

Спецификация FIX API к системе клиринга Сапфир

Листов 51

Содержание

1. Общая информация	5
2. Типы подключения.....	6
3. Типы сообщений.....	7
3.1 FIXT. Структура сообщений.	7
3.2 Logon.....	8
3.3 Logout.....	8
3.4 TestRequest.....	8
3.5 Heartbeat.....	9
3.6 ResendRequest.....	9
3.7 SequenceReset	10
3.8 TradeCaptureReport	12
3.9 Ответы TradeCaptureReport.....	14
3.9.1 TradeCaptureReportAck - запрос получен.....	15
3.9.2 TradeCaptureReportAck - запрос принят.....	15
3.9.3 TradeCaptureReportAck – ошибка	16
3.10 TradeCaptureReportAck Ошибки	16
3.11 BusinessMessageReject Ошибки.....	16
3.12 TradeCaptureReportRequest.....	17
3.13 Ответы.....	20
3.13.1 TradeCaptureReportRequest – ответы	20
3.13.2 TradeCaptureReportRequestAck – ошибка.....	23
3.13.3 TradeCaptureReportRequestAck – ошибки	23
3.13.4 Комбинации запросов	24
3.14 NewOrderSingle	25
3.14.1 Ответы на NewOrderSingle	26
3.14.2 ExecutionReport - Ордер получен.....	29
3.14.3 ExecutionReport - Ордер зарегистрирован	29
3.14.4 ExecutionReport - Ордер исполнен.....	30
3.14.5 ExecutionReport - Ордер отклонен	32
3.14.6 ExecutionReport – ошибки.....	32
3.15 OrderCancelRequest	33
3.15.1 ExecutionReport - Ордер снят	34
3.15.2 OrderCancelReject - Ошибка отмены ордера.....	34
3.15.3 OrderCancelReject - ошибки.....	35

3.16	MarketDataRequest	35
3.17	ОТВЕТЫ на MarketDataRequest.....	36
3.17.1	MarketDataSnapshotFullRefresh	36
3.17.2	MarketDataRequestReject - Ошибка запроса.....	37
3.17.3	MarketDataRequest <281>- ошибки.....	37
3.18	SecurityListRequest.....	37
3.19	Примеры SecurityListRequest.....	38
3.19.1	SecurityList - Список тикеров.....	38
3.19.2	SecurityList - Детализация по тикеру.....	38
3.19.3	SecurityList - Ошибка запроса	44
3.19.4	SecurityList - ошибки.....	45
3.20	RequestForPositions	46
3.21	ОТВЕТЫPositionReport.....	46
3.22	OrderMassCancelRequest.....	46
3.23	OrderMassCancelReport - Примеры ответов	47
3.24	OrderMassCancelReport - Ошибка запроса	47
4.	Описание элементов component	47
4.1	Instrument**	47
4.2	TrdCapRptSideGrp***	48
4.3	NoSides.....	48
4.4	Parties	49
4.5	NoPartyIds	49
4.6	OrderQtyData	50
4.7	MDReqGrp	50
4.8	NoMDEntryTypes	50
4.9	InstrmtMDReqGrp.....	50
4.10	NoRelatedSym.....	51
4.11	SecurityXML	51

История изменений

№ п/п	Версия документа	Внесенные изменения	Дата внесения изменений
1	Версия 2.6	<ol style="list-style-type: none">Добавлен тег 526 (SecondaryClOrdID) в следующие сообщения:<ul style="list-style-type: none">NewOrderSingle;Ответы на NewOrderSingle;ExecutionReport - Ордер получен;ExecutionReport - Ордер зарегистрирован;TradeCaptureReport.Различные корректировки и дополнения уже существующих тегов в таблицах параметров сообщений.	05.06.2025
2	Версия 2.7	<ol style="list-style-type: none">Из таблицы раздела 3.8 TradeCaptureReport удалена строка с информацией по тегу 526Из таблицы раздела 3.13.1 TradeCaptureReportRequest – ответы удалена строка с информацией по тегу 526В раздел 4.5 NoPartyIds добавлена информация по тегу 526	01.07.2025

1. Общая информация

FIX API к торгово-клиринговой системе стандартизированных ПФИ Московской Биржи (далее ТКС СПФИ) основывается на бизнес-процессах и объектах (workflows and objects) стандарта FIX версии 5.0 SP2.

Документация содержит только поддерживаемые и принимаемые сообщения в торгово-клиринговой системе рынка СПФИ.

При настройке клиентской части следует обращать внимание на используемые на стороне клиента словари.

2. Типы подключения

На рынке СПФИ поддерживается 2 типа подключения - торговое и DropCopy. Управление режимом подключения осуществляется на стороне клиента:

- если TargetCompID=MOEX, то используется торговое подключение; можно выставить заявки и др. типы запросов;
- если TargetCompID=COPY, то используется подключение Drop Copy для загрузки сделок; нельзя выставить заявки (никакие типы сообщений со стороны клиентов не поддерживаются, только автоматическое получение сделок).

3. Типы сообщений

Пользователю FIX API доступны следующие типы сообщений:

1. TradeCaptureReport – см. пункт TradeCaptureReport. Сообщение отправляется в следующих случаях:
 - Отправка участником сделки на клиринг.
2. TradeCaptureReportRequest - см. пункт TradeCaptureReportRequest. Сообщение отправляется в следующих случаях:
 - Запрос сделок по определенному критерию.
3. NewOrderSingle - см. пункт NewOrderSingle. Сообщение отправляется в следующих случаях:
 - Выставление заявки (ордера).
4. OrderCancelRequest - см. пункт OrderCancelRequest. Сообщение отправляется в следующих случаях:
 - Снятие ранее отправленного ордера.
5. MarketDataRequest - см. пункт MarketDataRequest. Сообщение отправляется в следующих случаях:
 - Запрос рыночных данных, предоставляемых ТКС на рынке СПФИ.
6. SecurityListRequest - см. пункт SecurityListRequest. Сообщение отправляется в следующих случаях:
 - Запрос информации о шаблонных инструментах (тикерах) на рынке СПФИ.
7. RequestForPositions - см. пункт RequestForPositions. Сообщение отправляется в следующих случаях:
 - Получение информации Участником о своих позициях на рынке СПФИ.
8. OrderMassCancelRequest - см. пункт OrderMassCancelRequest. Сообщение отправляется в следующих случаях:
 - Одновременная отмена всех заявок Участника

3.1 FIXT. Структура сообщений.

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
8	BeginString	Идентификатор начала сообщения, всегда заполняется как FIXT.1.1 и должен быть первым элементом в сообщении	STRING	Да
9	BodyLength	Длина сообщения в байтах. Должен быть вторым элементом в сообщении	INT	Да
35	MsgType	Тип сообщения. Должен быть третьим элементом в сообщении	STRING	Да
49	SenderCompID	Отправитель сообщения. Совпадает с логином.	STRING	Да

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
56	TargetCompID	Получатель сообщения. Всегда MOEX	STRING	Да
34	MsgSeqNum	Порядковый номер сообщения	INT	Да
52	SendingTime	Время отправки сообщения в UTC	UTCTIMESTAMP	Да
10	Checksum	Контрольная сумма. Всегда последний элемент в сообщении. <i>Расчет: FIXT.1.1: "Checksum Calculation"</i>	STRING	Да
122	OrigSendingTime	Первоначальное время отправки сообщения (при ответе на ResendRequest)	UTCTIMESTAMP	Нет

3.2 Logon

Тип сообщения – A. 35=A

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
98	EncryptMethod	Метод шифрования. Всегда None (0)	INT	Да
108	HeartBtInt	Интервал биений (в секундах)	INT	Да
554	Password	Пароль	STRING	Да
925	NewPassword	Новый пароль. Передается при необходимости поменять пароль	STRING	Нет
1137	DefaultAppVerId	Версия фикса. Всегда FIX50SP2 (9)	INT	Да

3.3 Logout

Тип сообщения – 5. 35=5

3.4 TestRequest

Тип сообщения – 1. 35=1

Сообщение с тестовым запросом вызывает ответ от приложения на принимающей стороне. В сообщении с запросом на тестирование проверяются порядковые номера или статус линии связи. Противоположное приложение отвечает на тестовый запрос сообщением Heartbeat <0>, содержащим TestReqID <112>.

TestReqID подтверждает, что противоположное приложение генерирует биение в результате запроса на тестирование, а не в результате обычного тайм-аута. Противоположное приложение включает TestReqID в полученный Heartbeat. В качестве TestReqID можно использовать любую строку (одним из предложений является использование строки временной метки).

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
112	TestReqID	Идентификатор запроса, должен быть возвращен в ответе Heartbeat	STRING	Нет

3.5 Heartbeat

Тип сообщения – 0. 35=0

Heartbeat <0> отслеживает состояние канала связи и определяет, когда последняя строка сообщений не была получена.

Когда соединение FIX не отправляет никаких данных в течение [HeartBtInt <108>] секунд, он передает сообщение Heartbeat <0>. Когда соединение FIX не получает никаких данных в течение (HeartBtInt <108> + «некоторое разумное время передачи») секунд, он передаст сообщение Test Request <1>. Если после (HeartBtInt <108> + «некоторое разумное время передачи») секунд сообщение Heartbeat <0> по-прежнему не получено, то соединение следует считать потерянным и предпринять корректирующие действия. Обратите внимание, что сообщение Test Request <1> по-прежнему может быть отправлено независимо от значения HeartBtInt <108>, что приведет к принудительному отправке сообщения Heartbeat <0>.

Heartbeat <0>., выдаваемые в результате запроса на тестирование <1>, должны содержать TestReqID <112>, переданный в сообщении запроса на тестирование <1>. Это полезно для проверки того, что Heartbeat <0> является результатом Test Request <1>, а не результатом обычного тайм-аута.

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
112	TestReqID	Идентификатор при ответе на TestRequest	STRING	Нет

3.6 ResendRequest

Тип сообщения – 2. 35=2

Запрос на повторную отправку отправляется принимающим приложением, чтобы инициировать повторную передачу сообщений. Эта функция используется, если обнаружен пропуск порядкового номера, если принимающее приложение потеряло сообщение, или как функция процесса инициализации.

Запрос на повторную отправку может использоваться для запроса одного сообщения, диапазона сообщений или всех сообщений, следующих за конкретным сообщением.

Отправляющее приложение может учитывать тип сообщения при повторной отправке сообщений; например, если новый ордер находится в серии повторных отправок и с момента его первоначального создания прошел значительный период времени, отправитель может не захотеть повторно передавать ордер, учитывая возможность изменения рыночных условий. (Сообщение Sequence Reset-GapFill <4> используется для пропуска сообщений, которые отправитель не желает повторно отправлять.)

Важно, чтобы принимающее приложение обрабатывало сообщения в последовательном порядке, т.е. если сообщение номер 7 пропущено, а получено 8-9, приложение должно игнорировать 8 и 9 и запросить повторную отправку 7-9 или, что предпочтительнее, 7-0 (0 означает бесконечность).

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
7	BeginSeqNo	Номер первого сообщения для повторной отправки	INT	Да
16	EndSeqNo	Номер последнего сообщения для повторной отправки. 0 – бесконечность	INT	Да

3.7 SequenceReset

Тип сообщения – 4 35=4

Сообщение Sequence Reset имеет два режима: режим Gap Fill и режим Reset.

Режим Gap Fill используется в ответ на Resend Request <2>, когда одно или несколько сообщений должны быть пропущены по следующим причинам:

Во время обработки повторной отправки отправляющее приложение может не отправлять сообщение (например, просроченный ордер).

Во время обработки повторной отправки, ряд административных сообщений пропускается и не отправляется повторно (например, Heart Beats, Test Requests).

Режим Gap Fill обозначается полем GapFillFlag <123> = "Y".

Если поле GapFillFlag <123> присутствует (и равно "Y"), MsgSeqNum <34> должно соответствовать стандартным правилам упорядочения сообщений (т. е. MsgSeqNum <34> сообщения режима Sequence Reset <4> GapFill должно представлять начало MsgSeqNum <34> в диапазоне GapFill, поскольку удаленная сторона ожидает этот следующий порядковый номер сообщения).

Режим сброса включает указание произвольно более высокого нового порядкового номера, ожидаемого получателем сообщения Sequence Reset <4>-Reset mode, и используется для восстановления сеанса FIX после неисправимого сбоя приложения.

Режим сброса указывается полем GapFillFlag <123> = "N" или если поле опущено.

Если поле GapFillFlag <123> отсутствует (или установлено в N), можно предположить, что целью сообщения Sequence Reset <4> является восстановление после нарушения последовательности. В Sequence Reset <4> — режим сброса MsgSeqNum <34> в заголовке следует игнорировать.

Получение сообщения Sequence Reset <4> — режим сброса с неупорядоченным MsgSeqNum <34> не должно генерировать запросы на повторную отправку.

Sequence Reset <4> — сброс НЕ ДОЛЖЕН использоваться как обычный ответ на запрос повторной отправки <2> (вместо него следует использовать сброс последовательности <4> — Gap Fill). Reset <4> - Сброс следует использовать ТОЛЬКО для восстановления после аварийной ситуации, которая не может быть восстановлена с помощью Sequence Reset GapFillFlag. Обратите внимание, что использование Sequence Reset <4> - Reset может привести к потере сообщений.

Правила обработки всех сообщений Sequence Reset:

Приложение-отправитель инициирует сброс последовательности <4>. Сообщение во всех ситуациях указывает NewSeqNo <36> для сброса в качестве значения следующего порядкового номера, ожидаемого получателем сообщения сразу после пропущенных сообщений и/или порядковых номеров.

Sequence Reset может только увеличить порядковый номер. Необходимо соблюдать осторожность, чтобы игнорировать повторяющийся режим Sequence Reset <4>-GapFill, который пытается понизить следующий ожидаемый порядковый номер. Это можно обнаружить, проверив, меньше ли значение MsgSeqNum <34>, чем ожидалось. Если да, то режим Sequence Reset <4>-GapFill является дубликатом и должен быть отброшен.

При аварийном сбросе соединения, без выхода из сессии, сиквенсы сбрасываются.

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
36	NewSeqNo	Новый номер последовательности	INT	Да
123	GapFillFlag		BOOLEAN	Нет

3.8 TradeCaptureReport

Тип сообщения – AE, 35=AE

Используется для отчета о сделках между контрагентами.

Используется для сообщения о выставленном адресном ордере.

Отправлено в ответ на запрос отчета о заключении сделки.

Может использоваться для сообщения о несовпадающих и совпадающих сделках.

При передаче информации по сделке FxSwap, следует иметь в виду, что, поле «стоимость», в отличии от web-формы ордера, не передается, а является вычисляемым.

423=2 не передается в ответе.

Возможные атрибуты сообщения:

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
15	Currency	Основная валюта контракта.	CURRENCY	Нет
31	LastPx	Цена сделки	PRICE	Да
32	LastQty	Количество контрактов	QTY	Да
75	TradeDate	Дата регистрации сделки.	LOCALMKTDATE	Нет
120	SettlCurrency	Валюта поставки контракта.	CURRENCY	Нет
423	PriceType	Код единицы изменения цены. Возможные значения: 1 – проценты, 24 – ставка в долях, 12 – спред, 20 – курс.	INT	Да

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
487	TradeReportTransType	Код действия со сделкой. Возможные значения: 0 – новая сделка.	INT	Да
571	TradeReportID	Уникальный идентификатор сообщения. На него может ссылаться ответ на сообщение.	STRING	Да
572	TradeReportRefID	Идентификатор сообщения-запроса, который мы хотим подтвердить с целью передачи сделки на клиринг (если это встречный запрос другого Участника)	STRING	Нет
856	TradeReportType	Код типа сообщения. Возможные значения: 0 - Новая сделка	INT	Да
1123	TradeHandlingInstr	Код способа обработки сообщения принимающей стороной. Возможные значения: 2 - каждая из сторон сообщает свою сторону сделки для мэтчинга в системе	CHAR	Да
component	Instrument	Набор полей, описывающих инструмент. См. пункт 4.1 <u>Instrument.**</u>		Нет

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
component	TrdCapRptSideGrp	<p>Один или два набора полей, описывающих параметры, характерные для каждой стороны сделки. Если в сделке представлена только одна сторона (участники отправляют информацию о сделках независимо друг от друга), то набор полей один. Если в сделке представлены обе стороны (сделку прислала торговая система), то набора полей два – для каждой стороны сделки.</p> <p>См. пункт 4.2 <u>TrdCapRptSideGrp.*</u></p> <p><u>**</u></p>		Да

3.9 Ответы TradeCaptureReport

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Допустимые значения
58	Text	Текст ошибки	STRING	Rejected by clearing engine
572	TradeReportRefID	Идентификатор клиентского запроса	STRING	
573	MatchStatus	Статус мэтчинга	CHAR	1 - Не сравнился, не подтвержденный, не смэтченный
751	TradeReportRejectReason	Причина отклонения	INT	<p>0 = Successful (default)</p> <p>1 = Invalid party information/неверная информация по одной из сторон</p>

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Допустимые значения
				2 = Unknown instrument/неизвестный инструмент 3 = Unauthorized to report trades/не имеет права сообщать о сделках 4 = Invalid trade type/неверный тип сделки 99 = Other/иное 100, 4002, 4001, 5001* Коды расшифрованы ниже
939	TrdRptStatus	Статус запроса	INT	0 = Accepted 1 = Rejected

3.9.1 TradeCaptureReportAck - запрос получен

Тип сообщения AR 35=AR

Используется для подтверждения отчетов о сделках, полученных от контрагента.

Тэг	Название поля	Описание	Значение
571	TradeReportID	В ответ на запрос	
573	MatchStatus	Статус мэтчинга	1
572	TradeReportRefID	Идентификатор клиентского запроса	
856	TradeReportType	Тип торгового отчета, значение	0

3.9.2 TradeCaptureReportAck - запрос принят

Тип сообщения AR. 35=AR

Тэг	Название поля	Описание	Значение
571	TradeReportID	В ответ на запрос	
572	TradeReportRefID	Идентификатор клиентского запроса	
573	MatchStatus	Статус мэтчинга	1
939	TrdRptStatus	Статус запроса	0
856	TradeReportType	Тип торгового отчета, значение	2

3.9.3 TradeCaptureReportAck – ошибка

Тип сообщения AR. 35=AR

Используется для отклонения отчета о сделках, полученного от контрагента.

Тэг	Название поля	Описание	Значение
572	TradeReportRefID	Идентификатор клиентского запроса	
571	TradeReportID	В ответ на запрос	
573	MatchStatus	Статус мэтчинга	1
939	TrdRptStatus	Статус запроса	1
751	TradeReportRejectReason	Причина отклонения	4002
58	Text	Текст ошибки	Rejected by clearing engine
263	SubscriptionRequestType	Получение Snapshot + Updates (Subscribe)	1

3.10 TradeCaptureReportAck Ошибки

Тип сообщения AR. 35=AR

Причина	TradeReportRejectReason	Text
Некорректное заполнение поля NoSides	4002	NoSides=2 не доступен для клиентской учетной записи
Некорректное заполнение поля TradeHandlingInstr	99	TradeHandlingInstr=1 Not supported for client accounts
Некорректное заполнение поля Side	99	Side={side} not supported
Запрос отклонен системой	4002	Rejected by clearing engine
Ошибки в контракте	4002	Document has violations

3.11 BusinessMessageReject Ошибки

Тип сообщения. 35=j, 35=3

Сообщение Business Message Reject может отклонить сообщение уровня приложения, которое соответствует правилам уровня сеанса, и не может быть отклонено каким-либо другим способом.

Обратите внимание, если сообщение не соответствует правилу уровня сеанса (например, длина тела неверна), будет выдано сообщение Reject <3>.

Причина	TradeReportRejectReason	Text
Регистрация ордеров запрещена	1	Order registration prohibited
Повторяющийся идентификатор запроса	5001	Duplicate {field}
Не заполнено обязательное поле	4001	{field} is required
Переданное значение не поддерживается	4002	{field}={value} not supported
Слишком много знаков после запятой в цене	0	Maximum {name} decimal places allowed is {placesAllowed} for PriceType={priceType}, received {places}
Слишком много знаков после запятой в объеме	0	Maximum {name} decimal places allowed is 2, received {places}
Описание контракта не соответствует полям fix	1	{name} not equals to instrument {fixParameter}<>{fpmlParameter}
Недостаточно данных в Parties	0	EXECUTING_SYSTEM not set
Не удалось разобрать SecurityXML	100	SecurityXML incorrect
В Fpml отсутствуют сделки	100	SecurityXML does not contain trades
В Fpml передано больше 1 сделки	100	SecurityXML contain too many trades
В Fpml нет блока OnBehalfOf	100	SecurityXML does not contain OnBehalfOf
В Fpml нет блока Party	100	SecurityXML does not contain Party
В Fpml нет блока Account	100	SecurityXML does not contain Account

3.12 TradeCaptureReportRequest

35=AD

Используется для:

Запроса одного или нескольких отчетов о сделках на основе критериев отбора, указанных в запросе отчета о сделках

Подписки на отчеты о сделках на основе критериев выбора, указанных в запросе отчета

Следующие критерии могут быть указаны в TradeCaptureReportRequest <AD>:

- Все сделки, соответствующие указанной торговой идентификации: TradeReportID <571>, SecondaryTradeReportID <818>
- Все сделки, соответствующие указанным типам сделок: TrdType <828>, TrdSubType <829>, TransferReason <830>, SecondaryTrdType <855>, TradeLinkID <820>
- Все сделки, соответствующие идентификационной информации ордера: OrderId <37>, ClOrdID <11>, ExecID <17>
- Сделки, в которых указан MatchStatus <573>
- Все сделки для партии определены в блоке компонентов <Партии>
- Это может быть идентификатор трейдера, фирма, идентификатор брокера, клиринговая фирма
- Все сделки для определенного инструмента, указанные с помощью блока компонентов <Instrument>, блока компонентов <UnderlyingInstrument> и/или блока компонентов <InstrumentLeg>.
- Все незарегистрированные сделки - Исполнения, которые не были отправлены
- Все непревзойденные сделки - Сделки, которые не были сопоставлены
- Все сделки, соответствующие определенной дате и критериям торговой сессии
- Сделки, введенные через определенный TradeInputSource <578>
- Сделки, заключенные через определенный TradeInputDevice <579>
- Все рекомендации

Каждое поле в TradeCaptureReportRequest <AD> (кроме TradeRequestID <568> и SubscriptionRequestType <263>) идентифицируют фильтры.

Обратите внимание, что фильтры объединяются с использованием подразумеваемого «и» - торговый отчет должен удовлетворять каждому указанному фильтру, который будет возвращен. TradeCaptureReport <AE> сообщения являются обычным типом возврата к TradeCaptureReportRequest <AD>.

Ответ на TradeCaptureReportRequest <AD> может быть следующим:

- Один или несколько отчетов TradeCaptureReport
- TradeCaptureReportRequestAck <AQ> за которым следует один или несколько отчетов о сделках в двух конкретных случаях:
 - Когда отчеты TradeCaptureReport доставляются по внешнему каналу (например, передача файлов),

- Когда существует задержка обработки между временем запроса и моментом отправки отчетов (например, в распределенной торговой среде, где сделки распределяются по нескольким торговым системам).
- TradeCaptureReportRequestAck <AR>
- Если не найдено ни одной сделки, соответствующей критериям отбора, указанным в TradeCaptureReportRequest <AD>
- Когда TradeCaptureReportRequest <AD> был признан контрагентом недействительным по деловым причинам

Тип сообщения - AD

Возможные атрибуты сообщения:

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
568	TradeRequestID	Уникальный идентификатор запроса.	STRING	Да
569	TradeRequestType	Тип запроса в сообщении. Возможные значения: 1 – только сделки, прошедшие мэтчинг в соответствии с критерием мэтчинга, указанным в запросе. 2 – сделки, не прошедшие мэтчинг по критерию, указанному в запросе.	INT	Да
715	ClearingBusinessDate	Дата клиринга для запрашиваемых сделок.	LOCALMKTDATE	Нет
263	SubscriptionRequestType	Код типа подписки. Возможные значения: 0 – получение только snapshot.	CHAR	Да

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
component	Parties	Набор полей, описывающих сторону, для которой должны быть возвращены сделки. См. пункт 4.4 Parties		Нет

3.13 Ответы

3.13.1 TradeCaptureReportRequest – ответы

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Допустимые значения
568	TradeRequestID	Идентификатор клиентского запроса	STRING	
748	TotNumTradeReports	Количество сообщений в ответе	INT	
912	LastRptRequested	Последнее сообщение в ответе на запрос	BOOLEAN	Y = LAST N = NOT_LAST
571	TradeReportID	Идентификатор отчета	STRING	
1003	TradeID	Тикет	STRING	
487	TradeReportTransType	Тип транзакции торгового отчета	INT	0 = NEW
1123	TradeHandlingInstr	Инструкция по обработке сделок	CHAR	0 = TRADE_CONFIRMATION
32	LastQty	Объем	QTY	
423	PriceType	Тип цены	INT	1 – проценты, 12 – спред, 20 – курс, 24 – ставка в долях
31	LastPx	Цена	PRICE	

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Допустимые значения
15	Currency	Основная валюта контракта.	CURRENCY	
120	SettlCurrency	Валюта поставки контракта.	CURRENCY	
541	MaturityDate	Дата	LOCALMKTDAT E	
60	TransactTime	Время	UTCTIMESTAMP	
75	TradeDate	Дата сделки	LOCALMKTDAT E	
573	MatchStatus	Статус сделки/ордера	CHAR	0 = COMPARED 1 = UNCOMPARED
856	TradeReportType	Код типа сообщения.	INT	0 = SUBMIT 3 = DECLINE
150	ExecType	Статус	CHAR	F = TRADE H = TRADE_CANCEL
55	Symbol	Тикер	STRING	[N/A]
22	SecurityIDSource	Схема идентификации и инструмента.	STRING	I = ISDA_FPML_PRODUCT _SPECIFICATION
1185	SecurityXML	Содержит текстовое FrML-описание контракта.	XMLDATA	
1184	SecurityXMLLen	Содержит длину строки SecurityXML с FrML-описанием контракта.	LENGTH	

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Допустимые значения
component	TrdCapRptSideGrp	Набор полей, описывающих количество сторон сделки. См. пункт 4.2 TrdCapRptSide Grp		Обязательность - Да

3.13.2 TradeCaptureReportRequestAck – ошибка

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Допустимые значения
568	TradeRequestID	Идентификатор клиентского запроса	STRING	
569	TradeRequestType	Тип запроса	INT	1 = Matched 2 = Unmached
749	TradeRequestResult	Результат запроса	INT	0 = Successful 3 = Invalid parties 8 = TradeRequestType <569> not supported 9 = Not authorized 99 = Other
750	TradeRequestStatus	Статус запроса	INT	0 = Accepted 1 = Completed 2 = Rejected
58	Text	Текст сообщения	STRING	

3.13.3 TradeCaptureReportRequestAck – ошибки

Причина	TradeRequestStatus	TradeRequestResult	Text
Идентификатор сообщения был использован ранее	1	0	No trades found
Не передан контрагент с ролью EXECUTING_FIRM	2	3	Executing Party not specified
Некорректная роль контрагента	2	3	Requested PartyRole ({0}) is not supported for this request
Повторяющаяся роль в Parties	2	3	Duplicate party role in request
Некорректный контрагент	2	3	Not correct Pty value {0}

Причина	TradeRequestStatus	TradeRequestResult	Text
Не заполнен блок Parties	2	3	Pty not specified
Неподдерживаемый TradeRequestType	2	8	Requested TradeRequestType ({0}) is not supported for this request
Нет прав на контрагента	2	9	Not correct Pty value
Непредвиденная ошибка	2	99	Undefined Error. Contact the administrator

3.13.4 Комбинации запросов

TradeRequestType	EXECUTING_FIRM (1)	CONTRA_FIRM (17)	Результат
Сделки			
1	OUR_FIRM	null	Возвращаем все подтвержденные сделки CURRENT_FIRM
1	null	OUR_FIRM	Ошибка, нельзя запрашивать сделки без указания Участника (Pty1)
1	OUR_FIRM	OUR_FIRM	Будет возвращено пустое множество сделок
1	OTHER_FIRM	null	Ошибка, нет доступа к сделкам участника (Pty с R=1 не соответствует логину)
1	null	OTHER_FIRM	Ошибка, нельзя запрашивать сделки без указания Участника (Pty1)
1	OTHER_FIRM	OTHER_FIRM	Ошибка, нет доступа к сделкам участника (Pty с R=1 не соответствует логину)
1	OUR_FIRM	OTHER_FIRM	Будет возвращено пустое множество сделок
1	OTHER_FIRM	OUR_FIRM	Ошибка, нет доступа к сделкам участника (Pty с R=1 не соответствует логину)
Заявки			
2	OUR_FIRM	null	Возвращаем все выставленные ордера участником OUR_FIRM

TradeRequestType	EXECUTING_FIRM (1)	CONTRA_FIRM (17)	Результат
2	null	OUR_FIRM	Возвращаем все ордера где контрагент OUR_FIRM
2	OUR_FIRM	OUR_FIRM	Будет возвращено пустое множество сделок
2	OTHER_FIRM	null	Ошибка. нельзя запрашивать чужие заявки
2	null	OTHER_FIRM	Ошибка. нельзя запрашивать чужие заявки
2	OTHER_FIRM	OTHER_FIRM	Ошибка. нельзя запрашивать чужие заявки
2	OUR_FIRM	OTHER_FIRM	Все ордера выставленные OUR_FIRM и ожидающие подтверждения от OTHER_FIRM
2	OTHER_FIRM	OUR_FIRM	Все ордера выставленные OTHER_FIRM и ожидающие подтверждения от OUR_FIRM

3.14 NewOrderSingle

Тип сообщения – D, 35=D

Тип сообщения используется для отправки ордера на исполнение.

Возможные атрибуты сообщения:

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
11	CIOrdID	Идентификатор ордера у Участника.	STRING	Да
1	Account	Клиринговый счет Участника, на котором зарегистрирована заявка.	STRING	Да
component	Instrument	Набор полей, описывающих инструмент. См. пункт 4.1 Instrument.		Да
54	Side	Направление сделки. Возможные значения: 1 – покупка, 2 – продажа.	CHAR	Нет
component	OrderQtyData	Набор полей, описывающих количество инструментов в		Да

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
		заявке. См. пункт 4.6 OrderQtyData.		
44	Price	Цена инструмента в заявке.	PRICE	Да
40	OrdType	Тип заявки. Возможные значения: 2 – лимитный ордер (покупаем по указанной цене или ниже, продаем по указанное цене или выше).	CHAR	Да
423	PriceType	Код единицы измерения цены. Возможные значения: 1 – проценты, 12 – спред, 20 – курс, 24 – ставка в долях.	INT	Да
526	SecondaryClOrdID	Дополнительный идентификатор ордера клиента	STRING	Нет

3.14.1 Ответы на NewOrderSingle

Используются для

- подтверждения получения ордера
- подтверждения изменения в существующем ордере (т. Е. принимать запросы на отмену и замену)
- отклонения ордеров (заказов/приказов)

ExecutionReport, 35=8

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Допустимые значения
11	ClOrdID	Клиентский идентификатор ордера	STRING	
37	OrderID	Тикет ордера	STRING	
150	ExecType	Ордер исполнен	CHAR	0 = New/Новый 24 = Filled/Исполнен 4 = Canceled/Отменен 8 = Rejected/отклонен

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Допустимые значения
				A = Pending New/в ожидании нового
17	ExecID	Тикет сделки	STRING	
39	OrdStatus	Статус ордера	CHAR	0 = New 24 = Filled 4 = Canceled 8 = Rejected
1	Account	Клиринговый счет Участника, на котором зарегистрирована заявка.	STRING	
44	Price	Цена	PRICE	
38	OrderQty	Объем	QTY	
54	Side	Направление	PRICE	24 = Buy 2 = Sell
55	Symbol	Тикер	STRING	IRS 4Y KEYRATE
423	PriceType	Тип цены	CHAR	24 – проценты, 12 – спред, 20 – курс, 24 – ставка в долях.
526	SecondaryClOrdID	Дополнительный идентификатор ордера клиента	STRING	Нет
15	Currency	Основная валюта контракта.	CURRENCY	
120	SettlCurrency	Валюта поставки контракта	CURRENCY	
64	SettlDate	Дата начала сделки	LOCALMKTDATE	
541	MaturityDate	Дата окончания сделки	LOCALMKTDATE	

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Допустимые значения
103	OrdRejReason	Причина отклонения	INT	1 = Unknown symbol 2 = Exchange closed 6 = Duplicate Order 13 = Incorrect quantity 15 = Unknown account(s) 16 = Price exceeds current price band 18 = Invalid price increment 99 = Other 4002 =
58	Text	(10017) Trade is registered	STRING	
14	CumQty	Общая сумма исполнения ордера	QTY	
32	LastQty	Сумма последней сделки по ордеру,	QTY	
151	LeavesQty	Неисполненный остаток ордера	QTY	
31	LastPx	Цена этого/последнего исполнения (если сделка прошла по цене отличной от выставленного ордера (лучшая цена или раньше выставленная заявка), тогда в 31 пишем фактическую цену, а в 44 цену выставленного ордера. Тег условно-обязательный, если 150=F(сделка). Получается если цена сделки=цене	PRICE	

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Допустимые значения
		выставленного ордера, то значения в 44 и 31 тегах будут одинаковые. Если 150=0 или снятие заявки 150=4, то не публиковать)		

3.14.2 ExecutionReport - Ордер получен

35=8

Тэг	Название поля	Описание	Значение
11	ClOrdID	Клиентский идентификатор ордера	ClOrdID
39	OrdStatus	Статус ордера	A
150	ExecType	Статус ордера	A
526	SecondaryClOrdID	Дополнительный идентификатор ордера клиента	Client_Comment

3.14.3 ExecutionReport - Ордер зарегистрирован

35=8

Запросы на отмену или отмену/замену ордера выполняются только в том случае, если ордер не был исполнен

Тэг	Название поля	Описание	Пример заполнения
11	ClOrdID	Клиентский идентификатор ордера	ClOrdID
37	OrderID	Тикет ордера	12345
150	ExecType	Ордер зарегистрирован	0
17	ExecID	Идентификатор отчета	158c28fa-876c-4186-890f-87c2b02e9e88
39	OrdStatus	Статус ордера - новый	0
1	Account	Клиринговый счет Участника, на котором зарегистрирована заявка.	MF000000

Тэг	Название поля	Описание	Пример заполнения
44	Price	Цена	3
38	OrderQty	Объем	1000
54	Side	Направление	1
55	Symbol	Тикер	IRS 4Y KEYRATE
423	PriceType	Тип цены	1
526	SecondaryClOrdID	Дополнительный идентификатор ордера клиента	Client_Comment
15	Currency	Основная валюта контракта.	RUB
120	SettlCurrency	Валюта поставки контракта.	RUB
64	SettlDate	Дата начала сделки	20210901
541	MaturityDate	Дата окончания сделки	20220901

3.14.4 ExecutionReport - Ордер исполнен

35=8

Тэг	Название поля	Описание	Пример заполнения
11	ClOrdID	Клиентский идентификатор ордера	ClOrdID
37	OrderID	Тикет ордера	12345
150	ExecType	Ордер исполнен	F
17	ExecID	Тикет сделки	12345
39	OrdStatus	Статус ордера - новый	2
1	Account	Клиринговый счет Участника, на котором зарегистрирована заявка.	MF000000
44	Price	Цена	3
38	OrderQty	Объем	1000
54	Side	Направление	B
55	Symbol	Тикер	IRS 1Y. Mosprime 3M
423	PriceType	Тип цены	1
15	Currency	Основная валюта контракта.	RUB

Тэг	Название поля	Описание	Пример заполнения
120	SettlCurrency	Валюта поставки контракта	RUB
64	SettlDate	Дата начала сделки	20210901
541	MaturityDate	Дата окончания сделки	20220901

3.14.5 ExecutionReport - Ордер отклонен

35=8

Тэг	Название поля	Описание	Значение
11	ClOrdID	Клиентский идентификатор ордера	
39	OrdStatus	Статус ордера	8
150	ExecType	Статус	8
41	OrigClOrdID	Клиентский идентификатор сообщения	
103	OrdRejReason	Причина отклонения	16
17	ExecID	Идентификатор отчета	
37	OrderID	Тикет ордера	NONE
58	Text	Текст ответа	Price exceeds current price band/ Цена превышает текущий ценовой диапазон

3.14.6 ExecutionReport – ошибки

Причина	OrdStatus	ExecType	OrdRejReason	Text
Идентификатор сообщения был использован ранее	8	8	6	Duplicate ClOrdID
Тикер не найден	8	8	1	Symbol={ticker} not supported
Неверный торговый счет	8	8	15	Unknown Account
Неверный контрагент	8	8	15	Unknown Party
Слишком много знаков после запятой в цене	8	8	18	Maximum {name} decimal places allowed is {placesAllowed} for PriceType={priceType}, received {places}

Причина	OrdStatus	ExecType	OrdRejReason	Text
Слишком много знаков после запятой в объеме	8	8	13	Maximum {name} decimal places allowed is 2, received {places}
Переданный объем меньше 0	8	8	13	Amount must be positive value
Некорректный тип цены для инструмента	8	8	99	Incorrect PriceType for instrument
Торги приостановлены	8	8	2	Order registration prohibited
Сделка не является рыночной	8	8	16	Price exceeds current price band
Время исполнения ордера истекло	4	4	99	Order execution timeout
Недостаток гарантийного обеспечения	8	8	4002	Insufficient IM
Ордер отменен т.к. по данному РК существует встречный ордер	8	8	99	This order causes a cross trade
Непредвиденная ошибка	8	8	99	Something went wrong

3.15 OrderCancelRequest

Тип сообщения – F, 35=F

Сообщение запроса на отмену ордера запрашивает отмену всего оставшегося количества существующих ордеров.

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
11	ClOrdID	Уникальный идентификатор запроса на отмену ордера.	STRING	Да
41	OrigClOrdID	Идентификатор сообщения о выставлении ордера, который нужно отменить.	STRING	Нет

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
37	OrderID	Идентификатор ордера, который нужно отменить.	STRING	Нет

3.15.1 ExecutionReport - Ордер снят

Тэг	Название поля	Описание	Значение
11	ClOrdID	Клиентский идентификатор ордера	
39	OrdStatus	Статус ордера	4
150	ExecType	Статус	4
41	OrigClOrdID	Клиентский идентификатор сообщения	
17	ExecID	Идентификатор отчета	
37	OrderID	Тикет ордера	
58	Text	Текст ответа	Cancelled by user

3.15.2 OrderCancelReject - Ошибка отмены ордера

35=9

Выдается в ответ на сообщение об отмене, которое не может быть принято.

При отклонении запроса на массовую отмену ордера значение ClOrdID <11> должно быть установлено равным значению ClOrdID <11> запроса на массовую отмену ордера. OrigClOrdID <41> не указывается для отклоненных запросов на MassCancel.

Тэг	Название поля	Описание	Значение
11	ClOrdID	Клиентский идентификатор ордера	
39	OrdStatus	Статус ордера	Будет передан актуальный статус ордера 0 = New 2 = Filled 4 = Canceled 8 = Rejected
41	OrigClOrdID	Клиентский идентификатор сообщения	
434	CxlRejResponseTo	Ответ на OrderCancelRequest	1 = Order Cancel Request <F>

Тэг	Название поля	Описание	Значение
37	OrderID	Тикет ордера	
102	CxlRejReason	Причина отклонения	Приведены ниже
58	Text	Текст ответа	Cancelled by user

3.15.3 OrderCancelReject - ошибки

Причина	OrdStatus	CxlRejReason	Text
Идентификатор сообщения был использован ранее	8	6	Duplicate ClOrdID
Торги приостановлены	8	2	Order registration prohibited
Непредвиденная ошибка	8	99	Something went wrong
Повторная попытка снятия ордера	8	0	Duplicate Cancel or Replace message for OrderID {orderId} received
Ордер не найден	8	1	Not found
Запрещено снятие ордера на текущем статусе	8	0	Can't cancel

3.16 MarketDataRequest

Это общий запрос рыночных данных по инструментам или валютным котировкам.

Тип сообщения – V, 35 =V

Возможные атрибуты сообщения:

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
262	MDReqID	Уникальный идентификатор запроса. В случае запроса на отмену подписки (SubscriptionRequestType=2) может указываться идентификатор первоначального запроса на подписку.	STRING	Да
263	SubscriptionRequestType	Тип запроса. Возможные значения: 0 – получение текущего состояния рыночных	CHAR	Нет

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
		данных (snapshot). 1 – получение текущего состояния рыночных данных и одновременное оформление подписки на дальнейшие сообщения об изменения рыночных данных по сравнению с этим текущим состоянием. 2 – отмена подписки на сообщения с изменениями рыночных данных.		
264	MarketDepth	Уровень детализации рыночных данных.	INT	Нет
component	MDReqGrp	Набор полей, описывающих запрашиваемые рыночные данные. См. пункт 4.7 MDReqGrp.		Нет
component	InstrmtMDReqGrp	Набор полей, описывающих запрашиваемые рыночные инструменты. См. пункт 4.9 InstrmtMDReqGrp.		Да

3.17 Ответы на MarketDataRequest

3.17.1 MarketDataSnapshotFullRefresh

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Допустимые значения
262	MDReqID	Клиентский идентификатор запроса	STRING	
55	Symbol	Тикер	STRING	
269	MDEntryType	Тип	CHAR	0 = Bid 1 = Offer J = Empty Book

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Допустимые значения
270	MDEntryPx	Цена	PRICE	
423	PriceType	Тип цены	INT	1 = Percentage (IRS,OIS,XCCY) 12 = Price spread (FxSwap) 20 = Fx rate (Fx)
271	MDEntrySize	Объем	QTY	
273	MDEntryTime	Время котировки	UTCTIMEONLY	
272	MDEntryDate	Дата котировки	UTCDATEONLY	

3.17.2 MarketDataRequestReject - Ошибка запроса

Тэг	Название поля	Описание	Значение
262	MDReqID	Клиентский идентификатор запроса	
281	MDReqRejReason	Причина отклонения	Перечислены ниже
58	Text	Текст сообщения	

3.17.3 MarketDataRequest <281>- ошибки

Причина	MDReqRejReason	Text
Идентификатор сообщения был использован ранее	1	Duplicate MDReqID
Тикер не найден	0	Symbol={ticker} not supported
Недопустимое значение поля SubscriptionRequestType	4	{field}={value} not supported
Недопустимое значение поля MDUpdateType	6	{field}={value} not supported
Недопустимое значение поля MDEntryType	8	{field}={value} not supported

3.18 SecurityListRequest

Используется для возврата списка тикеров от биржи, которые соответствуют критериям, указанным в запросе.

Тип сообщения – х, 35=x

Возможные атрибуты сообщения:

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
320	SecurityReqID	Уникальный идентификатор запроса.	STRING	Да
559	SecurityListRequestType	Тип запроса. Возможные значения: 0 – запрашивается шаблонный инструмент/тикер (будет указан в поле Symbol элемента Instrument), 4 – все шаблонные инструменты.	INT	Да
component	Instrument	Наборы полей, описывающих запрашиваемые инструменты. См. пункт 4.1 Instrument.*		Нет

3.19 Примеры SecurityListRequest

3.19.1 SecurityList - Список тикеров

Тэг	Название поля	Описание	Значение
320	SecurityReqID	Клиентский идентификатор запроса	
322	SecurityResponseID	Идентификатор отчета	
393	TotNoRelatedSym	Количество элементов в группе NoRelatedSymGroup	1
55	Symbol	Тикер	IRS 1Y. Mosprime 3M

3.19.2 SecurityList - Детализация по тикеру

Тэг	Название поля	Описание	Значение
320	SecurityReqID	Клиентский идентификатор запроса	

Тэг	Название поля	Описание	Значение
322	SecurityResponseID	Идентификатор отчета	
393	TotNoRelatedSym	Количество элементов в группе NoRelatedSymGroup	1
55	Symbol	Тикер	IRS 1Y. Mosprime 3M
22	SecurityIDSourсе	Схема идентификации инструмента.	I
1185	SecurityXML	Содержит текстовое FpML-описание контракта.	<pre> <?xml version="1.0"?> <dataDocument xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xmlns:xsd="http://www.w3.org/2001/XMLSchema" actualBuild="5" xmlns="http://www.fpml.org/FpML-5/confirmation"> <onBehalfOf> <partyReference href="Party1" /> </onBehalfOf> <trade> <tradeHeader> <tradeDate id="TradeDate">2021-09-03</tradeDate> </tradeHeader> <swap> <productType productTypeScheme="http://www.moex.com/spfi/coding-scheme/product-type">IRS</productType> <swapStream> <payerPartyReference href="Party1" /> <receiverPartyReference href="Party2" /> </swapStream> <calculationPeriodDates> <effectiveDate> <unadjustedDate>2021-09-06</unadjustedDate> <dateAdjustments> <businessDayConvention>MODFOLLOWING</businessDayConvention> <businessCenters> <businessCenter>RUS</businessCenter> <businessCenter>RUMS</businessCenter> </businessCenters> </dateAdjustments> </pre>

Тэг	Название поля	Описание	Значение
			<pre> <adjustedDate>2021-09-06</adjustedDate> </effectiveDate> <terminationDate> <unadjustedDate>2022-09-06</unadjustedDate> <dateAdjustments> <businessDayConvention>MODFOLLOWING</businessDayConvention> <businessCenters> <businessCenter>RUS</businessCenter> <businessCenter>RUMS</businessCenter> </businessCenters> </dateAdjustments> <adjustedDate>2022-09-06</adjustedDate> </terminationDate> <calculationPeriodDatesAdjustments> <businessDayConvention>MODFOLLOWING</businessDayConvention> <businessCenters> <businessCenter>RUS</businessCenter> <businessCenter>RUMS</businessCenter> </businessCenters> </calculationPeriodDatesAdjustments> <stubPeriodType>ShortInitial</stubPeriodType> <calculationPeriodFrequency> <periodMultiplier>1</periodMultiplier> <period>T</period> <rollConvention>NONE</rollConvention> </calculationPeriodFrequency> </calculationPeriodDates> <paymentDates> <calculationPeriodDatesReference href="CalculationPeriodDates" /> <paymentFrequency> <periodMultiplier>1</periodMultiplier> <period>T</period> </paymentFrequency> <payRelativeTo>CalculationPeriodEndDate</payRelativeTo> <paymentDaysOffset> <periodMultiplier>0</periodMultiplier> <period>D</period> </pre>

Тэг	Название поля	Описание	Значение
			<pre> <dayType>Business</dayType> </paymentDaysOffset> <paymentDatesAdjustments> <businessDayConvention>MODFOLLO WING</businessDayConvention> <businessCenters> <businessCenter>RUS</businessCenter> <businessCenter>RUMS</businessCenter> </businessCenters> </paymentDatesAdjustments> </paymentDates> <calculationPeriodAmount> <calculation> <notionalSchedule> <notionalStepSchedule> <initialValue>0</initialValue> <currency>RUB</currency> </notionalStepSchedule> </notionalSchedule> <fixedRateSchedule> <initialValue>0</initialValue> </fixedRateSchedule> <dayCountFraction>ACT/ACT</dayCountFraction> </calculation> </calculationPeriodAmount> </swapStream> <swapStream> <payerPartyReference href="Party2" /> <receiverPartyReference href="Party1" /> /> <calculationPeriodDates> <effectiveDate> <unadjustedDate>2021-09-06</unadjustedDate> <dateAdjustments> <businessDayConvention>MODFOLLO WING</businessDayConvention> <businessCenters> <businessCenter>RUS</businessCenter> <businessCenter>RUMS</businessCenter> </businessCenters> </dateAdjustments> <adjustedDate>2021-09-06</adjustedDate> </effectiveDate> </pre>

Тэг	Название поля	Описание	Значение
			<pre> <terminationDate> <unadjustedDate>2022-09- 06</unadjustedDate> <dateAdjustments> <businessDayConvention>MODFOLLO WING</businessDayConvention> <businessCenters> <businessCenter>RUS</businessCenter> <businessCenter>RUMS</businessCente r> </businessCenters> </dateAdjustments> <adjustedDate>2022-09- 06</adjustedDate> </terminationDate> <calculationPeriodDatesAdjustments> <businessDayConvention>MODFOLLO WING</businessDayConvention> <businessCenters> <businessCenter>RUS</businessCenter> <businessCenter>RUMS</businessCente r> </businessCenters> </calculationPeriodDatesAdjustments> <stubPeriodType>ShortInitial</stubPerio dType> <calculationPeriodFrequency> <periodMultiplier>3</periodMultiplier> <period>M</period> <rollConvention>NONE</rollConventio n> </calculationPeriodFrequency> </calculationPeriodDates> <paymentDates> <calculationPeriodDatesReference href="CalculationPeriodDates1" /> <paymentFrequency> <periodMultiplier>3</periodMultiplier> <period>M</period> </paymentFrequency> <payRelativeTo>CalculationPeriodEndD ate</payRelativeTo> <paymentDaysOffset> <periodMultiplier>0</periodMultiplier> <period>D</period> <dayType>Business</dayType> </paymentDaysOffset> <paymentDatesAdjustments> </pre>

Тэг	Название поля	Описание	Значение
			<pre> <businessDayConvention>MODFOLLO WING</businessDayConvention> <businessCenters> <businessCenter>RUS</businessCenter> <businessCenter>RUMS</businessCenter> </businessCenters> </paymentDatesAdjustments> </paymentDates> <resetDates id="ResetDate"> <calculationPeriodDatesReference href="CalculationPeriodDates1" /> <resetRelativeTo>CalculationPeriodStart Date</resetRelativeTo> <fixingDates> <periodMultiplier>-1</periodMultiplier> <period>D</period> <dayType>Business</dayType> <businessDayConvention>FOLLOWIN G</businessDayConvention> <businessCenters> <businessCenter>MOSPRIME</business Center> </businessCenters> <dateRelativeTo href="ResetDate" /> </fixingDates> <resetFrequency> <periodMultiplier>3</periodMultiplier> <period>M</period> </resetFrequency> <resetDatesAdjustments> <businessDayConvention>MODFOLLO WING</businessDayConvention> <businessCenters> <businessCenter>RUS</businessCenter> <businessCenter>RUMS</businessCenter> </businessCenters> </resetDatesAdjustments> </resetDates> <calculationPeriodAmount> <calculation> <notionalSchedule> <notionalStepSchedule> <initialValue>0</initialValue> <currency>RUB</currency> </notionalStepSchedule> </notionalSchedule> </pre>

Тэг	Название поля	Описание	Значение
			<pre> <floatingRateCalculation> <floatingRateIndex>RUB-MOSPRIME- NFEA</floatingRateIndex> <indexTenor> <periodMultiplier>3</periodMultiplier> <period>M</period> </indexTenor> </floatingRateCalculation> <dayCountFraction>ACT/ACT</dayCou ntFraction> </calculation> </calculationPeriodAmount> </swapStream> </swap> </trade> <party id="Party1" /> <party id="Party2" /> </dataDocument> </pre>
1184	SecurityXMLLen	Содержит длину строки SecurityXML с FrML-описанием контракта.	79551
15	Currency	Основная валюта контракта.	RUB
120	SettlCurrency	Валюта поставки контракта	
64	SettlDate	Дата	
541	MaturityDate	Дата окончательных расчетов по сделке.	20220906

3.19.3 SecurityList - Ошибка запроса

Тэг	Название поля	Описание	Значение
320	SecurityReqID	Клиентский идентификатор запроса	
322	SecurityResponseID	Идентификатор отчета	
560	SecurityRequestResult		Перечислены ниже
393	TotNoRelatedSym	Количество элементов в группе NoRelatedSymGroup	1
58	Text	Тикер	

3.19.4 SecurityList - ошибки

Причина	SecurityRequestResult	Текст
Идентификатор сообщения был использован ранее	1	Duplicate SecurityReqID
Некорректный тип запроса	1	{ field}={ value } not supported

3.20 RequestForPositions

Тип сообщения – AN, 35=AN

Сообщение можно использовать для запроса моментального снимка(snapshot) позиций.

Возможные атрибуты сообщения:

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
710	PosReqID	Уникальный идентификатор запроса.	STRING	Да
component	Parties	Набор полей, описывающих доп. теги позиции. См. пункт 4.4 Parties		Да
715	ClearingBusinessDate	Дата проведения клиринга		Да
60	TransactTime	Время транзакции		Да

3.21 ОтветыPositionReport

Тип сообщения – AP, 35=AP

Возможные атрибуты сообщения:

Тэг	Название поля	Описание	Значение
710	PosReqID	Клиентский идентификатор запроса	
721	PosMaintRptID	Идентификатор отчета	
707	PosAmtType	Тип позиции CASH/CRES/TVAR	CASH
708	PosAmt	Объем позиции	10000
1055	PositionCurrency	Валюта	RUB

3.22 OrderMassCancelRequest

Сообщение запрашивает отмену всего оставшегося количества группы ордеров, соответствующих критериям, указанным в запросе. Это сообщение можно использовать только для отмены сообщений ордеров (уменьшение полного количества).

Запросу присваивается ClOrdID <11>, и он обрабатывается как отдельный объект. Запрос подтверждается сообщением OrderMassCancelReport. OrderMassCancelReport будет содержать ClOrdID <11>, указанный в запросе на OrderMassCancelRequest.

Тип сообщения – q

Возможные атрибуты сообщения:

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
11	ClOrdID	Уникальный идентификатор запроса.	STRING	Да
530	MassCancelRequestType	Тип запроса. Возможные значения: 7 – отмена всех ордеров Участника.	CHAR	Да
60	TransactTime	Дата и время, когда запрос был инициирован.	UTCTIMESTAMP	Да

3.23 OrderMassCancelReport - Примеры ответов

Тэг	Название поля	Описание	Значение
37	OrderID	Идентификатор отчета	
11	ClOrdID	Уникальный идентификатор запроса	
530	MassCancelRequestType	Тип запроса.	7
531	MassCancelResponse	Тип ответа	7
533	TotalAffectedOrders	Количество затронутых ордеров	1
1369	MassActionReportID	Идентификатор отчета	

3.24 OrderMassCancelReport - Ошибка запроса

Тэг	Название поля	Описание	Значение
531	MassCancelResponse	Тип ответа	0
532	MassCancelRejectReason	Причина	0
58	Text	Текст	

4. Описание элементов component

4.1 Instrument**

Возможные атрибуты элемента:

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
55	Symbol	Текстовый код инструмента.	STRING	Нет
48	SecurityID	Идентификатор инструмента согласно схеме,	STRING	Нет

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
		указанной в поле SecurityIDSource.		
22	SecurityIDSource	Схема идентификации инструмента. Возможные значения: Н – идентификатор клирингового центра. I – ISDA FpML нотация инструмента.	STRING	Нет
541	MaturityDate	Дата окончательных расчетов по сделке.	LOCALMKTDATE	Нет
component	SecurityXML	FpML-описание контракта, см. раздел 4.11 SecurityXML.		Нет

4.2 TrdCapRptSideGrp***

Возможные атрибуты элемента:

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
552	NoSides	Номер стороны сделки, по которой приведены характеристики. См. пункт NoPartyIds.	NUMINGROUP	Да

4.3 NoSides

Возможные атрибуты элемента:

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
54	Side	Направление сделки. Возможные значения: 1 – покупка, 2 – продажа.	CHAR	Нет

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
1	Account	Счет на СПФИ Участника стороны сделки, на который букируется сделка.	STRING	Нет
component	Parties	Блок полей, описывающий словарь «бизнес-партнеров», встречающихся в сделке – Участники и третьи лица. Для каждого «бизнес-партнера» присутствует отдельный блок. См. пункт 4.4 Parties.		Да

4.4 Parties

Возможные атрибуты элемента:

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
453	NoPartyIDs	Уникальный в рамках сообщения номер набора полей, описывающий «бизнес-партнера». См. пункт NoPartyIds.	NUMINGROUP	Да

4.5 NoPartyIds

Возможные атрибуты элемента:

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
448	PartyID	Идентификатор «бизнес-партнера».	STRING	Да
447	PartyIDSource	Код типа «бизнес-партнера». Возможные значения: D – юридическое лицо.	CHAR	Да
452	PartyRole	Роль «бизнес-партнера», в которой он выступает в сделке. Возможные значения: 1 – компания, исполнившая ордер,, 11 – трейдер, создавший ордер, 12 – трейдер, исполнивший ордер, 13 – компания, создавшая ордер, 16 – система, исполнившая ордер, 17 – Участник по второй стороне, 21 – клиринговая организация, 24 – клиентский счет,	INT	Да

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
		29 – посредник, 83 – клиринговый счет.		
526	SecondaryClOrdID	Дополнительный идентификатор ордера клиента	STRING	Нет

4.6 OrderQtyData

Возможные атрибуты элемента:

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
38	OrderQty	Количество инструментов в заявке.	QTY	Нет

4.7 MDReqGrp

Возможные атрибуты элемента:

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
267	NoMDEntryTypes	Уникальный номер набора полей, описывающих запрашиваемые рыночные данные. См. пункт NoMDEntryTypes.	NUMINGROUP	Да

4.8 NoMDEntryTypes

Возможные атрибуты элемента:

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
269	MDEntryType	Тип запрашиваемой рыночной информации. Возможные значения: 0 - Bid 1 - Offer	CHAR	Да

4.9 InstrmtMDReqGrp

Возможные атрибуты элемента:

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
146	NoRelatedSym	Уникальный номер набора полей, описывающих	NUMINGROUP	Да

		запрашиваемый инструмент. См. пункт NoRelatedSym.		
--	--	--	--	--

4.10 NoRelatedSym

Возможные атрибуты элемента:

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
component	Instrument	Набор полей, описывающих инструмент. См. пункт 4.1 Instrument.		Да

4.11 SecurityXML

Возможные атрибуты элемента:

Тэг	Название поля	Описание	Тип	Обязательность
1184	SecurityXMLLen	Содержит длину строки SecurityXML с FpML-описанием контракта.	LENGTH	Нет
1185	SecurityXML	Содержит текстовое FpML-описание контракта.	XMLDATA	Да
1186	SecurityXMLSchema	Название FpML-схемы, по которой валидируется FpML-описание контракта в поле SecurityXML.	STRING	Нет