и возможности восстановления сессии в случае сбоев.

Logon (A)

Сообщение, инициирующее или подтверждающее установки сессии. Должно быть первым сообщением в каждом подключении. Передается в обе стороны. Ответное сообщение Logon в случае успешной авторизации, как правило, приходит не менее чем через 3 секунды. Это следует учитывать при настройке времени ожидания ответного Logon'a на стороне клиента.

Примечание: не допускается использование одного и того же SenderCompID более одного раза, независимо от типа сервиса.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
<Группа «Header»>		O			Тип сообщения = 'A'
98	EncryptMethod	O	int	'0' (Нет)	Метод шифрования. Всегда содержит незашифрованные данные. Важно: Шифрование не поддерживается на МОЕХ
108	HeartBtInt	O	int		Интервал ожидания торговых сообщений или сообщений HeartBeat. При значении поля HeartBtInt вне диапазона 1 ... 60 (секунд) клиент получит сообщение типа Logout (35=5) с текстовым описанием ошибки.
141	ResetSeqNumFlag	H	Boolean	'Y' (Да) 'N' (Нет)	Индикатор, указывающий должны ли обе стороны сбросить счетчики сообщений. Значение по умолчанию – Y.
554	Password	O*	String(8)		Пароль пользователя. (Максимальная длина – 8 символов) При отправке сообщения клиентом серверу, поле является обязательным к заполнению
1409	SessionStatus	H	Char	'0' (Сессия активна) '5' (Неверный пароль или имя пользователя) '7' (Логон не возможен \ идентификатор уже подключен)	Статус установки сессии. Отправляется сервером клиенту, в случае возникновения проблем.
6936	LanguageID	H	Char	'R' (Русский язык) 'E' (Английский язык)	Желаемый язык сообщений ТС.
<Группа «Trailer»>		O			

Logout (5)

Сообщение, инициирующее или подтверждающее завершение сессии.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
<Группа «Header»>		0			Тип сообщения = '5'
58	Text	H	String		Причина завершения сессии.
<Группа «Trailer»>		0			

Heartbeat (0)

Сообщение Heartbeat (0) используется для контроля состояния соединения.

Если Heartbeat (0) сообщение посылается в ответ на Test Request (1) сообщение, то поле TestReqID (112) должно содержать идентификатор Test Request (1) сообщения, на которое оно является ответом. Это используется для того, чтобы определить является ли Heartbeat (0) сообщение ответом на Test Request (1) сообщение.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
<Группа «Header»>		0			Тип сообщения = '0'
112	TestReqID	H	String		Идентификатор Test Request (1) сообщения, на которое Heartbeat (0) является ответом.
<Группа «Trailer»>		0			

Test Request (1)

Test Request (1) сообщение запрашивает Heartbeat (0) сообщение у противоположной стороны. Сообщение Test Request (1) используется для проверки порядковых номеров или состояния соединения. На сообщение Test Request (1) противоположная сторона отвечает Heartbeat (0) сообщением, в котором TestReqID (112) – идентификатор (1) сообщения.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
<Группа «Header»>		0			Тип сообщения = '1'
112	TestReqID	0	String		Идентификатор Test Request (1) сообщения.
<Группа «Trailer»>		0			

Resend Request (2)

Сообщение Resend Request (2) используется для инициирования повторной пересылки сообщений. Эта функция используется в случаях, если обнаружено расхождение в порядковых номерах сообщений или как функция процесса инициализации.

Важно! Сервис поддерживает Resend Request, но не отправляет повторно сообщения Quote и Quote Request. Аналогичным образом, сервис не принимает от пользователя сообщения с флагами 43(PossDupFlag)=Y или 97(Poss resend)=Y.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
<Группа «Header»>		0			Тип сообщения = '2'
7	BeginSeqNo	0	SeqNum		Номер первого сообщения, которое нужно повторно переслать.
16	EndSeqNo	0	SeqNum		Номер последнего сообщения, которое нужно повторно переслать. Если нужно запросить повторную пересылку одного сообщения, тогда BeginSeqNo (7) = EndSeqNo (16). Если нужно запросить все последующие сообщения, начиная с определенного номера, тогда EndSeqNo (16) = '0' (показывает бесконечность).
<Группа «Trailer»>		0			

Sequence Reset (4)

Сообщение Sequence Reset (4) имеет следующие режимы:

- Режим заполнения пробелов (используется поле MsgSeqNum);
- Режим сбрасывания счетчиков (поле MsgSeqNum игнорируется).

Режим заполнения пробелов (Gap Fill mode) используется как ответ на сообщение Resend Request (2) в случае, если одно или несколько сообщений должны быть пропущены потому, что:

- На протяжении нормального процесса повторной отправки отправляющая сторона может выбрать «не отправлять сообщения» (например, если заявка не актуальна);
- На протяжении нормального процесса повторной отправки пропускаются номера административных сообщений (например, Heartbeat (0), Test Request (1)).

GapFillFlag (123) field = "Y" – свидетельствует о том, что используется режим заполнения пробелов.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
<Группа «Header»>		O			Тип сообщения = '4'
123	GapFillFlag	H	Boolean	'Y' (Режим заполнения пробелов (используется поле MsgSeqNum)) 'N' (Режим сбрасывания счетчиков (поле MsgSeqNum игнорируется))	Идентификатор, который показывает должно ли сообщение Sequence Reset (4) заменять/замещать административные или сообщения бизнес уровня, которые не будут повторно пересылаться.
36	NewSeqNo	O	SeqNum		Новый порядковый номер.
<Группа «Trailer»>		O			

Reject (3)

Указывает на неверно переданное или недопустимое сообщение сессионного уровня, пришедшее от противоположной стороны. Либо на не корректное указание значение инструмента в сообщении RFQ Request ('AH').

Передача этого сообщения сигнализирует о серьезной ошибке в соблюдении спецификации. Например, о незаполненном обязательном поле сообщения. Сообщения, отправляемые пользователем системе, будут проигнорированы. Мы не рекомендуем пользователям отправлять это сообщение. Излишняя активность при его отправке загрязняет лог файлы и снижает удобство поддержки.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
<Группа «Header»>		O			Тип сообщения = '3'
45	RefSeqNum	O	SeqNum		MsgSeqNum (34) отклоняемого сообщения.
371	RefTagID	H	int		Тег некорректного поля.
372	RefMsgType	H	String(10)		MsgType (35) отклоняемого сообщения.
373	SessionRejectReason	H	int	'0' (Некорректный тег) '1' (Пропущено обязательное поле) '2' (Тег не определен для сообщения такого типа) '3' (Неопределенный тег) '4' (Значение для этого тега не указано) '5' (Указано некорректное значение для этого тега (значение выходит за допустимые пределы)) '6' (Некорректный формат данных для значения) '7' (Проблемы расшифровки) '8' (Проблемы подписи) '9' (Проблемы с CompID) '10' (Проблемы с правильностью/точностью SendingTime) '11' (Некорректный тип сообщения) '12' (Проблемы при валидации XML) '13' (Тег встречается больше, чем один раз) '14' (Теги определены не в соответствующем порядке) '15' (Поля группы определены не в соответствующем порядке) '16' (Неправильно рассчитано количество элементов в группе)	Причина отклонения.

				(NumInGroup)) '17' (Значения поля, у которого тип не "data", содержит разделитель) '99' (Другое)	
58	Text	H	String		Строка с текстом, объясняющим причину отказа.
<Группа «Trailer»>		O			

Сценарии установления и сброса сессии

Установка соединения

Для установки FIX соединения с сервером FIX-клиент должен отправить сообщение Logon (A), в котором указаны логин и пароль (SenderCompID и Password) к Торговой Системе. Если сообщение Logon (A) корректное и Торговая Система авторизовала пользователя, сервер отправляет FIX клиенту ответное Logon (A) сообщение, которое подтверждает установку FIX соединения. Как правило, этот процесс занимает до 5 секунд. После этого акцептор и инициатор FIX соединения синхронизируют свои сообщения посредством проверки порядковых номеров (MsgSeqNum (34)) перед тем, как отправить какое-нибудь сообщение.

Если сообщение Logon (A) некорректное или если Торговая Система не авторизовала пользователя, сервер закрывает соединение, при этом в ответ клиенту может быть отправлено сообщение Logout с объяснением причин отказа подключения.

Примечание: Каждый новый торговый день FIX клиент должен отправлять сообщение Logon (A) с порядковым номером 1. Каждый раз при повторном подключении к серверу в течение дня FIX клиент должен отправлять сообщение Logon (A) с порядковым номером, который больше на 1, чем у последнего сообщения в исходящем логе.

Если FIX клиент пошлёт серверу сообщение Logon (A) с флагом ResetSeqNumFlag='Y', то он не получит отчеты Execution Report (8), относящиеся к событиям, произошедшим до установления сессии.

Механизм переотправки сообщений

В процессе инициализации или после того, как FIX соединение было неожиданно разорвано, может возникнуть ситуация, когда одна из сторон (или сервер или клиент) получает сообщение, у которого порядковый номер больше, чем ожидается. Ожидаемым порядковым номером входящего сообщения считается такой, который больше на 1, чем у последнего сообщения во входящем логе. В этом случае сторона, получившая такое сообщение, должна инициировать механизм переотправки, отправив сообщение Resend Request (2), в котором должен быть указан диапазон порядковых номеров пропущенных сообщений (BeginSeqNo, EndSeqNo). Например, порядковый номер последнего полученного FIX клиентом сообщения до потери связи ровно 5, а после восстановления связи, сервер прислал сообщение с порядковым номером 10. Это значит, что FIX клиент

пропустил/потерял с 6 по 9 сообщения. Для получения этих сообщений FIX клиент должен сформировать Resend Request (2) сообщение с BeginSeqNo (7) = 6 и EndSeqNo (16) = 9.

Важно! Сервис поддерживает Resend Request, но не отправляет повторно сообщения Quote и Quote Request

Проверка состояния FIX соединения

Сообщение Heartbeat (0) используется для мониторинга статуса FIX соединения и определения пробелов в порядковых номерах сообщений, например, в случае потери входящих сообщений. В период неактивности, т.е. если в FIX сессии не было отправлено никаких данных на протяжении определенного интервала времени (HeartBtInt (108), заданного в секундах), то FIX приложение формирует и отправляет противоположной стороне сообщение типа Heartbeat (0), чтобы проверить статус соединения. Промежуток времени, через который периодически формируется Heartbeat (0) сообщение, определяется FIX клиентом в Logon (A) сообщении (поле HeartBtInt (108)). При этом сервер должен скопировать значение HeartBtInt (108) поля с Logon (A) сообщения и вернуть его в ответном Logon (A) сообщении. Это значит, что инициатор и акцептор сессии должны использовать одно и то же значение HeartBtInt (108).

Если инициатору Heartbeat (0) сообщения не приходит в ответ ни одно сообщение на протяжении определенного промежутка времени (HeartBtInt (108), заданного в секундах + "некоторое приемлемое время передачи"), тогда он должен сформировать Test Request (1) сообщение. Если и на Test Request (1) сообщение не получен ответ в течение определенного периода времени (HeartBtInt (108), заданного в секундах + "некоторое приемлемое время передачи"), тогда считается, что соединение потеряно и нужно предпринимать восстанавливающие меры.

Сброс порядковых номеров сообщений

Каждый день перед началом торгового дня MOEX автоматически сбрасывает порядковые номера сообщений. Это значит, что каждый новый день порядковые номера сообщений начинаются с 1.

В течение торгового дня FIX клиент может запросить сброс порядковых номеров сообщений (MsgSeqNum (34)) с помощью сообщения Logon (A) с установленным флагом ResetSeqNumFlag (ResetSeqNumFlag = Y). Рекомендуется перед сбросом порядковых номеров отправить сообщение Test Request (1) и дождаться ответного Heartbeat (0) сообщения. Это выполняется инициатором для того, чтобы убедиться в том, что он получил все отправленные ему сообщения, т.е. ни одно сообщения не пропущено. После получения ответного Heartbeat (0) сообщения FIX клиент отправляет сообщение Logon (A) в эту же сессию с MsgSeqNum (34) = 1 и ResetSeqNumFlag (141) = 'Y'. Сервер должен ответить таким же сообщением Logon (A) с MsgSeqNum (34) = 1 и ResetSeqNumFlag (141) = 'Y'. После этого сброс порядковых номеров считается успешно завершённым и каждое последующее сообщение от любой из сторон будет иметь порядковый номер 2.

На протяжении торгового дня, в случае, если сервер не может корректно повторно отправить пропущенные клиентом сообщения в ответ на Resend Request (2) сообщение, например, в случае, если произошел сбой и некоторые потерянные сообщения нельзя восстановить, тогда сервер предлагает увеличить порядковый номер сообщений (с возможной потерей данных) и

продолжить с него, т.е. формирует сообщение Sequence Reset (4) с GapFillFlag (123) = N (Sequence Reset) и NewSeqNo (36) = <новый порядковый номер>.

Примечание:

Если клиент инициировал запрос сброса порядковых номеров в течение торгового дня, то все накопленные сервером и еще не доставленные сообщения не будут доставлены клиенту.

Завершение FIX сессии

Корректным завершением/закрытием FIX сессии считается обмен Logout (5) сообщениями между инициатором и акцептором. Другие способы закрытия/обрыва сессии должны рассматриваться как некорректные и такие, которые приводят к ошибке.

Рекомендуется перед отправкой Logout (5) сообщения убедиться в том, что ни одно сообщение не потеряно и не пропущено. Для этого инициатор закрытия сессии отправляет сообщение Test Request (1) и ждет ответного Heartbeat (0) сообщения.

Перед тем, как разорвать соединение, инициатор завершения сессии должен подождать подтверждающее Logout (5) сообщение от акцептора. Это дает возможность акцептору убедиться в отсутствии потери сообщений или выполнить запрос переотправки пропущенных сообщений, если это необходимо. Сессия также может быть завершена, если через соответствующий период времени акцептор не прислал ответ на Logout (5) сообщение.

После отправки Logout (5) сообщения, инициатор завершения сессии не должен посылать никакого сообщения пока акцептор завершения сессии не попросил это сделать посредством сообщения Resend Request (2).

Переустановка сессии после сбоя

Имеют место следующие механизмы переустановки сессии:

1. Если при разрыве связи не произошло потери логов на стороне клиента, то для восстановления сессии и получения сообщений, накопленных на сервере, рекомендуется следующая последовательность действий:
 - a. Отправить Logon (A) сообщение с порядковым номером (MsgSeqNum (34)), который больше на 1, чем у последнего сообщения в исходящем логге;
 - b. Если в ответ получено Logon (A) сообщение с порядковым номером (MsgSeqNum (34)) больше, чем ожидается, тогда отправить на сервер Resend Request (2) сообщение с указанием диапазона порядковых номеров потерянных сообщений.
 - c. Сервер отправит клиенту все сообщения из указанного диапазона порядковых номеров и продолжит нормальную работу.
2. При возникновении серьезной ошибки, приводящей к частичной или полной потере клиентом логов, рекомендуется использовать один из следующих способов восстановления сессии:

- a. 1 способ:
 - i. Отправить Logon (A) сообщение, в котором MsgSeqNum (34) = 1 и ResetSeqNumFlag (141) = 'Y';
 - ii. После установления сессии запросить статус всех интересующих заявок сообщением Order Status Request (H);
- b. 2 способ:
 - i. Отправить Logon (A) сообщение, в котором MsgSeqNum (34) = 1;
 - ii. Если в ответ получено Logout (5) сообщение с Text (58) = "MsgSeqNum too low, expecting X but received Y", тогда отправить Logon (A) сообщение, в котором MsgSeqNum (34) = X.
 - iii. Отправить на сервер сообщение Resend Request с указанием диапазона порядковых номеров потерянных сообщений.
 - iv. Сервер отправит клиенту все сообщения из указанного диапазона порядковых номеров и продолжит нормальную работу.

3. Для получения информации о статусах отдельных заявок рекомендуется отправлять на сервер сообщения типа Order Status Request с указанием их номеров ClrOrdID или OrderID.

Сообщения общие для ролей Maker и Taker

Security List Request (x)

Сообщение для запроса списка инструментов, торгуемых в режиме RFS.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
	<Группа «Header»>	O			Тип сообщения = 'x'
320	SecurityReqID	O	String		Идентификатор запроса списка инструмента. Должен быть уникальным в течение сессии.
559	SecurityListRequestType	H*	Integer	'0'	Критерий отбора инструментов

Security List (y)

Список инструментов, отправляемый сервером в ответ на запрос.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
	<Группа «Header»>	O			Тип сообщения = 'y'

320	SecurityReqID	O	String		Идентификатор запроса списка инструментов
322	SecurityResponseID	O	String		Уникальный идентификатор сообщения Security list request
560	SecurityRequestResult	O	Integer	0 – корректный запрос	Результат выполнения запроса
146	NoRelatedSym	H	NumInGroup		Количество инструментов в группе
=> 336	TradingSessionID	H	String		Идентификатор торговой сессии. В качестве идентификатора торговой сессии используется режим торгов (SECBOARD).
=> 55	Symbol	H	String(12)		Код/аббревиатура ценной бумаги. В его качестве используется внутренний идентификатор финансового инструмента на MOEX (SECCODE).
=> 460	Product	H	Char	'4'	Тип продукта, с которым связана ценная бумага.
=> 561	RoundLot	H	Qty		Количество ценных бумаг в лоте.

Сообщения от клиента к серверу. Роль: Maker

RFQ Request (AH)

Сообщение служит для подписки провайдеров ликвидности на информацию о начале аукционов RFS по заданным инструментам.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
	<Группа «Header»>	O			Тип сообщения = 'AH'
644	RFQReqID	O	String(20)		Задаваемый пользователем идентификатор подписки. Должен быть уникален для FIX-сессии.
146	NoRelatedSym	O	Integer	1	Количество инструментов, по которым открывается аукцион, для MOEX всегда равен единице.
=>55	Symbol	O	String(12)		Код/аббревиатура ценной бумаги. В его качестве используется внутренний идентификатор финансового инструмента на MOEX (SECCODE). Для подписки на все доступные инструменты режима допустимо использовать 55=*

=>336	TradingSessionID	O	String		Идентификатор торговой сессии. В качестве идентификатора торговой сессии используется режим торгов (SECBOARD). Для подписки на все доступные сервису режимы можно использовать 336=*
263	SubscriptionRequestType	O	Char	'1' - Подписаться на получение информации о новых аукционах; '2' - Отказаться от подписки;	Тип запроса.

QuoteRequestReject (AG)

Сообщение отправляется провайдером ликвидности для отказа от участия в аукционе.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
	<Группа «Header»>	O			Тип сообщения = 'AG'
131	QuoteReqID	O	String(20)		Заполняется идентификатором аукциона назначенным системой.
658	QuoteRequestRejectReason	H*	Integer	'99' - Other	Причина отказа.
146	NoRelatedSym	O	Integer	1	Количество инструментов, по которым был открыт аукцион, для МОЕХ всегда равен единице.
=> 55	Symbol	O	String(12)		Код инструмента.
=> 336	TradingSessionID	O	String(4)		Код режима.

Quote ('S')

Сообщение отправляется провайдером ликвидности в открытый аукцион.

Для указания направления заявки провайдер ликвидности может отправлять котировки по двум направлениям одновременно. Для отправки таких котировок используется комбинация тэгов 54 + 132\133 + 134\135.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
	<Группа «Header»>	O			Тип сообщения = 'S'
131	QuoteReqID	O	String(20)		Заполняется идентификатором аукциона, назначенным системой.
117	QuoteID	O	String(20)		Уникальный (в рамках аукциона) идентификатор котировки, отправленной провайдером ликвидности.
54	Side	Y	Char	'1' – Покупка; '2' – Продажа;	Направление котировки. Допустима отправка двунаправленных котировок с отдельным указанием цены и объема по каждому направлению. Для этого, необходимо не отправлять тэг 54. Вместо него необходимо заполнить тэги 132\134 и 133\135.
55	Symbol	O	String(12)		Код инструмента
460	Product	H	Char		Тип продукта, с которым связана ценная бумага.
336	TradingSessionID	O	String(4)		Код режима
	<Группа "Parties">	H			Тейкер может использовать для указания кода клиента - CLIENTCODE (PartyRole=3).
1	Account	O*	String		Торгово-клиринговый счет провайдера ликвидности.
132	BidPx	Y	Price		Цена котировки на спрос
133	OfferPx	Y	Price		Цена котировки на предложение
134	BidSize	O	Qty		Объем котировки на спрос в лотах 0 (ноль) для снятия котировки по спросу
135	OfferSize	O	Qty		Объем котировки на предложение в лотах 0 (ноль) для снятия котировки по спросу
62	ValidUntilTime	H	UTCTimestamp		Время, когда заявка будет автоматически снята

QuoteCancel ('Z')

Сообщение отправляется провайдером ликвидности для отмены котировки.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
<Группа «Header»>		O			Тип сообщения = 'Z'
131	QuoteReqID	Y	String(20)		Идентификатор аукциона, назначенный системой. Если тэг не указан, котировка снимается по условию, указанному в 298 тэге.
117	QuoteID	O*	String(20)		Поле обязательное по протоколу, но не используемое сервисом. Содержит произвольную строку.
298	QuoteCancelType	O	Char	'1' Снять все котировки по заданному инструменту '4' Снять все котировки	Если не указан тэг 131, котировка будет снята по условию, заданному в тэге 298. Если тэг 131 указан, тэг 298 все равно должен присутствовать согласно требованиям протокола, однако его значение (1\4) будет проигнорировано. Для 298='1' являются обязательными тэги 295, 55 и 336. Результатом выполнения является снятие всех котировок пользователя, по заданному инструменту во всех аукционах. В случае 298='1' снимаются все котировки во всех аукционах отправленные пользователем.
295	NoQuoteEntries	Y	NumInGroup		Количество передаваемых инструментов.
=> 55	Symbol	N	String(12)		Код/аббревиатура ценной бумаги. В его качестве используется внутренний идентификатор финансового инструмента на MOEX (SECCODE).
336	TradingSessionID	N	String		Идентификатор торговой сессии. В качестве идентификатора торговой сессии используется режим торгов (SECBOARD).

Примеры сообщений:

Снятие котировки по номеру аукциона:

Номер аукциона 131=296. Тэг 298=1 задан, но не используется.

8=FIX.4.4; 9=91; 35=Z; 34=2; 49=MD9222100001; 56=MFIXRFSId; 52=20200114-07:56:31.000; 117=rand_str; 131=296; 298=1; 10=249;

Снятие котировки по инструменту:

Отсутствует тэг 131. Заданы 295, 55, 336.

8=FIX.4.4; 9=120; 35=Z; 34=2; 49=MD9222100001; 56=MFIXRFSId; 52=20200114-07:58:20.000; 117=rand_str; 298=1; 295=1; 55=EUR_RUB__TOD; 336=RFSP; 460=4; 10=095;

Снятие всех котировок:

Отсутствует тэг 131. 298=4. Других параметров не требуется.

8=FIX.4.4; 9=83; 35=Z; 34=2; 49=MD9222100001; 56=MFIXRFSId; 52=20200114-08:07:06.000; 117=rand_str; 298=4; 10=136;

Сообщения от сервера к клиенту. Роль: Maker

Quote Request ('R')

Сообщение отправляется провайдеру ликвидности сервером после инициации аукциона RFS потребителем ликвидности.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
<Группа «Header»>		O			Тип сообщения = 'R'
115	OnBehalfOfCompID	H	String		Раскрытие инициатора аукциона. Для анонимных аукционов – псевдоним потребителя ликвидности, для не анонимных – код фирмы потребителя ликвидности.
131	QuoteReqID	O	String(20)		Идентификатор аукциона, присвоенный системой. Уникален в течение торгового дня.
644	RFQReqID	O	String(20)		Заполняется для мейкера идентификатором подписки.
21002	AuctionID	O	String(20)		Идентификатор аукциона, назначенный системой.
537	QuoteType	H	Integer	1 – Котировка 3 – Котировка в собственных интересах	Отправка запроса с 537=3 является подтверждением о том, что потребитель ликвидности иницируя аукцион действует исключительно в собственных интересах.

146	NoRelatedSym	O	Integer	1	Количество инструментов, по которым открывается аукцион, для MOEX всегда равен 1.
=> 55	Symbol	O	String(12)		Код/аббревиатура ценной бумаги. В его качестве используется внутренний идентификатор финансового инструмента на MOEX (SECCODE).
=> 336	TradingSessionID	O	String		Идентификатор торговой сессии. В качестве идентификатора торговой сессии используется режим торгов (SECBOARD).
=> 460	Product	O	Char	'4'	Тип продукта, с которым связана ценная бумага.
=> <Группа "Parties">		H			Тейкер может использовать для указания кода клиента - CLIENTCODE (PartyRole=3).
=> 854	QtyType	H	Integer	'1' - Лоты	Размерность поля 38 (OrderQty). Для MOEX всегда в лотах.
=> 54	Side	H	char	'1' (Покупка) '2' (Продажа)	Направление заявки. Отсутствие данного тега трактуется как интерес как к покупке, так и продаже.
=> 38	OrderQty	O	Qty		Объем (в лотах)
=> 1	Account	H	String(12)		Торговый счет, в счет которого подается заявка. Присутствует если потребитель ликвидности одновременно подписан на аукцион.
=> 126	ExpireTime	O	UTCTimest amp		Время окончания аукциона. Формат YYYYMMDD-HH:MM:SS.

Quote Response ('AJ')

Сообщение отправляется провайдеру ликвидности системой после завершения аукциона.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
	<Группа «Header»>	O			Тип сообщения = 'AJ'
693	QuoteRespID	O	String(20)		Идентификатор аукциона, присвоенный системой. Уникален в течение торгового дня.
117	QuoteID	O			Номер обновления лучшей цены.
21002	AuctionID	O	String(20)		Идентификатор аукциона, назначенный системой.

460	Product	H	Char	'4'	Тип продукта, с которым связана ценная бумага.
537	QuoteType	H	Integer	1 – Котировка 3 – Котировка в собственных интересах	Отправка запроса с 537=3 является подтверждением о том, что потребитель ликвидности инициируя аукцион действует исключительно в собственных интересах.
854	QtyType	H	Integer	'1' - Лоты	Размерность поля 38 (OrderQty). Для MOEX всегда в лотах.
694	QuoteRespType	O	Char	'1' - Котировка провайдера принята потребителем '3' – Истекло время проведения аукциона '6' – Аукцион завершен	Идентифицирует тип ответа на котировку
336	TradingSessionID	O	String		Идентификатор торговой сессии. В качестве идентификатора торговой сессии используется режим торгов (SECBOARD).
55	Symbol	O	String(12)		Код/аббревиатура ценной бумаги. В его качестве используется внутренний идентификатор финансового инструмента на MOEX (SECCODE).
54	Side	O	Char	'1' – Покупка; '2' – Продажа;	Направление котировки
38	OrderQty	O	Qty		Объем (в лотах)
1	Account	H	String(12)		Торговый счет.
11	ClOrdId	H	String(20)		Дополнительная справочная информация.

Execution Report ('8')

Сообщение с данными по заключенной сделке РПС.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
	<Группа «Header»>	O			Тип сообщения = '8'
37	OrderID	O	String(20)		Уникальный номер котировки, сгенерированный системой.
693	QuoteRespID	O	String(20)		Идентификатор аукциона, присвоенный системой. Уникален в течение торгового дня.

526	SecondaryClOrdID	H	String(20)		Поле-примечание, используется для обратной связи с внешними системами. Например, идентификатор пользователя внешней системы, поставившего заявку.
115	OnBehalfOfCompID	H	String		Раскрытие инициатора аукциона.
21002	AuctionID	O	String(20)		Идентификатор аукциона, назначенный системой.
<Группа "Parties">		H			
17	ExecID	H	String(20)		Уникальный идентификатор сделки.
150	ExecType	O	Char	'F' – Сделка	Тип отчета об исполнении.
39	OrdStatus	O	Char	'2' – Исполнена	Состояние заявки.
1	Account	O	String(12)		Торгово-клиринговый счет.
55	Symbol	O	String(12)		Код инструмента.
336	TradingSessionID	O	String(4)		Код режима.
460	Product	H	Char	'4'	Тип продукта, с которым связана ценная бумага.
54	Side	O	Char	'1' – Покупка; '2' – Продажа;	Направление котировки.
38	OrderQty	O	Qty		Объем (в лотах).
44	Price	O	Price		Цена.
381	GrossTradeAmt	H	Amount		Объем сделки, выраженный в рублях.
60	TransactTime	O	UTCTimestamp		Время регистрации или снятия заявки, или время заключения сделки по заявке.
64	SettlDate	H	LocalMktDate		Дата расчетов, выраженная в ГГГММДД формате.
15	Currency	H	Currency		Код валюты
423	PriceType	O	Integer	2 – За лот	Указывает на тип цены. Всегда 2 для МОЕХ.
854	QtyType	H	Integer	'1' - Лоты	Размерность поля 38 (OrderQty). Для МОЕХ всегда в лотах.
151	LeavesQty	O*	Qty		Неисполненная часть заявки. Всегда равно 0.
14	CumQty	O*	Qty		Исполненная часть заявки. Всегда равна значению 38.
6	AvgPx	O*	Price		Средневзвешенная цена сделок по заявке. Всегда совпадает со значением цены заявки.
32	LastQty	O*	Qty		Объем заявки, выраженный в лотах, проданный/купленный в рамках этой (последней) сделки по данной заявке.
31	LastPx	O*	Price		Цена этой (последней) сделки по данной заявке. Всегда совпадает со значением цены заявки.

QuoteStatusReport ('AI')

Сообщение отправляется провайдеру ликвидности: в ответ на сообщение Quote и в дальнейшем, по мере изменения статуса котировки; в ответ на сообщение Quote Cancel ('Z') - снять котировку.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
	<Группа «Header»>	O			Тип сообщения = 'AI'
117	QuoteID	O	String(20)		Идентификатор котировки провайдера ликвидности.
131	QuoteReqID	O	String(20)		Идентификатор аукциона.
297	QuoteStatus	O	Integer	0 – Котировка принята 1 – Котировка отменена провайдером 5 – Котировка снята 6 – Котировка снята системой 7 – Котировка снята по времени 8 – Ошибка 9 – Котировка не найдена 10 – Статус заявки находится в процессе уточнения 11 – Котировка исполнена	Статус котировки.
55	Symbol	O	String(12)		Код инструмента.
336	TradingSessionID	O	String(4)		Код режима торгов.
58	Text	H	String		Текст ответа ТС

Quote ('S')

Сообщения Quote со значением лучших котировок отправляются провайдеру ликвидности после запуска аукциона. Отдельным случаем является отправка котировки пустого стакана. Признаком такой котировки является сообщение с полями цены и объема равными нулю.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
	<Группа «Header»>	O			Тип сообщения = 'S'
131	QuoteReqID	O	String(20)		Идентификатор аукциона, назначенный системой.
693	QuoteRespID	O	String(20)		Идентификатор аукциона, назначенный системой.
21002	AuctionID	O	String(20)		Идентификатор аукциона, назначенный системой.
117	QuoteID	O	String(20)		Номер обновления лучшей цены котировки.
55	Symbol	O	String(12)		Код инструмента
336	TradingSessionID	O	String(4)		Код режима
132	BidPx	H	Price		Цена спроса
133	OfferPx	H	Price		Цена предложения
134	BidSize	O	Qty		Объем котировки спроса (в лотах)
135	OfferSize	O	Qty		Объем котировки предложения (в лотах)
537	QuoteType	H	Integer	1 – Котировка 3 – Котировка в собственных интересах	537=3 является подтверждением того, что потребитель ликвидности иницируя аукцион действует исключительно в собственных интересах.
854	QtyType	H	Integer	'1' - Лоты	Размерность поля 38 (OrderQty). Для MOEX всегда в лотах.
423	PriceType	O	Integer	2 – За лот	Указывает на тип цены. Всегда 2 для MOEX.
126	ExpireTime	O	UTCTimestamp		Время экспирации аукциона

Сообщения от клиента к серверу. Роль: Taker

Quote Request ('R')

Сообщение отправляется потребителем ликвидности для инициации аукциона RFS.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
<Группа «Header»>		O			Тип сообщения = 'R'
131	QuoteReqID	O	String(20)		Идентификатор запроса аукциона, отправляемый пользователем. Должен быть уникальным в рамках торговой сессии.
537	QuoteType	H	Integer	1 – Котировка 3 – Котировка в собственных интересах	537=3 является подтверждением того, что потребитель ликвидности инициируя аукцион действует исключительно в собственных интересах.
11	ClOrdId	H	String(20)		Дополнительная справочная информация.
526	SecondaryClOrdID	H	String(20)		Поле-примечание, используется для обратной связи с внешними системами. Например, идентификатор пользователя внешней системы, поставившего заявку.
146	NoRelatedSym	O	Integer	1	Количество инструментов, по которым открывается аукцион, для MOEX всегда равен 1.
=> 55	Symbol	O	String(12)		Код/аббревиатура ценной бумаги. В его качестве используется внутренний идентификатор финансового инструмента на MOEX (SECCODE).
=> 336	TradingSessionID	O	String		Идентификатор торговой сессии. В качестве идентификатора торговой сессии используется режим торгов (SECBOARD).
=> 460	Product	O	Char		Тип продукта, с которым связана ценная бумага.
=> <Группа "Parties">		H			Тейкер может использовать для указания кода клиента - CLIENTCODE (PartyRole=3).
=> 54	Side	H	char	'1' (Покупка) '2' (Продажа)	Направление заявки. Отсутствие данного тега трактуется как интерес как к покупке, так и продаже.
=> 38	OrderQty	O	Qty		Объем котировки в лотах.
=> 1	Account	O	String(12)		Торговый счет, в счет которого подается заявка.
=> 126	ExpireTime	O	UTCTimestamp		Время окончания аукциона

=> 6101	Anonymity	H	Char	'Y' – Анонимный аукцион 'N' – Аукцион с раскрытием информации о потребителе ликвидности.	Признак анонимности инициатора аукциона. По умолчанию 'Y'. Если 'N' – провайдер ликвидности получит код фирмы потребителя ликвидности в тэге OnBehalfOfCompID(115).
---------	-----------	---	------	---	---

Quote Response ('AJ')

Сообщение отправляется потребителем ликвидности в качестве запроса на окончание аукциона. Сообщение может быть как запросом на прекращение аукциона, так и ответом на подходящую потребителю ликвидности котировку.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
	<Группа «Header»>	O			Тип сообщения = 'AJ'
693	QuoteRespID	O	String(20)		Идентификатор аукциона, отправленный пользователем в сообщении Quote Request.
117	QuoteID	Y			Номер обновления лучшей цены.
694	QuoteRespType	O	Char	'1' = Ответ на котировку '6' = Завершение аукциона	Тип запроса.
336	TradingSessionID	O	String(4)		Код режима торгов.
55	Symbol	O	String(12)		Код инструмента.
54	Side	Y	char	'1' (Покупка) '2' (Продажа)	Направление котировки.
38	OrderQty	Y	Qty		Объем котировки в лотах.
460	Product	O	Char		Тип продукта, с которым связана ценная бумага.
44	Price	Y	Price		Цена.
1	Account	Y	String(12)		Торговый счет, с которого подается заявка.
11	ClOrdId	Y	String(20)		Пользовательский номер котировки, на которую отвечает потребитель ликвидности.

Сообщения от сервера к клиенту. Роль: Taker

Quote ('S')

Сообщения Quote отправляются потребителю ликвидности после запуска аукциона. Отдельным случаем является отправка котировки пустого стакана. Признаком такой котировки является с полями цены и объема равными нулю.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
	<Группа «Header»>	O			Тип сообщения = 'S'
131	QuoteReqID	O	String(20)		Идентификатор аукциона, отправленный пользователем в сообщении Quote Request.
693	QuoteRespID	O	String(20)		Идентификатор аукциона, отправленный пользователем в сообщении Quote Request.
21002	AuctionID	O	String(20)		Идентификатор аукциона, назначенный системой.
117	QuoteID	O	String(20)		Номер обновления лучшей цены котировки.
	<Группа "Parties">	H			
1	Account	O	String(12)		Торговый счет, указанный при инициации аукциона.
55	Symbol	O	String(12)		Код инструмента
336	TradingSessionID	O	String(4)		Код режима
460	Product	O	Char	'4'	Тип продукта, с которым связана ценная бумага.
132	BidPx	H	Price		Цена спроса
133	OfferPx	H	Price		Цена предложения
134	BidSize	O	Qty		Объем котировки спроса (в лотах)
135	OfferSize	O	Qty		Объем котировки предложения (в лотах)
38	OrderQty	O	Qty		Объем (в лотах)
537	QuoteType	H	Integer	1 – Котировка	537=3 является подтверждением того, что потребитель ликвидности иницируя аукцион действует исключительно в собственных интересах.

				3 – Котировка в собственных интересах	
854	QtyType	O	Integer	'1' - Лоты	Размерность поля 38 (OrderQty). Для MOEX всегда в лотах.
423	PriceType	O	Integer	2 – За лот	Указывает на тип цены. Всегда 2 для MOEX.
126	ExpireTime	O	UTCTimesta mp		Время экспирации аукциона

Quote Request Reject ('AG')

Сообщение отправляется потребителю ликвидности в случае проблем с инициацией аукциона по его запросу.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
	<Группа «Header»>	O			Тип сообщения = 'AG'
58	Text	H	String		Текст ошибки
131	QuoteReqID	O	String(20)		Заполняемый потребителем ликвидности идентификатор запроса на аукцион.
658	QuoteRequestRejectReason	O	Integer		Код причины отказа. При отмене аукциона (в том числе из-за истечения времени) указывается #658=10
146	NoRelatedSym	O	Integer	1	Количество элементов в группе, для MOEX всегда 1.
=> 55	Symbol	O	String(12)		Код инструмента.
=> 336	TradingSessionID	O	String(4)		Код режима.
58	Text	O	String		Причина отказа.

Quote Response ('AJ')

Сообщение отправляется потребителю ликвидности в ответ на запрос о прекращении аукциона либо после экспирации аукциона.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
	<Группа «Header»>	O			Тип сообщения = 'AJ'
693	QuoteRespID	O	String(20)		Идентификатор аукциона, отправленный потребителем в сообщении Quote Request.
117	QuoteID	O			Номер обновления лучшей цены.
21002	AuctionID	O	String(20)		Идентификатор аукциона, назначенный системой.
694	QuoteRespType	O	Char	'1' – Аукцион завершился сделкой '3' – Время проведения аукциона истекло '6' - Запрос на завершение аукциона	Причина завершения аукциона.
336	TradingSessionID	O	String(4)		Код режима.
55	Symbol	O	String(12)		Код инструмента.
460	Product	H	Char	'4'	Тип продукта, с которым связана ценная бумага.
537	QuoteType	H	Integer	1 – Котировка 3 – Котировка в собственных интересах	537=3 является подтверждением того, что потребитель ликвидности инициируя аукцион действует исключительно в собственных интересах.
854	QtyType	O	Integer	'1' - Лоты	Размерность поля 38 (OrderQty). Для MOEX всегда в лотах.
54	Side	O	Char	'1' – Покупка; '2' – Продажа;	Направление котировки
38	OrderQty	O	Qty		Объем (в лотах)
1	Account	H	String(12)		Торговый счет.

11	CIOrdId	H	String(20)		Пользовательский номер котировки, на которую отвечает потребитель ликвидности.
----	---------	---	------------	--	--

Execution Report ('8')

Сообщение с данными по отправленной заявке РПС.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
	<Группа «Header»>	O			Тип сообщения = '8'
37	OrderID	O	String(20)		Уникальный номер котировки, сгенерированный системой.
693	QuoteRespID	O	String(20)		Идентификатор аукциона, отправленный потребителем в сообщении Quote Request.
526	SecondaryCIOrdID	H	String(20)		Поле-примечание, используется для обратной связи с внешними системами. Например, идентификатор пользователя внешней системы, поставившего заявку.
854	QtyType	O	Integer	'1' - Лоты	Размерность поля 38 (OrderQty). Для MOEX всегда в лотах.
21002	AuctionID	O	String(20)		Идентификатор аукциона, назначенный системой.
17	ExecID	O	String(20)		Идентификатор отчета об исполнении. Уникален для сделки.
	<Группа "Parties">	H			
150	ExecType	O	Char	'F' – Сделка '8' – Заявка отклонена	Тип отчета об исполнении.
39	OrdStatus	O	Char	'2' – Исполнена '8' - Отклонена	Состояние заявки.
1	Account	H	String(12)		Торгово-клиринговый счет.
55	Symbol	O	String(12)		Код инструмента.
460	Product	O	Char		Тип продукта, с которым связана ценная бумага.
336	TradingSessionID	O	String(4)		Код режима.

54	Side	O	Char	'1' – Покупка; '2' – Продажа;	Направление котировки.
38	OrderQty	O	Qty		Объем (в лотах).
44	Price	O	Price		Цена.
381	GrossTradeAmt	H	Amount		Объем сделки, выраженный в рублях.
60	TransactTime	H	UTCTimestamp		Время регистрации или снятия заявки, или время заключения сделки по заявке.
64	SettlDate	H	LocalMktDate		Дата расчетов, выраженная в ГГГММДД формате.
151	LeavesQty	H*	Qty		Неисполненная часть заявки. Всегда равно 0.
14	CumQty	H*	Qty		Исполненная часть заявки. Всегда равна значению 38.
6	AvgPx	H*	Price		Средневзвешенная цена сделок по заявке. Всегда совпадает со значением цены заявки.
32	LastQty	H*	Qty		Объем заявки, выраженный в лотах, проданный/купленный в рамках этой (последней) сделки по данной заявке.
31	LastPx	H*	Price		Цена этой (последней) сделки по данной заявке. Всегда совпадает со значением цены заявки.
15	Currency	H	Currency		Код валюты
423	PriceType	O	Integer	2 – За лот	Указывает на тип цены. Всегда 2 для MOEX.
103	OrdRejReason	H	Integer	99 - Другое	Причина отказа.
58	Text	H	String		Текст ответа ТС

QuoteStatusReport ('AI')

Сообщение отправляется потребителю ликвидности: в ответ на сообщение Quote Request Reject, если операция вызвала отказ.

Tag	Поле	Наличие	Тип	Допустимые значения	Примечание
	<Группа «Header»>	O			Тип сообщения = 'AI'
117	QuoteID	O	String(20)		Идентификатор котировки провайдера ликвидности.
131	QuoteReqID	O	String(20)		Идентификатор аукциона.
297	QuoteStatus	O	Integer	9 – аукцион не найден	Статус аукциона.

55	Symbol	O	String(12)		Код инструмента.
336	TradingSessionID	O	String(4)		Код режима торгов.
58	Text	H	String		Текст ответа ТС