



*ПЕРСПЕКТИВНАЯ
ТОРГОВО-КЛИРИНГОВАЯ
СИСТЕМА*

Трансляция рыночных данных (FIX/FAST 1.1)

Версия системы 1.10

Версия документа 1.7.1

20 сентября 2019

История изменений

Версия 1.7.1 14 декабря 2018 года

1. Изменена структура документа.
2. Изменена терминология в части описания трансляции данных в потоках.

Версия 1.6.0 03 ноября 2017 года

1. Изменена терминология.
2. Добавлены коды ошибок.

Версия 1.5.0 24 апреля 2017 года

Уточнен тип данных для поля LastFragment[893].

Версия 1.4.0 24 декабря 2015 года

1. В потоке [Commons](#) добавлено новое значение поля MDEntryType[269] — b.
2. В потоке [CurrentPriceOfMarket](#) изменен формат сообщения MarketDataIncrementalRefresh[X] для котировок.

Версия 1.3.0 14 декабря

Добавлен новый поток CurrentPriceOfMarket.

Версия 1.2.1 13 мая 2015 года

1. В потоке Commons добавлено новое значение поля MDEntryType[269] — d.
2. Размерность преамбулы FAST-сообщения увеличена с 4 до 8 байт.

Версия 1.2.0 11 февраля 2015 года

1. В потоке Commons добавлено поле OpenCloseSettleFlag[286].
2. Добавлены новые значения для поля MDEntryType[269] в потоке Commons.

Содержание

1. Краткий обзор сервиса	5
1.1. Потоки данных	5
1.2. Режимы трансляции	5
1.3. Каналы трансляции	5
1.4. Алгоритм получения и обработки данных из потоков	5
2. Общая информация о протоколе	7
2.1. Типы данных	7
2.2. Структура сообщений FAST	7
2.3. Структура сообщений шлюза восстановления	8
3. Сообщения в потоках	9
3.1. Поток OrderBook	9
3.2. Поток Trades	10
3.3. Поток CurrentPriceOfMarket	11
3.4. Поток BestPrices	12
3.5. Поток Commons	14
3.6. Тактовые сообщения	17
4. Шлюз восстановления сообщений	19
4.1. Сессионный уровень	19
4.1.1. Инициализация сессии	19
4.1.2. Тактовые сообщения	19
4.1.3. Номера сообщений	20
4.1.4. Завершение сессии	20
4.1.5. Отклонение сообщения	21
4.1.6. Разрыв соединения	21
4.2. Прикладной уровень	21
4.2.1. Запрос данных	21
4.2.2. Отчет о выполнении запроса	22
A. Коды ошибок	24
B. История изменений	32

Список таблиц

1. Формат заголовка сообщения	8
2. Формат трейлера сообщения	8
3. Формат сообщения MarketDataIncrementalRefresh [X] для потока OrderBook	9
4. Формат сообщения MarketDataSnapshotFullRefresh [W] для потока OrderBook	9
5. Формат сообщения MarketDataIncrementalRefresh [X] для потока Trades	10
6. Формат сообщения MarketDataIncrementalRefresh [X] для потока CurrentPriceOfMarket	11
7. Формат сообщения MarketDataIncrementalRefresh [X] для потока BestPrices	12
8. Формат сообщения MarketDataSnapshotFullRefresh [W] для потока BestPrices	13
9. Формат сообщения MarketDataIncrementalRefresh [X] для потока Commons	14
10. Формат сообщения MarketDataSnapshotFullRefresh [W] для потока Commons	16
11. Формат сообщения Heartbeat [0]	17
12. Формат сообщения Logon [A]	19
13. Формат сообщения HeartBeat [0]	20
14. Формат сообщения TestRequest [1]	20
15. Формат сообщения Logout [5]	20
16. Формат сообщения Reject [3]	21
17. Формат сообщения ApplicationMessageRequest [BW]	22
18. Формат сообщения ApplicationMessageRequestAck [BX]	22

1. Краткий обзор сервиса

1.1. Потоки данных

Клиентам торговой системы доступны следующие потоки данных:

1. `OrderBook` — объединенная очередь заявок одного или нескольких пулов ликвидности, агрегированная по ценовым уровням. Количество ценовых уровней: 50.
2. `Trades` — список сделок, заключенных в пулах ликвидности клиентами торговой системы в течение текущего операционного дня.
3. `CurrentPriceOfMarket` — текущая цена рынка, изменяющаяся при заключении сделки или выставлении лучшей заявки.
4. `BestPrices` — лучшие цены покупки и продажи в объединенной очереди заявок.
5. `Commons` — статистические рыночные параметры пулов ликвидности.

Параметры для подключения к потокам перечислены в документе *Адреса для подключения*.

1.2. Режимы трансляции

Потоки `OrderBook`, `BestPrices` и `Commons` транслируют данные в двух режимах — срез и обновления. Потоки `Trades` и `CurrentPriceOfMarket` транслируют только обновления (данные о предыдущих сделках могут быть получены при помощи особого механизма, доступного в последующих версиях).

Срез представляет собой полное описание актуальных данных, например всю очередь заявок, и передается сообщением `MarketDataSnapshotFullRefresh[W]` с заданной периодичностью. Как правило, один срез содержится не в одном, а в нескольких последовательных сообщениях. Значение поля `LastFragment[893]=Y` указывает на последнее сообщение цикла, содержащего один срез. Один срез относится только к одному инструменту, указанному в поле `SecurityID[48]`, сами рыночные данные указаны в повторяющемся компоненте `MDEntry`.

Обновления представляют собой отдельные сообщения `MarketDataIncrementalRefresh[X]`, формируемые и передаваемые клиенту при наступлении события. Одно сообщение `MarketDataIncrementalRefresh[X]` может включать в себя обновления, относящиеся к различным инструментам, само обновление содержится в повторяющемся компоненте `MDEntry`.

В случае отсутствия обновлений система отправляет сообщение с определенной периодичностью. Оно предназначено для подтверждения наличия связи в канале. Отсутствие сообщений в течение длительного периода означает либо задержки, либо отсутствие связи в канале.

1.3. Каналы трансляции

Каждый поток рыночных данных транслируется двумя идентичными UDP-каналами — *A* и *B*. По этим каналам одновременно рассылаются идентичные сообщения с одними и теми же номерами. Дублирование каналов повышает надежность трансляции, значительно снижая вероятность потери пакетов, поскольку протокол UDP не гарантирует ни доставку всех сообщений, ни доставку сообщений в порядке их отправления. Пользователю рекомендуется подключаться к обоим каналам. Так, если в канале *A* после сообщения $n-1$ было получено сообщение $n+1$, то сообщение n могло быть получено в канале *B*. Если сообщение оказалось потеряно в обоих каналах, необходимо либо ожидать получения следующего среза в соответствующем потоке, либо воспользоваться шлюзом восстановления сообщений.

1.4. Алгоритм получения и обработки данных из потоков

Для потоков, транслирующих срезы и обновления, рекомендуется в начале торгового дня подключиться в обоих режимах одновременно, получить полный срез, при этом записывая приходящие обновления. Рекомендуется сохранять сообщения из двух UDP-каналов (каналы *A* и *B*), упорядочивая сообщения по номерам. Если обнаружен пропуск в обновлениях в одном из каналов, пропущенные сообщения можно запросить в шлюзе восстановления (пропущенные сообщения среза восстановить нельзя). Из-за технологических особенностей сообщения передаются в шлюз восстановления не одновременно с сервисом вещания рыночных данных, поэтому сообщения стано-

вятся доступны для восстановления с некоторой задержкой. При значительном количестве потерянных обновлений следует повторно получить срез сообщений в потоке.

Когда срез получен полностью, к нему следует применять обновления. В сообщениях обновлений содержатся текущие инкрементальные изменения вида (а) добавление, (б) изменение или (в) удаление. Инкрементальные обновления должны обрабатываться только в прямом хронологическом порядке, которому соответствуют номера обновлений `RptSeq[83]`. Первым должно быть применено обновление, номер которого на единицу больше номера `RptSeq[83]` из сообщения `MarketDataSnapshotFullRefresh[W]` (номера последнего обновления, отправленного до формирования среза).

2. Общая информация о протоколе

2.1. Типы данных

Тип сообщения, определяемый в поле `MsgType` [35] в заголовке, указан в скобках после названия сообщения.

Наличие поля:

- R [required] — обязательное;
- N [nonrequired] — необязательное;
- C [conditionally required] — необходимое при определенном условии.

Типы данных

`Bool` — логический тип данных. Допустимые значения: Y и N.

`Char` — односимвольный тип данных. Допустимые значения — символы ASCII: латинские буквы, цифры и пунктуационные знаки. Не допустимы бинарный ноль и бинарная единица.

`Int` — целочисленный тип данных.

`Length` — целочисленный тип данных для обозначения длины в байтах.

`MultipleChar` — строковый тип данных, представляет собой односимвольные значения, разделенные пробелом. Например: 18=0 z.

`NumInGroup` — натуральное число для обозначения количества записей в компоненте.

`Price` — десятичная дробь для обозначения цены; разделитель — точка.

`Qty` — натуральное число для обозначения количества лотов ценной бумаги.

`SeqNum` — натуральное число для обозначения порядкового номера сообщения.

`String` — строковый тип данных. Строка может передаваться в любой кодировке; не допустимы бинарный ноль и бинарная единица.

`Timestamp` — строковый тип данных для указания времени с точностью до миллисекунд по Всемирному времени (UTC) в формате `YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss`.

2.2. Структура сообщений FAST

Все сообщения, отправляемые клиенту, сформированы в соответствии с протоколом FIX и закодированы по протоколу FAST. Система использует протокол FIX версии 5 Service Pack 2 и протокол FAST версии 1.1. Версия протокола доступна на портале FIXProtocol.org: <http://www.fixprotocol.org/fast>.

Каждое FAST-сообщение предваряется последовательностью из 8 байт. Она содержит значение поля `MsgSeqNum` [34] в некодированном виде и позволяет узнать номер полученного сообщения без декодирования.

FAST-сообщения могут содержать не все значения, так как в результате кодирования в качестве значений полей могут использоваться (а) константы, описанные в шаблоне, (б) значение по умолчанию при отсутствии заданного значения, (в) предыдущее значение, (г) изменение по отношению к предыдущему значению (дельта или инкремент). Набор предыдущих значений сохраняется в кэше. Набор актуален только для одного UDP-пакета (FAST-сообщения) и сбрасывается перед обработкой каждого последующего сообщения (дельта в этой версии не используется).

Шаблон FAST-сообщений

Для декодирования сообщений используйте шаблон [fast.xml](#). В шаблоне формат транслируемых FAST-сообщений представлен в виде структуры XML. Последовательность XML-элементов соответствует последовательности полей в FAST-сообщении. Имя элемента указывает на используемый тип данных (строковый, целочисленный и т.д.), атрибут `name` содержит имя поля, а атрибут `id` — номер тега по протоколу FIX.

Атрибут `presence="optional"` проставлен для полей, которые могут отсутствовать в сообщении. Обратите внимание, что шаблон описывает структуру сообщений для всех потоков, поэтому атрибут проставлен для поля, которое может отсутствовать в сообщении хотя бы одного потока.

Для каждого элемента указан оператор для декодирования (`constant`, `default`, `copy`, `delta`, `increment`).

2.3. Структура сообщений шлюза восстановления

FAST-сообщения, транслируемые шлюзом восстановления, полностью идентичны тем, которые были отправлены ранее в соответствующем потоке рыночных данных.

Каждое FAST-сообщение предваряется последовательностью из 8 байт. Она содержит значение поля `MsgSeqNum` [34] в некодированном виде и позволяет узнать номер полученного сообщения без декодирования.

Заголовок и трейлер сообщения

Каждое сообщение начинается с заголовка и завершается трейлером.

Фиксированную позицию в заголовке имеют только три поля: первым обязательно идет поле `BeginString`[8]=FIXT.1.1, за ним следует поле `BodyLength`[9] и далее `MsgType`[35]. Значением `BodyLength`[9] является длина сообщения в байтах, которая вычисляется начиная с тега, следующего за `BodyLength`[9], и заканчивая разделителем перед `Checksum`[10].

Таблица 1. Формат заголовка сообщения

Тег	Поле	✓	Тип	Описание
8	<code>BeginString</code>	R	String	Первое поле сообщения Возможные значения: • FIXT.1.1
9	<code>BodyLength</code>	R	Length	Длина тела сообщения в байтах
35	<code>MsgType</code>	R	String	Тип сообщения
49	<code>SenderCompId</code>	R	String	Идентификатор отправителя
56	<code>TargetCompId</code>	R	String	Идентификатор получателя
34	<code>MsgSeqNum</code>	R	SeqNum	Порядковый номер сообщения
52	<code>SendingTime</code>	R	UTCTimestamp	Время передачи сообщения

Трейлер сообщения состоит из тега `Checksum` [10], в который записывается трехбайтная простая контрольная сумма.

Таблица 2. Формат трейлера сообщения

Тег	Поле	✓	Тип	Особенности
10	<code>Checksum</code>	R	String	Контрольная сумма сообщения (три байта)

3. Сообщения в потоках

3.1. Поток OrderBook

В потоке OrderBook транслируются объемы ценовых уровней: срез содержит не более 50 уровней; обновления относятся также к 50 видимым ценовым уровням.

Значение поля MDEntryType[269] равно 0 для котировок в покупку и 1 для котировок в продажу. При этом цена указана в MDEntryPx[270], а суммарный объем заявок на ценовом уровне — в MDEntrySize[271].

Таблица 3. Формат сообщения MarketDataIncrementalRefresh[X] для потока OrderBook

Ter	Поле	Тип	✓	Описание
8	BeginString	String	R	Начальная строка. Значение всегда FIXT.1.1
35	MessageType	String	R	Тип сообщения. Значение всегда X
1128	ApplVerID	String	R	Версия сообщения. Значение всегда 9
49	SenderCompID	String	R	Идентификатор отправителя. Значение всегда BEX
34	MsgSeqNum	int	R	Номер сообщения
52	SendingTime	int	R	Время отправки сообщения
268	NoMDEntries	length	R	Количество записей в компоненте
83	> RptSeq	int	R	Номер обновления инструмента. Соответствует RptSeq[83] в сообщении MarketDataFullSnapshotRefresh[W]
48	> SecurityID	int	R	Идентификатор торгового инструмента
22	> SecurityIDSource	int	R	Идентификатор пула ликвидности
279	> MDUpdateAction	int	R	Тип обновления. Значения: <ul style="list-style-type: none"> • 0 (добавление); • 1 (замена); • 2 (удаление)
269	> MDEntryType	char	R	Тип записи. Значения: <ul style="list-style-type: none"> • 0 (котировка в покупку); • 1 (котировка в продажу)
270	> MDEntryPx	decimal	R	Цена
271	> MDEntrySize	int	R	Суммарный объем заявок на ценовом уровне
272	> MDEntryDate	int	R	Дата обновления
273	> MDEntryTime	int	R	Время обновления

Таблица 4. Формат сообщения MarketDataSnapshotFullRefresh[W] для потока OrderBook

Ter	Поле	Тип	✓	Описание
8	BeginString	String	R	Начальная строка. Значение всегда FIXT.1.1
35	MessageType	String	R	Тип сообщения. Значение всегда W

Тег	Поле	Тип	✓	Описание
1128	AppVerID	String	R	Версия сообщения. Значение всегда 9
49	SenderCompID	String	R	Идентификатор отправителя. Значение всегда ВЕХ
34	MsgSeqNum	int64	R	Номер сообщения
52	SendingTime	int	R	Время отправки сообщения
48	SecurityID	int	R	Идентификатор торгового инструмента
22	SecurityIDSource	int	R	Идентификатор пула ликвидности
83	RptSeq	int	R	Номер обновления инструмента. Соответствует RptSeq[83] в сообщении MarketDataIncrementalRefresh[X]
893	LastFragment	String	R	Признак сообщения, последнего в серии, которая формирует срез по данному инструменту. Значения: <ul style="list-style-type: none"> Y (последнее сообщение, срез сформирован); N (сообщение не последнее, срез еще не сформирован);
268	NoMDEntries	length	R	Количество записей в компоненте
269	> MDEntryType	char	R	Тип записи. Значения: <ul style="list-style-type: none"> 0 (котировка в покупку); 1 (котировка в продажу)
270	> MDEntryPx	decimal	R	Цена
271	> MDEntrySize	int	R	Суммарный объем заявок на ценовом уровне
272	> MDEntryDate	int	R	Дата обновления
273	> MDEntryTime	int	R	Время обновления

3.2. Поток Trades

В потоке Trades транслируются данные о сделках, заключенных в течение торгового дня: при получении от пула ликвидности информации о заключении одной или нескольких сделок формируется сообщение MarketDataIncrementalRefresh[X], в котором каждая сделка представляет собой запись в повторяющемся компоненте.

Получить информацию о сделках, зарегистрированных с начала торгового дня, клиент может с помощью шлюза восстановления сообщений (см. раздел 4).

Значение поля MDEntryType[269] всегда равно 2. При этом цена указана в поле MDEntryPx[270], объем — в MDEntrySize[271], а поле MDEntryID[278] содержит идентификатор сделки, присвоенный пулом ликвидности.

Таблица 5. Формат сообщения MarketDataIncrementalRefresh[X] для потока Trades

Тег	Поле	Тип	✓	Описание
8	BeginString	String	R	Начальная строка. Значение всегда FIXT.1.1
35	MessageType	String	R	Тип сообщения. Значение всегда X
1128	AppVerID	String	R	Версия сообщения. Значение всегда 9
49	SenderCompID	String	R	Идентификатор отправителя. Значение всегда ВЕХ

Ter	Поле	Тип	✓	Описание
34	MsgSeqNum	int	R	Номер сообщения
52	SendingTime	int	R	Время отправки сообщения
268	NoMDEntries	length	R	Количество записей в компоненте
83	> RptSeq	int	R	Номер обновления инструмента
48	> SecurityID	int	R	Идентификатор торгового инструмента
22	> SecurityIDSource	int	R	Идентификатор пула ликвидности
279	> MDUpdateAction	int	R	Тип обновления. Значение: 0 (добавление)
269	> MDEntryType	char	R	Тип записи. Значение всегда 2 (сделка)
270	> MDEntryPx	decimal	R	Цена
271	> MDEntrySize	int	R	Объем
272	> MDEntryDate	int	R	Дата сделки
273	> MDEntryTime	int	R	Время сделки
278	> MDEntryID	int	R	Идентификатор сделки
828	> TrdType	int	R	Тип сделки. Значение: 1 (обычная сделка)

3.3. Поток CurrentPriceOfMarket

В потоке CurrentPriceOfMarket транслируются данные о текущей цене рынка: при получении от пула ликвидности информации об изменении текущей цены рынка формируется сообщение MarketDataIncrementalRefresh[X], в котором каждое сообщение представляет собой запись в повторяющемся компоненте.

Текущая цена рынка рассчитывается непрерывно на основе цен сделок и твердых котировок согласно следующим правилам:

1. при формировании сделки цена становится равной цене сделки;
2. при появлении в очереди анонимной заявки в покупку с ценой, превышающей значение текущей цены рынка, текущая цена рынка приравнивается к цене заявки в покупку;
3. при появлении в очереди анонимной заявки в продажу с ценой, уступающей значению текущей цены рынка, текущая цена рынка приравнивается к цене заявки в продажу.

Получить информацию о сделках и котировках, зарегистрированных с начала торгового дня, клиент может с помощью шлюза восстановления сообщений (см. раздел 4).

Для сделки значение поля MDEntryType[269] всегда равно 2. При этом цена указана в поле MDEntryPx[270], объем — в MDEntrySize[271], а поле MDEntryID[278] содержит идентификатор сделки, присвоенный пулом ликвидности.

Для котировки значение поля MDEntryType[269] равно 0 для котировок в покупку и 1 для котировок в продажу. При этом цена указана в поле MDEntryPx[270], а поля MDEntrySize[271], MDEntryID[278] и TrdType[828] будут отсутствовать.

Таблица 6. Формат сообщения MarketDataIncrementalRefresh[X] для потока CurrentPriceOfMarket

Ter	Поле	Тип	✓	Описание
8	BeginString	String	R	Начальная строка. Значение всегда FIXT.1.1
35	MessageType	String	R	Тип сообщения. Значение всегда x

Ter	Поле	Тип	✓	Описание
1128	AppVerID	String	R	Версия сообщения. Значение всегда 9
49	SenderCompID	String	R	Идентификатор отправителя. Значение всегда ВЕХ
34	MsgSeqNum	int	R	Номер сообщения
52	SendingTime	int	R	Время отправки сообщения
268	NoMDEntries	length	R	Количество записей в компоненте
83	> RptSeq	int	R	Номер обновления инструмента
48	> SecurityID	int	R	Идентификатор торгового инструмента
22	> SecurityIDSource	int	R	Идентификатор пула ликвидности
279	> MDUpdateAction	int	R	Тип обновления. Значение: 0 (добавление)
269	> MDEntryType	char	R	Тип записи. Значения: <ul style="list-style-type: none"> • 0 (котировка в покупку); • 1 (котировка в продажу); • 2 (сделка)
270	> MDEntryPx	decimal	R	Текущая цена рынка
271	> MDEntrySize	int	R	Для сделки — объем
272	> MDEntryDate	int	R	Дата заключения сделки или выставления заявки
273	> MDEntryTime	int	R	Время заключения сделки или выставления заявки
278	> MDEntryID	int	R	Для сделки — идентификатор сделки
828	> TrdType	int	R	Для сделки — тип сделки. Значение: 1 (обычная сделка)

3.4. Поток BestPrices

В потоке BestPrices транслируются сообщения, содержащие ценовой уровень с лучшей ценой в покупку (MDEntryType[269]=0), ценовой уровень с лучшей ценой в продажу (MDEntryType[269]=1) и последнюю сделку (MDEntryType[269]=2) за текущую сессию. В поле MDEntryPx[270] указан ценовой уровень или цена сделки, а в MDEntrySize[271] — суммарный объем заявок на ценовом уровне или объем сделки. Поле MDEntryTime[273] содержит время последнего обновления ценового уровня или время заключения сделки.

Таблица 7. Формат сообщения MarketDataIncrementalRefresh[X] для потока BestPrices

Ter	Поле	Тип	✓	Описание
8	BeginString	String	R	Начальная строка. Значение всегда FIXT.1.1
35	MessageType	String	R	Тип сообщения. Значение всегда X
1128	AppVerID	String	R	Версия сообщения. Значение всегда 9
49	SenderCompID	String	R	Идентификатор отправителя. Значение всегда ВЕХ
34	MsgSeqNum	int	R	Номер сообщения
52	SendingTime	int	R	Время отправки сообщения
268	NoMDEntries	length	R	Количество записей в компоненте

Сообщения в потоках

Тег	Поле	Тип	✓	Описание
83	> RptSeq	int	R	Номер обновления инструмента. Соответствует RptSeq[83] в сообщении MarketDataFullSnapshotRefresh[W]
48	> SecurityID	int	R	Идентификатор торгового инструмента
22	> SecurityIDSource	int	R	Идентификатор торговой площадки
279	> MDUpdateAction	int	R	Тип обновления. Значения: <ul style="list-style-type: none"> • 0 (добавление); • 1 (замена); • 2 (удаление)
269	> MDEntryType	char	R	Тип записи. Значения: <ul style="list-style-type: none"> • 0 (лучшая цена в покупку); • 1 (лучшая цена в продажу); • 2 (последняя сделка в течение текущей сессии)
270	> MDEntryPx	decimal	R	Цена
271	> MDEntrySize	int	R	Суммарный объем заявок на ценовом уровне или объем сделки
272	> MDEntryDate	int	R	Дата обновления
273	> MDEntryTime	int	R	Время последнего обновления ценового уровня или время заключения сделки

Таблица 8. Формат сообщения MarketDataSnapshotFullRefresh[W] для потока BestPrices

Тег	Поле	Тип	✓	Описание
8	BeginString	String	R	Начальная строка. Значение всегда FIXT.1.1
35	MessageType	String	R	Тип сообщения. Значение всегда W
1128	ApplVerID	String	R	Версия сообщения. Значение всегда 9
49	SenderCompID	String	R	Идентификатор отправителя. Значение всегда BEX
34	MsgSeqNum	int64	R	Номер сообщения
52	SendingTime	int	R	Время отправки сообщения
48	SecurityID	int	R	Идентификатор торгового инструмента
22	SecurityIDSource	int	R	Идентификатор пула ликвидности
83	RptSeq	int	R	Номер обновления инструмента. Соответствует RptSeq[83] в сообщении MarketDataIncrementalRefresh[X]
893	LastFragment	String	R	Признак сообщения, последнего в серии, которая формирует срез по данному инструменту. Значения: <ul style="list-style-type: none"> • Y (последнее сообщение, срез сформирован); • N (сообщение не последнее, срез еще не сформирован);

Ter	Поле	Тип	✓	Описание
268	NoMDEntries	length	R	Количество записей в компоненте
269	> MDEntryType	char	R	Тип записи. Значения: <ul style="list-style-type: none"> • 0 (лучшая цена в покупку); • 1 (лучшая цена в продажу); • 2 (последняя сделка)
270	> MDEntryPx	decimal	R	Цена
271	> MDEntrySize	int	R	Суммарный объем заявок на ценовом уровне или объем сделки
272	> MDEntryDate	int	R	Дата обновления
273	> MDEntryTime	int	R	Время последнего обновления ценового уровня или время заключения сделки

3.5. Поток Commons

Тип параметра указан в MDEntryType [269], набор заполняемых полей зависит от указанного типа. Для обновлений сообщение формируется при изменении одного или нескольких статистических параметров. Срез транслируется с определенной периодичностью.

Таблица 9. Формат сообщения MarketDataIncrementalRefresh [X] для потока Commons

Ter	Поле	Тип	✓	Описание
8	BeginString	String	R	Начальная строка. Значение всегда FIXT.1.1
35	MessageType	String	R	Тип сообщения. Значение всегда X
1128	ApplVerID	String	R	Версия сообщения. Значение всегда 9
49	SenderCompID	String	R	Идентификатор отправителя. Значение всегда BEX
34	MsgSeqNum	int	R	Номер сообщения
52	SendingTime	int	R	Время отправки сообщения
268	NoMDEntries	length	R	Количество записей в компоненте
83	> RptSeq	int	R	Номер обновления инструмента. Соответствует RptSeq [83] в сообщении MarketDataFullSnapshotRefresh [W]
48	> SecurityID	int	R	Идентификатор торгового инструмента
22	> SecurityIDSource	int	R	Идентификатор пула ликвидности
279	> MDUpdateAction	int	R	Тип обновления. Значения: <ul style="list-style-type: none"> • 0 (добавление); • 1 (замена); • 2 (удаление)
269	> MDEntryType	char	R	Тип параметра. Значения: <ul style="list-style-type: none"> • 2 (последняя сделка по инструменту); • 4 (цена первой сделки за сессию) - приходит только после первой сделки;

Сообщения в потоках

Тег	Поле	Тип	✓	Описание
				<ul style="list-style-type: none"> • 5 (последняя сделка предыдущей сессии); • 6 (расчетная цена последнего клиринга); • 7 (сделка с максимальной ценой) - приходит только если совершена сделка с ценой большей, чем предыдущая максимальная; • 8 (сделка с минимальной ценой) - приходит только если совершена сделка с ценой меньшей, чем предыдущая минимальная; • 9 (средневзвешенная цена); • A (дисбаланс объемов в аукционе закрытия); • b (текущая цена рынка); • B (оборот в лотах по системным сделкам); • c (объем аукциона закрытия); • d (оборот сделок по цене аукциона закрытия в единицах актива); • f (текущая котировка); • g (оборот последней сделки в валюте цены сделки); • h (изменение текущей цены к официальной цене закрытия предыдущего дня); • i (минимальная текущая цена); • j (цена последней сделки, учтенной в текущей цене); • k (официальная цена закрытия предыдущего дня); • I (рыночная цена 2); • m (рыночная цена 3); • n (расчетная цена последнего основного клиринга); • N (минимальная цена спроса); • o (оборот в лотах); • O (минимальная цена предложения); • p (оборот в единицах актива); • q (оборот в валюте); • r (оборот в единицах актива по системным сделкам); • s (оборот в валюте по системным сделкам); • t (количество всех сделок); • u (количество лотов в покупку); • v (количество лотов в продажу); • w (количество системных сделок); • W (цена аукциона закрытия); • x (количество заявок в покупку); • y (количество заявок в продажу); • z (официальная текущая цена)
270	> MDEntryPx	decimal	N	Цена. Заполняется при MDEntryType[269] = 2, 4, 5, 7, 8, 9, f, n, 6, N, O, W, z, k, I, m, j, i, h, b
271	> MDEntrySize	int	N	Объем. Заполняется при MDEntryType[269] = 2, c, d, r, s, t, o, p, q, x, y, u, v, w, B, g, A
272	> MDEntryDate	int	R	Дата обновления
273	> MDEntryTime	int	R	Время обновления

Сообщения в потоках

Тег	Поле	Тип	✓	Описание
286	> OpenCloseSettleFlag	MultipleChar	N	Индикатор промежутка времени, для которого рассчитан параметр. Заполняется при MDEntryType[269] = 9, k, 2, I, m. Значения: <ul style="list-style-type: none"> • 1 (основная сессия); • 4 (предыдущий день) Возможна комбинация значений. Разделитель — пробел.

Таблица 10. Формат сообщения MarketDataSnapshotFullRefresh[W] для потока Commons

Тег	Поле	Тип	✓	Описание
8	BeginString	String	R	Начальная строка. Значение всегда FIXT.1.1
35	MessageType	String	R	Тип сообщения. Значение всегда W
1128	ApplVerID	String	R	Версия сообщения. Значение всегда 9
49	SenderCompID	String	R	Идентификатор отправителя. Значение всегда BEX
34	MsgSeqNum	int64	R	Номер сообщения
52	SendingTime	int	R	Время отправки сообщения
48	SecurityID	int	R	Идентификатор торгового инструмента
22	SecurityIDSource	int	R	Идентификатор пула ликвидности
83	RptSeq	int	R	Номер обновления инструмента. Соответствует RptSeq[83] в сообщении MarketDataIncrementalRefresh[X]
893	LastFragment	String	R	Признак сообщения, последнего в серии, которая формирует срез по данному инструменту. Значения: <ul style="list-style-type: none"> • Y (последнее сообщение, срез сформирован); • N (сообщение не последнее, срез еще не сформирован);
268	NoMDEntries	length	R	Количество записей в компоненте
269	> MDEntryType	char	R	Тип параметра. Значения: <ul style="list-style-type: none"> • 2 (последняя сделка по инструменту); • 4 (цена первой сделки за сессию); • 5 (последняя сделка предыдущей сессии); • 6 (расчетная цена последнего клиринга); • 7 (сделка с максимальной ценой); • 8 (сделка с минимальной ценой); • 9 (средневзвешенная цена); • b (текущая цена рынка); • c (объем аукциона закрытия); • f (текущая котировка); • n (расчетная цена последнего основного клиринга) • x (количество заявок в покупку); • y (количество заявок в продажу); • u (количество лотов в покупку);

Тег	Поле	Тип	✓	Описание
				<ul style="list-style-type: none"> • v (количество лотов в продажу); • w (количество системных сделок); • B (оборот в лотах по системным сделкам); • r (оборот в единицах актива по системным сделкам); • s (оборот в валюте по системным сделкам); • t (количество всех сделок); • o (оборот в лотах); • p (оборот в единицах актива); • q (оборот в валюте); • N (минимальная цена спроса); • O (минимальная цена предложения); • W (цена аукциона закрытия); • z (официальная текущая цена); • k (официальная цена закрытия предыдущего дня); • g (оборот последней сделки в валюте цены сделки); • I (рыночная цена 2); • m (рыночная цена 3); • A (дисбаланс объемов в аукционе закрытия); • j (цена последней сделки, учтенной в текущей цене); • i (минимальная текущая цена); • h (изменение текущей цены к официальной цене закрытия предыдущего дня)
270	> MDEntryPx	decimal	N	Цена. Заполняется при MDEntryType[269] = 2, 4, 5, 7, 8, 9, f, n, 6, N, O, W, z, k, I, m, j, i, h, b
271	> MDEntrySize	int	N	Объем. Заполняется при MDEntryType[269] = 2, c, r, s, t, o, p, q, x, y, u, v, w, B, g, A
272	> MDEntryDate	int	R	Дата обновления
273	> MDEntryTime	int	R	Время обновления
286	> OpenCloseSettleFlag	MultipleChar	N	Индикатор промежутка времени, для которого рассчитан параметр. Заполняется при MDEntryType[269] = 9, k, 2, I, m. Значения: <ul style="list-style-type: none"> • 1 (основная сессия); • 4 (предыдущий день) <p>Возможна комбинация значений. Разделитель — пробел.</p>

3.6. Тактовые сообщения

Система отправляет сообщение heartbeat[0] в поток обновлений в случае отсутствия других сообщений.

В отдельных случаях сообщение heartbeat[0] может приходиться в срезе.

Таблица 11. Формат сообщения heartbeat[0]

Тег	Поле	Тип	✓	Описание
8	BeginString	String	R	Начальная строка. Значение всегда FIXT.1.1
35	MessageType	String	R	Тип сообщения. Значение всегда 0

Сообщения в потоках

Тег	Поле	Тип	✓	Описание
1128	AppVerID	String	R	Версия сообщения. Значение всегда 9
49	SenderCompID	String	R	Идентификатор отправителя. Значение всегда ВЕХ
34	MsgSeqNum	int64	R	Номер сообщения
52	SendingTime	int	R	Время отправки сообщения

4. Шлюз восстановления сообщений

Шлюз восстановления сообщений с рыночными данными позволяет запросить пересылку обновлений, если они были утеряны при пересылке по UDP.

Шлюз принимает стандартные FIX-сообщения. Все транслируемые шлюзом сообщения (сессионные и прикладные, в том числе восстанавливаемые сообщения с рыночными данными) закодированы согласно стандарту FAST.

Для восстановления сообщения с рыночными данными клиенту необходимо подключиться к шлюзу и запросить диапазон сообщений. Номера сообщений `MsgSeqNum[34]` в потоке восстановления совпадают с номерами сообщения в потоке рыночных данных.

4.1. Сессионный уровень

Сессионный уровень соответствует стандарту FIX Session Protocol 1.1.

FIX-сессия устанавливается в рамках TCP-соединения между одним шлюзом клиента и шлюзом торговой системы. Участники FIX-сессии идентифицируются полями `SenderCompID[49]` и `TargetCompID[56]`.

4.1.1. Инициализация сессии

`Logon[A]` — сообщение, инициализирующее сессию или подтверждающее ее начало. После установления TCP-соединения инициатор сессии (клиент) отправляет это сообщение и ожидает в ответ также `Logon[A]`. Поля `ResetSeqNumFlag[141]`, `Password[554]` заполняются только клиентом, поле `NextExpectedMsgSeqNum[789]` заполняется только торговой системой.

Получение корректного сообщения `Logon[A]` всегда вызывает отправку ответного `Logon[A]`, даже если был указан `MsgSeqNum[34]` больше ожидаемого. Любая ошибка в сообщении `Logon[A]` вызывает разрыв соединения.

Таблица 12. Формат сообщения `Logon[A]`

Тег	Поле	✓	Тип	Описание
	Header	R		Стандартный заголовок
98	EncryptMethod	R	Int	Методы шифрования. Возможные значения: <ul style="list-style-type: none"> 0 (шифрование не поддерживается)
108	HeartBtInt	R	Int	Интервал ожидания. Значение в секундах. Рекомендовано: от 20 до 30
554	Password	N	String	Пароль логина
1137	DefaultApplVerId	R	String	Версия протокола. Возможные значения: <ul style="list-style-type: none"> 9 (FIX50SP2)

4.1.2. Тактовые сообщения

Для контроля состояния соединения клиент и торговая система обмениваются сообщениями `Heartbeat[0]`. Это сообщение должно быть отправлено стороной в случае, если она не передавала никаких сообщений (сессионного либо прикладного уровня) в течение интервала ожидания. Желаемое значение интервала ожидания `HeartBtInt[108]` клиент указывает в сообщении `Logon[A]`; рекомендуемое значение — от 20 до 30 секунд.

При отсутствии сообщений в течение интервала, большего, чем `HeartBtInt[108]`, будет отправлен запрос `TestRequest[1]` с идентификатором `TestReqID[112]`. В ответ на запрос должно прийти сообщение `Heartbeat[0]` с полем `TestReqID[112]`, содержащим тот же идентификатор. При отсутствии ответа на этот запрос (или других сообщений) в течение интервала ожидания система разрывает соединение, предварительно извещая об этом клиента сообщением `Logout[5]`. Клиенту рекомендуется такой же сценарий поведения.

В случае если клиент не желает отправлять и получать тактовые сообщения в рамках этой FIX-сессии, следует указать ноль в поле `HeartBtInt [108]`.

Таблица 13. Формат сообщения `HeartBeat [0]`

Тег	Поле	✓	Тип	Описание
	Header	R		Стандартный заголовок
112	TestReqId	C	String	Идентификатор запроса <code>TestRequest[1]</code> , на который данное сообщение является ответом

Таблица 14. Формат сообщения `TestRequest [1]`

Тег	Поле	✓	Тип	Описание
	Header	R		Стандартный заголовок
112	TestReqId	R	String	Идентификатор данного запроса. Максимальная длина 32 символа. Допустимые символы — латинские буквы и цифры

4.1.3. Номера сообщений

Все сообщения, которыми обмениваются стороны в рамках FIX-сессии, обладают порядковым номером. Он указан в поле `MsgSeqNum [34]` в заголовке каждого сообщения.

Номера в присылаемых клиентом сообщениях игнорируются.

В восстанавливаемых FAST-сообщениях порядковый номер `MsgSeqNum [34]` соответствует номеру оригинального сообщения, которое было отправлено ранее в соответствующем потоке рыночных данных.

4.1.4. Завершение сессии

`Logout [5]` — сообщение, инициирующее или подтверждающее завершение сессии, высылается при длительном отсутствии сообщений (см. раздел [4.1.2](#)); при получении сообщения с номером, меньше ожидаемого.

Причина отклонения указана в теге `SessionStatus [1409]`. В поле `Text [58]` может содержаться отчет о причине завершения сессии.

Таблица 15. Формат сообщения `Logout [5]`

Тег	Поле	✓	Тип	Описание
	Header	R		Стандартный заголовок
1409	SessionStatus	N	Int	Числовой код причины. Заполняется только торговой системой. Возможные значения: <ul style="list-style-type: none"> • 5 (неверный логин или пароль); • 6 (аккаунт заблокирован); • 5000 (нарушен протокол обмена сообщениями); • 5002 (отсутствие активности клиента); • 5003 (остановка сервера); • 5200 (логин уже имеет активную сессию)
58	Text	N	String	Отчет о причине завершения сессии

4.1.5. Отклонение сообщения

Сообщение `Reject` [3] высылается в ответ на любое некорректное сообщение (неверно переданное или неправильно сформированное), пришедшее от противоположной стороны. Причинами отклонения могут являться отсутствие обязательного поля, некорректный тип сообщения, неверная длина сообщения, некорректный тип данных и т.д. Также все сообщения сессионного уровня с неверным значением любого поля отклоняются сообщением `Reject`.

Для идентификации отклоняемого сообщения система заполняет поле `RefSeqNum`[45] номером отклоняемого сообщения. Если системой обнаружено неверное значение определенного поля, то тег будет указан в `RefTagID`[371]. Поле `SessionRejectReason`[373] может содержать код причину отклонения, а поле `Text` [58] — текст ошибки.

Таблица 16. Формат сообщения `Reject` [3]

Тег	Поле	✓	Тип	Описание
	Header	R		Стандартный заголовок
45	<code>RefSeqNum</code>	R	<code>SeqNum</code>	Номер отклоняемого сообщения
371	<code>RefTagId</code>	N	<code>Int</code>	Тег, значение или наличие которого вызвало ошибку
372	<code>RefMsgType</code>	N	<code>String</code>	Тип отклоняемого сообщения
373	<code>SessionRejectReason</code>	N	<code>Int</code>	Причина отклонения. Возможные значения: <ul style="list-style-type: none"> • 0 (некорректный номер тега); • 1 (отсутствует обязательный тег); • 2 (недопустимый в данном сообщении тег); • 4 (тег без значения); • 5 (тег с недопустимым значением); • 6 (тег со значением неверного типа); • 11 (некорректный тип сообщения); • 13 (тег повторяется в сообщении); • 14 (тег <code>Checksum</code>[10] указан не на своем месте); • 15 (тег из группы указан не на своем месте); • 16 (неверно указано количество записей группы)
58	<code>Text</code>	N	<code>String</code>	Отчет об ошибке

4.1.6. Разрыв соединения

TCP-соединение будет разорвано при получении сообщения с ошибкой в одном из трех первых полей (`BeginString` [8], `BodyLength` [9] и `MsgType` [35]) или получении сообщения `Logon` [A] неверного формата или содержащего недопустимые значения.

4.2. Прикладной уровень

4.2.1. Запрос данных

Для восстановления рыночных данных клиент должен отправить в шлюз сообщение `ApplicationMessageRequest` [BW], указав идентификатор FAST-потока.

Диапазон запрашиваемых данных должен быть задан в полях `ApplBegSeqNum` [1182] и `ApplEndSeqNum` [1183] одним из следующих способов:

1. `ApplBegSeqNum`[1182]=*n*, `ApplEndSeqNum`[1183]=*m* — запрос сообщений с *n* до *m*,
2. `ApplBegSeqNum`[1182]=*n*, `ApplEndSeqNum`[1183]=*n* — запрос сообщения *n*,

3. ApplBegSeqNum[1182]=0, ApplEndSeqNum[1183]=n — запрос сообщений начиная с наименьшего доступного номера до n,
4. ApplBegSeqNum[1182]=n, ApplEndSeqNum[1183]=0 — запрос сообщений начиная с n до последнего доступного номера, но не больше, чем максимально доступное количество,
5. ApplBegSeqNum[1182]=0, ApplEndSeqNum[1183]=0 — запрос всех доступных сообщений, но не больше, чем максимально доступное количество.

Идентификаторы FAST-поток и максимальное количество номеров запрашиваемых сообщений приведены в документе *Сетевое подключение*.

В текущей версии возможно запросить только один диапазон одного потока.

При успешном выполнении запроса клиент получит сообщения с рыночными данными, а по завершению передачи данных - отчет ApplicationMessageRequestAck[BX]. При отклонении запроса клиент получит только отчет ApplicationMessageRequestAck[BX].

Таблица 17. Формат сообщения ApplicationMessageRequest[BW]

Тег	Поле	✓	Тип	Описание
1346	ApplReqID	R	String	Идентификатор запроса
1347	ApplReqType	R	Int	Тип запроса. Возможные значения: <ul style="list-style-type: none"> • 0 (перезапрос сообщений)
1351	NoApplIDs	R	NumInGroup	Количество записей в группе ApplIDRequestGroup. Возможные значения: <ul style="list-style-type: none"> • 1
1355	RefApplID	R	String	Идентификатор FAST-потока
1182	ApplBegSeqNum	R	SeqNum	Номер первого сообщения запрашиваемого диапазона
1183	ApplEndSeqNum	R	SeqNum	Номер последнего сообщения запрашиваемого диапазона

4.2.2. Отчет о выполнении запроса

Клиент получает отчет ApplicationMessageRequestAck[BX] в следующих случаях:

1. Завершение передачи данных (ApplResponseType[1348]=0). В поле ApplTotalMessageCount[1349] будет указано количество переданных сообщений.
2. Отклонение запроса данных (ApplResponseType[1348]=1 или 2). В поле ApplResponseError[1354] будет указана причина отклонения.



Из-за технологической задержки передачи данных из сервиса вещания рыночных данных в шлюз восстановления некоторые сообщения могут оказываться недоступными при перезапросе. Если в отчете значение ApplEndSeqNum[1183] меньше указанного в запросе, то следует запросить неполученные сообщения повторно.

Таблица 18. Формат сообщения ApplicationMessageRequestAck[BX]

Тег	Поле	✓	Тип	Описание
1353	ApplResponseID	R	String	Идентификатор ответа на запрос
1346	ApplReqID	R	String	Идентификатор запроса
1347	ApplReqType	R	Int	Тип запроса. Возможные значения: <ul style="list-style-type: none"> • 0 (перезапрос сообщений)

Шлюз восстановления сообщений

Тег	Поле	✓	Тип	Описание
1348	ApplResponseType	R	Int	Тип ответа. В случае отклонения причина указана в поле <code>ApplResponseError[1154]</code> . Возможные значения: <ul style="list-style-type: none"> • 0 (запрос полностью удовлетворен); • 1 (запрос отклонен — поток не найден); • 2 (запрос отклонен — не найдены запрашиваемые сообщения)
1349	ApplTotalMessageCount	R	Int	Количество сообщений, переданных в результате запроса
1351	NoApplIDs	R	NumInGroup	Количество записей в группе <code>ApplIDRequestGroup</code> . Возможные значения: <ul style="list-style-type: none"> • 1
1355	RefApplID	R	String	Идентификатор FAST-потока
1182	ApplBegSeqNum	R	SeqNum	Номер первого сообщения запрашиваемого диапазона
1183	ApplEndSeqNum	R	SeqNum	Номер последнего сообщения, переданного по запросу
1354	ApplResponseError	N	Int	Причина отклонения запроса. Возможные значения: <ul style="list-style-type: none"> • 0 (несуществующий поток); • 1 (недоступные номера сообщений); • 2 (недостаточно прав доступа)

Приложение А. Коды ошибок

Таблица 19. Таблица с описанием кодов ошибок

Код	Описание
0	Ok
5	Имеется незаполненный тэг.
100	Заполнен лишний тэг.
999	Внутренняя ошибка.
1000	Неверный логин.
1001	Неверный инструмент.
1002	Неверный client_id.
1003	Неверный параметр member_id.
1004	Неверный параметр account.
1005	Неверная клиентская группа.
1006	Неверный пул ликвидности.
1007	Инструмент не торгуется.
1008	Неверные параметры маршрутизации.
1100	Неверное направление заявки.
1101	Неверная цена.
1102	Неверный параметр price_extra.
1103	Неверный объём.
1104	Неверный параметр amount_extra.
1105	Неверный тип заявки.
1106	Неверный параметр time_in_force.
1107	Неверный параметр passive_only.
1108	Неверный параметр auto_cancel.
1109	Неверный параметр flags.
1110	Неверный параметр mode.
1111	Неверный параметр clorder_id.
1112	Неверный параметр orig_clorder_id.
1113	Неверный параметр prime_exchange.
1114	Неверный параметр date_expire.
1115	Неверный параметр comment.
1116	Неверный параметр level.

Коды ошибок

Код	Описание
1117	Неверный параметр trade_mode.
1200	Неверный сегмент.
1201	Неверный параметр extra1.
1202	Неверный ОТС код инициатора адресной заявки.
1203	Неверный ОТС код контрагента адресной заявки.
1204	Неверный тип заявки для инструмента.
1205	Неверный тип заявки для пула ликвидности.
1206	Неверный тип заявки для указанного клиента.
1207	Неверная цена для типа заявки.
1208	Неверный дополнительный объём для типа заявки.
1209	Неверный параметр time_in_force для типа заявки.
1210	Неверный параметр flags для типа заявки.
1211	Неверный инструмент для режима перестановки заявки.
1212	Неверный параметр member_id для режима перестановки заявки.
1213	Неверный параметр client_id для режима перестановки заявки.
1214	Неверный параметр account для режима перестановки заявки.
1215	Неверно указаны параметры отклоняемой встречной адресной заявки.
1216	Неверные параметры команды перестановки заявки.
1217	Неверный параметр time_in_force для инструмента.
1218	Неверный режим перестановки заявки для логина.
1219	Неверный параметр flags для инструмента.
1300	Заполнены оба параметра orig_clorder_id и order_id.
1301	Повторение clorder_id для логина.
1302	Цена вне лимитов по инструменту.
1303	Недоступный для клиента тип заявки.
1304	Недоступный для пула ликвидности тип заявки.
1305	Недоступный для маршрутизации остатка по указанному инструменту пул ликвидности.
1306	Указанный пул ликвидности недоступен для клиента.
1307	Указанный тип заявки недоступен для указанного инструмента.
1308	Логин не имеет права снимать заявки указанного ТКС.
1309	Логин не имеет права передвигать заявки указанного ТКС.
1310	Логин не имеет права отклонять данную заявку.

Коды ошибок

Код	Описание
1311	К указанной заявке применяется команда Replace.
1312	Заявка, которая была отправлена до сбоя в торговой системы, а получена уже после восстановления системы.
1313	Недоступный для лимитирования инструмент.
1314	Логин не имеет права использовать данное значение параметра mode.
1315	Участнику клиринга выставлен запрет на отправку заявок в данный пул ликвидности.
1316	Участнику торгов выставлен запрет на отправку заявок в данный пул ликвидности.
1317	Выставлен запрет на отправку заявок с данного логина.
1318	Клиенту выставлен запрет на отправку заявок с данного логина.
1319	ТКС выставлен запрет на отправку заявок с данного логина.
1400	Инструмент не доступен для маркет-мейкера.
1401	Нет прав торговать данным инструментом.
1402	Нет прав на указание опции не сводить с маркет-мейкером.
1403	У клиента нет прав торговать с данного ТКС.
1404	Пул ликвидности не доступен для данного маршрутизатора.
1500	Указаны разные идентификаторы te_id.
1501	Указан неверный идентификатор te_id.
1502	Запрос получен во время обновления параметров ограниченного обеспечения.
1700	У логина нет прав для использования ограниченного обеспечения.
1701	У клиента нет прав для использования ограниченного обеспечения.
1702	У клиентской группы нет прав для использования ограниченного обеспечения.
1703	У ТКС нет прав для использования ограниченного обеспечения.
1704	У главного ТКС нет прав для использования ограниченного обеспечения.
1710	Неверные параметры ограниченного обеспечения для клиента.
1711	Неверные параметры ограниченного обеспечения для группы клиентов.
1712	Неверные параметры ограниченного обеспечения для ТКС.
1713	Неверные параметры ограниченного обеспечения для главного ТКС.
1714	Команда изменения параметров ограниченного обеспечения для клиента получена во время выполнения предыдущей команды.
1715	Команда изменения параметров ограниченного обеспечения для клиентской группы получена во время выполнения предыдущей команды.
1716	Команда изменения параметров ограниченного обеспечения для ТКС получена во время выполнения предыдущей команды.

Коды ошибок

Код	Описание
1717	Команда изменения параметров ограниченного обеспечения для главного ТКС получена во время выполнения предыдущей команды.
1720	Неверный лимит для ограниченного обеспечения.
1721	Неверный лимит по инструменту для ограниченного обеспечения.
1722	Неверный лимит по заявке для ограниченного обеспечения.
1723	Неверный дополнительный лимит для ограниченного обеспечения.
1750	Не выполняется лимит для ограниченного обеспечения на уровне клиента.
1751	Не выполняется лимит по инструменту для ограниченного обеспечения на уровне клиента.
1752	Не выполняется лимит по заявке для ограниченного обеспечения на уровне клиента.
1753	Не выполняется дополнительный лимит для ограниченного обеспечения на уровне клиента.
1754	Не выполняется лимит для ограниченного обеспечения на уровне клиентской группы.
1755	Не выполняется лимит по инструменту для ограниченного обеспечения на уровне клиентской группы.
1756	Не выполняется лимит по заявке для ограниченного обеспечения на уровне клиентской группы.
1757	Не выполняется дополнительный лимит для ограниченного обеспечения на уровне клиентской группы.
1758	Не выполняется лимит для ограниченного обеспечения на уровне ТКС.
1759	Не выполняется лимит по инструменту для ограниченного обеспечения на уровне ТКС.
1760	Не выполняется лимит по заявке для ограниченного обеспечения на уровне ТКС.
1761	Не выполняется дополнительный лимит для ограниченного обеспечения на уровне ТКС.
1762	Не выполняется лимит для ограниченного обеспечения на уровне главного ТКС.
1763	Не выполняется лимит по инструменту для ограниченного обеспечения на уровне главного ТКС.
1764	Не выполняется лимит по заявке для ограниченного обеспечения на уровне главного ТКС.
1765	Не выполняется дополнительный лимит для ограниченного обеспечения на уровне главного ТКС.
1766	У клиента имеются активные заявки ограниченного обеспечения.
1767	У клиентской группы имеются активные заявки ограниченного обеспечения.
1768	У ТКС имеются активные заявки ограниченного обеспечения.
1769	У главного ТКС имеются активные заявки ограниченного обеспечения.
1770	Функционал ограниченного обеспечения приостановлен на уровне клиента.
1771	Функционал ограниченного обеспечения приостановлен на уровне группы клиентов.
1772	Функционал ограниченного обеспечения приостановлен на уровне ТКС.
1773	Функционал ограниченного обеспечения приостановлен на уровне главного ТКС.
1780	Указан неверный пул ликвидности для ограниченного обеспечения.

Коды ошибок

Код	Описание
1800	Указан неверный тип доходности.
1801	Указано неверное направление преобразования доходности.
1980	Неверный параметр stages в поле info.
2100	Неверная пара (member_id, account).
2200	Нет прав на посылку основных торговых приказов.
2201	Выставлен запрет уровня клиентской группы.
2202	Выставлен запрет уровня участника торгов.
2203	Выставлен запрет уровня участника клиринга.
2204	Выставлен запрет уровня администратора.
2300	Нет прав на выставление заявки без проверки достаточности.
2400	Нет прав на удаление заявки.
2600	Нет прав на выставление лимита виртуальному ТКС.
2601	Нет прав на выставление лимита клиенту.
2602	Нет прав на выставление лимита группе клиентов.
2603	Неверный параметр type.
2604	Неверный параметр value.
2605	Совпадение параметров type.
2700	Недостаточно средств на уровне клиента.
2701	Недостаточно активов на уровне клиента.
2702	Недостаточно средств на уровне группы клиентов.
2703	Недостаточно активов на уровне группы клиентов.
2704	Недостаточно средств на уровне ТКС.
2705	Недостаточно активов на уровне ТКС.
2706	Недостаточно средств на уровне главного ТКС.
2707	Недостаточно активов на уровне главного ТКС.
2708	Недостаточно средств на уровне участника клиринга.
2709	Недостаточно заблокированных активов.
3000	Заявка отвергнута аукционом (не было ни сделок, ни постановки в очередь заявок вследствие того, что тип заявки 'рыночная' или 'лимитная ИОС').
3001	Заявка отвергнута аукционом (не было ни сделок, ни постановки в очередь заявок вследствие возможной кросс-сделки).
3002	Заявка отвергнута аукционом (не было ни сделок, ни постановки в очередь заявок вследствие возможного видимого пересечения очереди заявок).

Коды ошибок

Код	Описание
3003	Указанная клиентская заявка не найдена.
3004	Найдена активная блокировка по указанному инструменту.
3005	У логина нет прав торговать данным инструментом в текущий период.
3100	ТКС покупателя и ТКС продавца не имеют признака конверсионного банка.
3911	Неверный идентификатор te_id.
4000	В клиентской заявке указана площадка ECN, но или она неактивна, или неактивен ни один из пулов ликвидности.
4001	В заявке указан пул ликвидности, и он неактивен.
4002	Заявка принудительно маршрутизируется на пул ликвидности, который недоступен. Возможно, при отклонении заявки торговой системой по рискам.
4003	Клиент не зарегистрирован на всех пулах ликвидности, доступных для ECN.
4004	Клиент не зарегистрирован в торговой системе, в которую напрямую направляется заявка.
4005	Клиент не зарегистрирован в пуле ликвидности, в который напрямую направляется заявка.
4006	Заявка не может быть маршрутизирована ни в один пул ликвидности.
4100	Ожидается выполнение удаления данной заявки.
4200	Для ТКС, зарегистрированного в пуле ликвидности, указан неверный клиент.
4201	Указан неверный ТКС для пула ликвидности.
5000	Неверный тип сообщения для прикладного уровня.
5001	Неверный параметр routing_dest.
5002	Неверный тип сообщения для логина.
5003	У логина нет прав для данного типа сообщения.
5200	Логин с данным идентификатором уже имеет активную сессию.
5201	Настройки сервера входа устарели.
5202	Неверный параметр heartbeat.
5203	Неверный логин или пароль.
5204	Неверный номер полученного сообщения.
5205	Неверный тип сообщения для сессионного уровня.
5206	Пользователь не авторизован.
5207	Запрос на переотправку получен во время выполнения предыдущего запроса на переотправку.
5208	Неверный номер сообщения для пересылки.
5209	Неверный параметр reset_seq.
5210	Слишком большой диапазон номеров запрашиваемых сообщений.
5211	Неверный размер сообщения для сессионного уровня.

Коды ошибок

Код	Описание
5212	Соединение разорвано оператором.
5300	Неверный топик.
5301	Срез с обновлениями уже транслируется.
5302	Не запрошен срез с обновлениями.
5303	Запрашиваемых данных нет.
5304	Запрос получен при выполнении предыдущего аналогичного запроса.
5400	Присутствует параметр reset_seq, но сброс номеров сообщения предыдущего соединения не возможен.
5401	Превышен лимит сообщений.
5601	Заполнены оба параметра account и parties.
7000	Заявка удалена до отправки в ASTS.
7001	Удаление заявки, для которой не получен ответ.
13300	Ошибка в уникальном идентификаторе запроса REQUEST_NO
13301	Неправильный отправитель
13302	Депозитарный субсчет/клиринговый счет не найден
13303	Несоответствие полей корпоративного события
13304	Контрольная сумма не сходится
13305	Неправильный код УТ
13306	Несовпадение контрольных остатков
13307	Истекло время приёма раскрытия
13308	Маркировка уже произведена
13309	У переданной группы клиентов повторяется значение в одном из полей ClientCode, ClientRegulatorCode, ExtClientId
13310	Нельзя подавать налоговое раскрытие по неспецдеп. счетам другого участника
13311	Не найден клиент
13312	По счету не предоставлено налоговое раскрытие
13313	Неправильный тип заявки.
13314	Номер заявки не совпадает.
13315	Брокер не найден.
13316	Клиент уже удалён ранее.
13317	Неправильный тип клиента.
13318	Отсутствует налоговый номер.
13319	Отсутствует страна.

Коды ошибок

Код	Описание
13320	Неизвестная страна.
13321	Отсутствует основной адрес.
13322	Отсутствует город в основном адресе.
13323	Отсутствует страна в основном адресе.
13324	Неизвестная страна в основном адресе.
13325	Отсутствует почтовый адрес.
13326	Отсутствует город в почтовом адресе.
13327	Отсутствует страна в почтовом адресе.
13328	Неизвестная страна в почтовом адресе.
13329	Отсутствует имя (first name) на английском.
13330	Отсутствует фамилия (second name) на английском.
13331	Отсутствует имя (first name) на русском.
13332	Отсутствует фамилия (second name) на русском.
13333	Отсутствует название на английском.
13334	Отсутствует GIIN.
13335	Отсутствует статус Chapter 3.
13336	Неправильный статус Chapter 3.
13337	Отсутствует статус Chapter 3 Imy.
13338	Неправильный статус Chapter 3 Imy.
13339	Отсутствует статус Chapter 4.
13340	Неправильный статус Chapter 4.
13341	Отсутствует LOB.
13342	Неправильный LOB.
13343	Отсутствует уточнение для LOB=OTHER.
13344	Отсутствует налоговая ставка.
13345	Неправильная налоговая ставка.
13346	Отсутствует признак отправки отчета 1042-S через брокера.

Также могут приходить ошибки в диапазоне —11000-11999. Это коды ошибок, которые вернула торговая система Московской биржи (ASTS). Чтобы получить номер ошибки торговой системы ASTS, нужно из внутреннего номера ошибки вычесть 11000. Описание таких ошибок клиент может узнать из документации к торговой системе ASTS.

Приложение В. История изменений

Версия 1.1.4 19 ноября 2014 года

Уточнено значение для поля ApplVerID[1128].

Версия 1.1.3 28 октября 2014 года

Уточнены значения для поля MDEntryType[269] в потоке Commons.

Версия 1.1.2 16 октября 2014 года

Актуализирована информация для потока Trades.

Версия 1.1.1 10 октября 2014 года

1. Уточнено описание типа данных Timestamp.
2. Уточнен тип данных поля SendingTime.
3. Добавлены допустимые значения для поля SessionRejectReason.

Версия 1.1 26 августа 2014 года

1. Добавлено описание шлюза восстановления (раздел [4](#)).
2. В потоке Commons добавлено два новых значения поля MDEntryType[269] — W и c.

Версия 0.2 3 июня 2014 года

Добавлен режим срезов в потоке Trades.