# 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.

# Содержание

[Общая информация 1](#_Toc110935601)

[Содержание 1](#_Toc110935602)

[Типы сообщений 3](#_Toc110935603)

[FIXT 3](#_Toc110935604)

[Logon 4](#_Toc110935605)

[Logout 4](#_Toc110935606)

[TestRequest 4](#_Toc110935607)

[Heartbeat 5](#_Toc110935608)

[ResendRequest 5](#_Toc110935609)

[SequenceReset 6](#_Toc110935610)

[TradeCaptureReport 7](#_Toc110935611)

[Ответы TradeCaptureReport 9](#_Toc110935612)

[TradeCaptureReportAck - запрос получен 10](#_Toc110935613)

[TradeCaptureReportAck - запрос принят 10](#_Toc110935614)

[TradeCaptureReportAck – ошибка 10](#_Toc110935615)

[TradeCaptureReportAck Ошибки 11](#_Toc110935616)

[BusinessMessageReject Ошибки 11](#_Toc110935617)

[TradeCaptureReportRequest 12](#_Toc110935618)

[Ответы 14](#_Toc110935619)

[TradeCaptureReport - ответы 14](#_Toc110935620)

[TradeCaptureReportRequestAck - ошибка 15](#_Toc110935621)

[TradeCaptureReportRequestAck - ошибки 16](#_Toc110935622)

[Комбинации запросов 17](#_Toc110935623)

[NewOrderSingle 18](#_Toc110935624)

[Ответы на NewOrderSingle 19](#_Toc110935625)

[ExecutionReport - Ордер получен 20](#_Toc110935626)

[ExecutionReport - Ордер зарегистрирован 21](#_Toc110935627)

[ExecutionReport - Ордер исполнен 21](#_Toc110935628)

[ExecutionReport - Ордер отклонен 22](#_Toc110935629)

[ExecutionReport - ошибки 23](#_Toc110935630)

[OrderCancelRequest 24](#_Toc110935631)

[Примеры 24](#_Toc110935632)

[ExectuionReport - Ордер снят 24](#_Toc110935633)

[OrderCancelReject - Ошибка отмены ордера 24](#_Toc110935634)

[OrderCancelReject - ошибки 25](#_Toc110935635)

[MarketDataRequest 25](#_Toc110935636)

[Ответы на MarketDataRequest 27](#_Toc110935637)

[MarketDataSnapshotFullRefresh 27](#_Toc110935638)

[MarketDataRequestReject - Ошибка запроса 27](#_Toc110935639)

[MarketDataRequest <281>- ошибки 27](#_Toc110935640)

[SecurityListRequest 28](#_Toc110935641)

[Примеры SecurityListRequest 28](#_Toc110935642)

[SecurityList - Список тикеров 28](#_Toc110935643)

[SecurityList - Детализация по тикеру 29](#_Toc110935644)

[SecurityList - Ошибка запроса 36](#_Toc110935645)

[**SecurityList - ошибки** 36](#_Toc110935646)

[RequestForPositions 36](#_Toc110935647)

[ОтветыPositionReport 36](#_Toc110935648)

[OrderMassCancelRequest 37](#_Toc110935649)

[OrderMassCancelReport - Примеры ответов 37](#_Toc110935650)

[OrderMassCancelReport - Ошибка запроса 37](#_Toc110935651)

[Описание элементов component 38](#_Toc110935652)

[Instrument\*\* 38](#_Toc110935653)

[TrdCapRptSideGrp\*\*\* 38](#_Toc110935654)

[NoSides 39](#_Toc110935655)

[Parties 39](#_Toc110935656)

[NoPartyIds 39](#_Toc110935657)

[OrderQtyData 40](#_Toc110935658)

[MDReqGrp 40](#_Toc110935659)

[NoMDEntryTypes 40](#_Toc110935660)

[InstrmtMDReqGrp 41](#_Toc110935661)

[NoRelatedSym 41](#_Toc110935662)

[SecurityXML 41](#_Toc110935663)

# Типы сообщений

Пользователю FIX API доступны следующие типы сообщений:

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

# 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 |
| 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. *Расчет: FIXT.1.1: "CheckSum Calculation"* | STRING | Да |
| 122 | OrigSendingTime | Первоначальное время отправки сообщения (при ответе на ResendRequest) | UTCTIMESTAMP | Нет |

# Logon

Тип сообщения – A. 35=А

| **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 | DefaultApplVerId | Версия фикс. Всегда FIX50SP2 (9) | INT | Да |

# Logout

Тип сообщения – 5. 35=5

# 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 |

# 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 |

# 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 |

# 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 |

# 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,  2 – за единицу, 24 – курс, 12 – спред, 20 – ставка в долях. | INT | Да |
| 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 [Instrument.\*\*](#_Instrument**) |  | Нет |
| component | TrdCapRptSideGrp | 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. См. пункт [TrdCapRptSideGrp.\*\*\*](#_TrdCapRptSideGrp***) |  | Да |

## 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 смэтченый |
| 751 | TradeReportRejectReason | Причина отклонения | INT | 0 = Successful (default)  1 = Invalid party information/неверная информация по одной из сторон  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 |

### 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 |
| 939 | TradeReportType | Статус запроса | 0 |

### 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 | 1 |

### 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 |  |
| 573 | MatchStatus | Статус мэтчинга | 1 |
| 939 | TrdRptStatus | Статус запроса | 1 |
| 751 | TradeReportRejectReason | Причина отклонения | 4002 |
| 58 | Text | Текст ошибки | Rejected by clearing engine |

## 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 |

## 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 |

# 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>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/tagNum_571.html), [SecondaryTradeReportID <818>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/tagNum_818.html)
* Все сделки, соответствующие указанным типам сделок: [TrdType <828>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/tagNum_828.html), [TrdSubType <829>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/tagNum_829.html), [TransferReason <830>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/tagNum_830.html), [SecondaryTrdType <855>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/tagNum_855.html), [TradeLinkID <820>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/tagNum_820.html)
* Все сделки, соответствующие идентификационной информации [ордера: OrderId <37>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/tagNum_37.html), [ClOrdID <11>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/tagNum_11.html), [ExecID <17>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/tagNum_17.html)
* Сделки, в которых указан [MatchStatus <573>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/tagNum_573.html)
* Все сделки для партии определены в блоке компонентов [<Партии>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/compBlock_Parties.html)
* Это может быть идентификатор трейдера, фирма, идентификатор брокера, клиринговая фирма
* Все сделки для определенного инструмента, указанные с помощью блока компонентов [<Instrument>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/compBlock_Instrument.html), блока компонентов [<UnderlyingInstrument>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/compBlock_UnderlyingInstrument.html) и/или блока компонентов [<InstrumentLeg>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/compBlock_InstrumentLeg.html).
* 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>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/tagNum_578.html)
* Сделки, заключенные через определенный [TradeInputDevice <579>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/tagNum_579.html)
* Все рекомендации

Каждое поле в TradeCaptureReportRequest <AD> (кроме [TradeRequestID <568>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/tagNum_568.html) и [SubscriptionRequestType <263>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/tagNum_263.html)) 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>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/msgType_AD_6568.html).

Ответ на  [TradeCaptureReportRequest <AD>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/msgType_AD_6568.html) может быть следующим:

* Один или несколько отчетов TradeCaptureReport
* [TradeCaptureReportRequestAck <AQ>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/msgType_AQ_6581.html) 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>](#_Ответы_TradeCaptureReport)
* Если не найдено ни одной сделки, соответствующей критериям отбора, указанным в  [TradeCaptureReportRequest <AD>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/msgType_AD_6568.html)
* Когда  [TradeCaptureReportRequest <AD>](https://www.onixs.biz/fix-dictionary/5.0/msgType_AD_6568.html) 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 |

## Ответы

### 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 |  | INT | 0 = NEW |
| 1123 | TradeHandlingInstr |  | CHAR | 0 = TRADE\_CONFIRMATION |
| 32 | LastQty | Объем | QTY |  |
| 423 | PriceType | Тип цены | INT | 1 = PERCENTAGE  2 = PER\_SHARE  3 = FIXED\_AMOUNT  22 = BASIS\_POINTS  24 = RATE |
| 31 | LastPx | Цена | PRICE |  |
| 15 | Currency | Основная валюта контракта. | CURRENCY |  |
| 120 | SettlCurrency | Валюта поставки контракта. | CURRENCY |  |
| 541 | MaturityDate | Дата | LOCALMKTDATE |  |
| 60 | TransactTime | Время | UTCTIMESTAMP |  |
| 75 | TradeDate | Дата сделки | LOCALMKTDATE |  |
| 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 инструмента. | STRING | I = ISDA\_FPML\_PRODUCT\_SPECIFICATION |
| 1185 | SecurityXML | Содержит текстовое FpML-описание контракта. | XMLDATA |  |
| 1184 | SecurityXMLLen | Содержит длину строки SecurityXML с FpML-описанием контракта. | LENGTH |  |

### 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 |  |

## 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} |
| 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 |

## 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 |
| 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 |

# [NewOrderSingle](https://confluence.softwell.ru/display/spfiAPI/NewOrderSingle)

Тип сообщения – D, 35=D

Тип сообщения используется для отправки ордера FX на исполнение.

Возможные атрибуты сообщения:

| **Тэг** | **Название поля** | **Описание** | **Тип** | **Обязательность** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 11 | ClOrdID | 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 Instrument. |  | Да |
| 54 | Side | Направление сделки. Возможные значения: 1 – покупка, 2 – продажа. | CHAR | Нет |
| component | OrderQtyData | Набор полей, описывающих количество инструментов в заявке. См. пункт OrderQtyData. |  | Да |
| 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,  *2 – за единицу,* 24 – курс, 12 – спред, 20 – ставка в долях. | INT | Да |

## 

## Ответы на [NewOrderSingle](https://confluence.softwell.ru/display/spfiAPI/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  2 = Filled/Исполнен  4 = Canceled/Отменен  8 = Rejected/отклонен  A = Pending New/в ожидании нового |
| 17 | ExecID | Тикет сделки | STRING |  |
| 39 | OrdStatus | Статус ордера | CHAR | 0 = New  2 = 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 | 1 = Buy  2 = Sell |
| 55 | Symbol | Тикер | STRING | IRS 1Y. Mosprime 3M |
| 423 | PriceType | Тип цены | CHAR | 1 = PERCENTAGE  2 = PER\_SHARE  3 = FIXED\_AMOUNT  22 = BASIS\_POINTS  24 = RATE |
| 15 | Currency | Основная валюта контракта. | CURRENCY |  |
| 120 | SettlCurrency | Валюта поставки контракта | CURRENCY |  |
| 64 | SettlDate | Дата начала сделки | LOCALMKTDATE |  |
| 541 | MaturityDate | Дата окончания сделки | LOCALMKTDATE |  |
| 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 | Текст ответа: "Order filled partially: N matched". Где N это LastQty (32) объем, на который заявка удовлетворена. | 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 выставленного ордера, то значения в 44 и 31 тегах будут одинаковые. Если 150=0 или снятие заявки 150=4, то не публиковать) | PRICE |  |

### 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 |

### 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 |
| 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 |
| 120 | SettlCurrency | Валюта поставки контракта. | RUB |
| 64 | SettlDate | Дата начала сделки | 20210901 |
| 541 | MaturityDate | Дата окончания сделки | 20220901 |

### 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 |
| 120 | SettlCurrency | Валюта поставки контракта | RUB |
| 64 | SettlDate | Дата начала сделки | 20210901 |
| 541 | MaturityDate | Дата окончания сделки | 20220901 |

### 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 |  |
| 58 | Text | Текст ответа | Price exceeds current price band/ Цена превышает текущий ценовой диапазон |

## 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} |
| 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 |

# [OrderCancelRequest](https://confluence.softwell.ru/display/spfiAPI/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 |
| 37 | OrderID | Идентификатор ордера, который нужно отменить. | STRING | Нет |

## Примеры

### ExectuionReport - 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 |

### 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> |
| 37 | OrderID | Тикет ордера |  |
| 102 | CxlRejReason | Причина отклонения | Приведены ниже |
| 58 | Text | Текст ответа | Cancelled by user |

## 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 |

# [MarketDataRequest](https://confluence.softwell.ru/display/spfiAPI/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 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. | CHAR | Нет |
| 264 | MarketDepth | Уровень детализации рыночных данных. | INT | Нет |
| component | MDReqGrp | Набор полей, описывающих запрашиваемые рыночные данные. См. пункт MDReqGrp. |  | Нет |
| component | InstrmtMDReqGrp | Набор полей, описывающих запрашиваемые рыночные инструменты. См. пункт InstrmtMDReqGrp. |  | Да |

## Ответы на [MarketDataRequest](https://confluence.softwell.ru/display/spfiAPI/MarketDataRequest)

### 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 |
| 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 |  |

### MarketDataRequestReject - Ошибка запроса

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

### 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 |

## [SecurityListRequest](https://confluence.softwell.ru/display/spfiAPI/SecurityListRequest)

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

Тип сообщения – x, 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 Instrument.\* |  | Нет |

## Примеры [SecurityListRequest](https://confluence.softwell.ru/display/spfiAPI/SecurityListRequest)

### 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 |

### SecurityList - Детализация по тикеру

| **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 |
| 22 | SecurityIDSource | Схема идентификации инструмента. | I |
| 1185 | SecurityXML | Содержит текстовое FpML-описание контракта. | <?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" /> <calculationPeriodDates> <effectiveDate> <unadjustedDate>2021-09-06</unadjustedDate> <dateAdjustments> <businessDayConvention>MODFOLLOWING</businessDayConvention> <businessCenters> <businessCenter>RUS</businessCenter> <businessCenter>RUMS</businessCenter> </businessCenters> </dateAdjustments> <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> <dayType>Business</dayType> </paymentDaysOffset> <paymentDatesAdjustments> <businessDayConvention>MODFOLLOWING</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>MODFOLLOWING</businessDayConvention> <businessCenters> <businessCenter>RUS</businessCenter> <businessCenter>RUMS</businessCenter> </businessCenters> </dateAdjustments> <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>3</periodMultiplier> <period>M</period> <rollConvention>NONE</rollConvention> </calculationPeriodFrequency> </calculationPeriodDates> <paymentDates> <calculationPeriodDatesReference href="CalculationPeriodDates1" /> <paymentFrequency> <periodMultiplier>3</periodMultiplier> <period>M</period> </paymentFrequency> <payRelativeTo>CalculationPeriodEndDate</payRelativeTo> <paymentDaysOffset> <periodMultiplier>0</periodMultiplier> <period>D</period> <dayType>Business</dayType> </paymentDaysOffset> <paymentDatesAdjustments> <businessDayConvention>MODFOLLOWING</businessDayConvention> <businessCenters> <businessCenter>RUS</businessCenter> <businessCenter>RUMS</businessCenter> </businessCenters> </paymentDatesAdjustments> </paymentDates> <resetDates id="ResetDate"> <calculationPeriodDatesReference href="CalculationPeriodDates1" /> <resetRelativeTo>CalculationPeriodStartDate</resetRelativeTo> <fixingDates> <periodMultiplier>-1</periodMultiplier> <period>D</period> <dayType>Business</dayType> <businessDayConvention>FOLLOWING</businessDayConvention> <businessCenters> <businessCenter>MOSPRIME</businessCenter> </businessCenters> <dateRelativeTo href="ResetDate" /> </fixingDates> <resetFrequency> <periodMultiplier>3</periodMultiplier> <period>M</period> </resetFrequency> <resetDatesAdjustments> <businessDayConvention>MODFOLLOWING</businessDayConvention> <businessCenters> <businessCenter>RUS</businessCenter> <businessCenter>RUMS</businessCenter> </businessCenters> </resetDatesAdjustments> </resetDates> <calculationPeriodAmount> <calculation> <notionalSchedule> <notionalStepSchedule> <initialValue>0</initialValue> <currency>RUB</currency> </notionalStepSchedule> </notionalSchedule> <floatingRateCalculation> <floatingRateIndex>RUB-MOSPRIME-NFEA</floatingRateIndex> <indexTenor> <periodMultiplier>3</periodMultiplier> <period>M</period> </indexTenor> </floatingRateCalculation> <dayCountFraction>ACT/ACT</dayCountFraction> </calculation> </calculationPeriodAmount> </swapStream> </swap> </trade> <party id="Party1" /> <party id="Party2" /> </dataDocument> |
| 1184 | SecurityXMLLen | Содержит длину строки SecurityXML с FpML-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 |

### 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 |  |

## **SecurityList - ошибки**

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

# [RequestForPositions](https://confluence.softwell.ru/display/spfiAPI/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 |

## 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 |

# [OrderMassCancelRequest](https://confluence.softwell.ru/display/spfiAPI/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 |

## 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 |  |

## OrderMassCancelReport - Ошибка запроса

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

# Описание элементов component

## Instrument\*\*

Возможные атрибуты элемента:

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Тэг** | **Название поля** | **Описание** | **Тип** | **Обязательность** |
| 55 | Symbol | Текстовый код инструмента. | STRING | Нет |
| 48 | SecurityID | Идентификатор инструмента согласно схеме, указанной в поле SecurityIDSource. | STRING | Нет |
| 22 | SecurityIDSource | Схема идентификации инструмента. Возможные значения: H – 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. SecurityXML. |  | Нет |

## TrdCapRptSideGrp\*\*\*

Возможные атрибуты элемента:

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

## NoSides

Возможные атрибуты элемента:

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

## 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 |

## 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, 29 – посредник, 83 – клиринговый счет. | INT | Да |

## OrderQtyData

Возможные атрибуты элемента:

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

## 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 |

## NoMDEntryTypes

Возможные атрибуты элемента:

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

## InstrmtMDReqGrp

Возможные атрибуты элемента:

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Тэг** | **Название поля** | **Описание** | **Тип** | **Обязательность** |
| 146 | NoRelatedSym | Уникальный номер набора полей, описывающих запрашиваемый инструмент. См. пункт NoRelatedSym. | NUMINGROUP | Да |

## NoRelatedSym

Возможные атрибуты элемента:

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

## 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 |