

Fx Aggregator

Спецификация FIX

Версия: 2.0.2

Дата: 18/08/2015

Оглавление

1	История документа	3
2	Введение	5
3	Подключение.....	5
3.1	Получение инструментов и котировок (market data session).....	
3.2	Подключение для управления ордерами (trade session)	
4	Управление сессией.....	6
5	Market Data-сессия.....	8
5.1	Поток сообщений	
5.2	Формат сообщений	
6	Trade-сессия	14
6.1	Поддерживаемые типы ордеров и опции	
6.2	Поток управления ордерами	
6.3	Формат сообщений	
7	Приложение 1.....	21

1 История документа

Версия	Дата	Комментарии
1.0	10.09.2009	Базовая версия
1.0.1	06.11.2009	В сообщении Market Data – Snapshot/Full Refresh поле 278 (MDEntryID) заменено на поле 299 (QuoteEntryID).
1.1.0	03.03.2010	Поле 585 (MassStatusReqType) сообщения OrderMassStatusRequest (35=AF) теперь может принимать значение 100 – только активные ордера.
1.1.1	10.03.2010	Исправлены опечатки в значениях некоторых MsgType и номеров тэгов в сообщении SecurityList.
1.2.0	25.02.2011	Добавлен тэг 11010 (MarketDataType) и новый формат получения котировок.
1.2.1	01.03.2011	Устранено состояние ордера "Suspended"
1.2.2	30.06.2011	Добавлены новые значения для поля TimeInForce. Добавлено поле DeliverToCompID
1.2.3	20.07.2011	Добавлено поле с датой валютирования в список инструментов и в котировки
1.3.0	01.02.2012	Добавлено поле 276 (QuoteCondition) в сообщения MarketData–Snapshot/FullRefresh и MarketData–IncrementalRefresh. Добавлено значение 1 (Top of Book) для поля 264 (MarketDepth) в сообщении MarketDataRequest. Добавлено поле 1 (Account) в сообщения NewOrderSingle, ExecutionReport, TradeCaptureReport.
1.3.1	10.09.2012	Модификации п.5.1
1.3.2	20.05.2013	Добавлено поле ContractMultiplier
1.3.3	01.07.2013	Добавлен режим multi-stream pricing (и поле StreamID) Добавлено поле RefPrice в заявке
1.3.4	12.09.2013	В ExecutionReport добавлены TradeDate и TransactTime
1.3.5	18.12.2013	Изменен внешний вид документа, исправлены опечатки в сопроводительном тексте, добавлено описание поля 35
2.0.0	24.01.2014	Поле 264 (MarketDepth) сообщения Market Data Request (35=V) теперь может принимать значение N – глубина стакана. В данной версии отсутствуют: Order Mass Status Request (глава 6.3), Trade Capture Report (глава 6.4). Из поля 150 (ExecutionType) сообщения Execution Report (35=8) значение 2 – Fill заменено на F –Trade, а так же убраны значения: 6 – Pending Cancel, A – Pending New, E – Pending Replace, I – Order Status; из поля 39 того же сообщения убраны: 6 – Pending Cancel, A – Pending New, E – Pending Replace. В случае если вы руководствовались старой документацией, все убранные поля и значения будут продолжать работать в обычном порядке.
2.0.1	29.05.2015	В сообщении Execution Report добавлены новые опциональные поля 11033 (BaseCcy), 11034 (BaseQty), 11035 (TermCcy), 11036 (TermQty) для учета объемов базовой валюты и контрвалюты в последней сделке.

2.0.2	18.08.2015	Добавлено новое поле 15 (Currency), в сообщении Execution Report, раздела New Order Single
-------	------------	--

2 Введение

Данный документ содержит описание интерфейса обмена финансовой информацией (FIX) для торговли валютами при помощи системы Fx Aggregator. Он определяет поддерживаемые интерфейсом виды сообщений (FIX messages) и поля. Рекомендуется изучать данный документ совместно со спецификацией протокола FIX (FIX Protocol Specification). Реализация интерфейса FIX в Fx Aggregator основывается на версии 4.4 FIX Protocol Specification.

Интерфейс FIX поддерживает следующие бизнес-функции:

- получение списка торгуемых инструментов и их параметров
- получение «стакана» заявок по каждому торгуемому инструменту
- выставление/изменение/отмена заявок (ордеров)
- получение отчетов о совершенных сделках

В следующих разделах рассматриваются FIX сессии, используемые клиентом для обмена информацией с системой Fx Aggregator, а также используемый в данном протоколе формат сообщений.

3 Подключение

Для защиты информации от несанкционированного доступа предлагается использовать протокол SSL. Клиент является инициатором подключения к серверу Fx Aggregator при помощи SSL. После установления соединения клиент должен проверить подлинность сервера при помощи сертификата SSL, а затем инициировать стандартный процесс идентификации (FIX logon process).

Для получения котировок (market data) и управления ордерами используются отдельные сессии, что позволяет осуществлять различные настройки в зависимости от характера трафика.

3.1 Получение инструментов и котировок (*market data session*)

Для получения списка инструментов и котировок по ним устанавливается котировочная сессия (market data session). В данной сессии клиентом запрашивается список инструментов (security list), котировки и обновления к ним. FIX-сообщения, отправленные в течение данной сессии, не могут быть восстановлены. При разрыве и последующем восстановлении TCP соединения номера как отосланных, так и полученных сообщений (sequence numbers) будут сброшены в 1. Попытки восстановить недоставленные сообщения не предпринимаются. Клиенты должны перезапрашивать у Fx Aggregator обновление «стакана» заявок для каждого используемого инструмента

3.2 Подключение для управления ордерами (*trade session*)

При помощи данного подключения клиент выставляет ордера и получает отчеты об исполнении и завершении сделок, которые являются признаком завершения каждой торговой операции. Сообщения, отправленные во время торговой сессии, могут быть восстановлены. При разрыве и последующем восстановлении TCP соединения, каждая сторона сессии должна получить все потенциально потерянные сообщения при помощи стандартной процедуры протокола FIX. Порядковые номера (sequence numbers) будут сброшены только в

конец торговой сессии.

Для доступа к системе Smart FX через FIX-шлюз необходимо получить TargetCompId и SenderCompId для каждой сессии.

У каждого клиента также должен быть механизм синхронизации времени. Это дает возможность гарантировать соответствие времени между Fx Aggregator и клиентским терминалом.

4 Управление сессией

Интерфейс Fx Aggregator поддерживает стандартный протокол FIX уровня сессии, в том числе все следующие сессионные сообщения:

- Heartbeat (MsgType = 0);
- Logon (MsgType = A);
- Test Request (MsgType = 1);
- Resend Request (MsgType = 2);
- Reject (MsgType = 3);
- Sequence Reset (MsgType = 4);
- Logout (MsgType = 5).

Стандартный заголовок сообщения

Tag	Field Name	Req'd	Type	Пример
8	BeginString	Y	String	FIX.4.4
9	BodyLength	Y	Length	527
34	MsgSeqNum	Y	SeqNum	1
35	MsgType	Y	String	A
49	SenderCompID	Y	String	'COMPANY'
52	SendingTime	Y	UTCTimeStamp	20090909-09:52:53.927
56	TargetCompID	Y	String	'FXAGGR'
128	DeliverToCompID	N	String	Идентификатор контрагента, если требуется. Например: 'Alfabank'

Стандартный суффикс сообщения

Tag	Field Name	Req'd	Type	Пример
10	CheckSum	Y	String	205

Logon

Tag	Field Name	Req'd	Type	Описание
	Standart Header	Y		MsgType = A
108	HeartBtInt	Y	int	Heartbeat interval в секундах.
98	EncryptMethod	Y	int	Поддерживается только значение 0 – None
141	ResetSeqNumFlag	C	Boolean	Должно быть установлено в N для trade-сессии Должно быть установлено в Y data-сессии
	Standart Trailer	Y		

Сразу после успешного прохождения процедуры Logon в каждой из сессий клиент получает сообщение TradingSessionStatus.

Просим обратить внимание: Клиент не должен отсылать никаких запросов на сервер пока не получит это сообщение.

TradingSessionStatus

Tag	Field Name	Req'd	Type	Описание
	Standart Header	Y		MsgType = h
336	TradingSessionID	Y	String	Наименование сессии. Принимает значения "Market Data" или "Trade".
340	TradSesStatus	Y	int	В настоящей версии всегда имеет значение 2 – Open. В следующих версиях возможны другие состояния сессии.
58	Text	Y	String	Содержит номер версии шлюза в виде «ver. 1.0.0», где первые две группы чисел означают также версию документации.
11020	CAList	N	String	Список доступных контрагентов. Имена контрагентов разделяются символом «;» Пример 1: Alfabank Пример 2: Hotspot;Currenex;FXAll
	Standart Trailer	Y		

5 Market Data-сессия

5.1 Поток сообщений

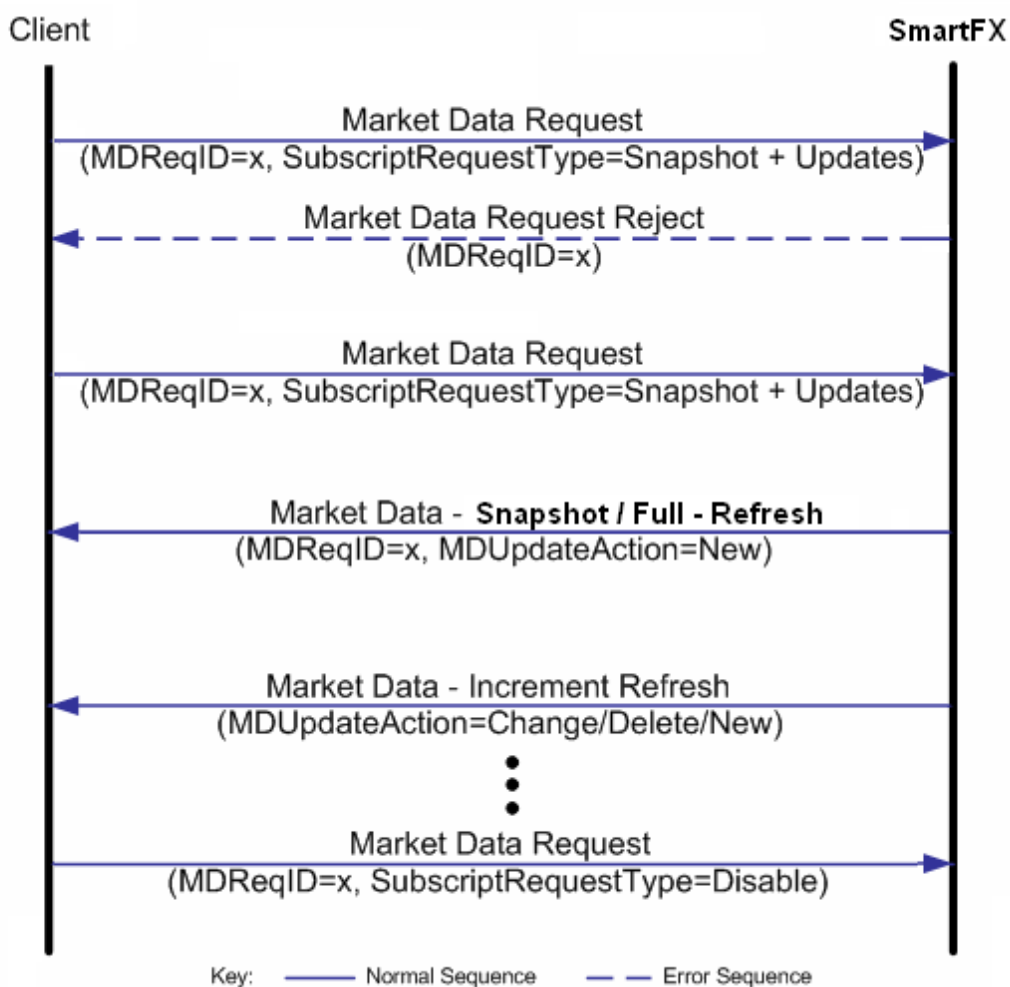
Следующие сообщения отправляются клиентом системе Fx Aggregator:

- Market Data Request
- Security List Request

Следующие сообщения Fx Aggregator отправляет клиенту:

- Market Data Request Reject
- Market Data – Snapshot / Full Refresh
- Market Data - Incremental Refresh
- Security List

Ниже показан типичный обмен сообщениями в рамках data-сессии между клиентом и системой Fx Aggregator:



Следует заметить, что сообщение *Market Data – Snapshot / Full Refresh* может прийти не только сразу после запроса котировок (*Market Data Request*), но и в любой момент в процессе получения котировок. Это связано с необходимостью полного обновления котировок или изменением режима получения котировок. При получении сообщения *Market Data – Snapshot / Full Refresh* все предыдущие котировки по данному инструменту считаются недействительными.

Однако, внеплановое получение сообщения *Market Data – Snapshot / Full Refresh* — явление достаточно редкое. Обычно это происходит не чаще нескольких раз в сутки.

Клиент получает котировки в режиме «Диапазоны объемов». В этом режиме котировки отражают максимально доступные для клиента объемы и цены по ним. Клиент может совершить сделку только по одному из объемов.

Пример. Клиент хочет купить 2 000 000 EUR/USD.

В данный момент он видит следующие котировки:

Цена	Объем
1.3520	1 000 000
1.3521	3 000 000
1.3522	5 000 000
1.3524	10 000 000

Клиент может взять 2 000 000 по 1.3521.

5.2 Формат сообщений

Market Data Request

Tag	Field Name	Req'd	Type	Описание
Standart Header		Y		MsgType = V
262	MDReqID	Y	String	Уникальный идентификатор запроса
263	SubscriptionRequest Type	Y	char	Поддерживаемые типы 1 — Snapshot Plus Updates 2 — Disable Previous Snapshot plus Update Request
264	MarketDepth	Y	int	Поддерживаемые значения: 0 — Full Book 1 — Top of Book* N — глубина стакана
265	MDUpdateType	Y	int	Поддерживаемые типы 1 — Incremental Refresh
267	NoMDEntryTypes	Y	NumInGroup	Всегда = 2 (bid and offer)
→ 269	MDEntryType	Y	char	0 – Bid 1 – Offer
146	NoRelatedSym	Y	NumInGroup	Всегда = 1
→ 55	Symbol	Y	String	Валютная пара в формате CCY1/CCY2
11021	StreamID	N	String	ID потока (только для multi-stream pricing)
Standart Trailer		Y		

* В данном режиме котировки отправляются только с использованием сообщения MarketData–Snapshot/FullRefresh. Сообщение MarketData–IncrementalRefresh при этом не используется.

Market Data – Snapshot/Full Refresh

Tag	Field Name	Req'd	Type	Описание
Standart Header		Y		MsgType = W
262	MDReqID	Y	String	Уникальный идентификатор запроса
55	Symbol	Y	String	Валютная пара в формате CCY1/CCY2
64	SettlDate	N	LocalMktDate	Если приходит, то содержит дату валютирования инструмента
268	NoMDEntries	Y	NumInGroup	Число котировок (заявок в стакане) 0, если котировки отсутствуют (стакан пуст). 1 или 2 для режима TopOfBook (1 лучший бид, если доступен и 1 лучший offer, если доступен)
→ 269	MDEntryType	Y	char	Направление заявки (bid/offer): 0 – Bid 1 – Offer
→ 270	MDEntryPx	Y	Price	Цена заявки
→ 271	MDEntrySize	Y	Qty	Объем заявки

→ 299	QuoteEntryID	Y	String	Идентификатор котировки. Используется в сообщении Market Data – Incremental Refresh (под номером 278 – MDEntryID) при изменении/снятии заявки.
→ 276	QuoteCondition	N	char	Статус котировки: А – активная котировка В – индикативная котировка Если поле отсутствует – активная котировка
11010	MarketDataType	N	int	Тип котировок: 2 – Диапазон объемов
11021	StreamID	N	String	ID потока (только для multi-stream pricing)
Standart Trailer		Y		

Market Data – Incremental Refresh

Tag	Field Name	Req'd	Type	Описание
Standart Header		Y		MsgType = X
262	MDReqID	Y	String	Уникальный идентификатор запроса
64	SettlDate	N	LocalMktDate	Если приходит, то содержит дату валютирования инструмента
268	NoMDEntries	Y	NumInGroup	
→ 279	MDUpdateAction	Y	char	MDUpdateAction_NEW = '0' MDUpdateAction_CHANGE = '1' MDUpdateAction_DELETE = '2'
→ 269	MDEntryType	C	char	MDEntryType_BID = '0' MDEntryType_OFFER = '1'
→ 278	MDEntryID	Y	String	Идентификатор котировки
→ 280	MDEntryRefID	C	String	Идентификатор изменяемой котировки. Присылается только для MDUpdateAction = 1 (Change)
→ 55	Symbol	C	String	Валютная пара в формате CCY1/CCY2
→ 270	MDEntryPx	C	Price	Цена котировки
→ 271	MDEntrySize	C	Qty	Объем котировки
→ 276	QuoteCondition	N	char	Статус котировки: А – активная котировка В – индикативная котировка Если поле отсутствует – активная котировка
11021	StreamID	N	String	ID потока (только для multi-stream pricing)
Standart Trailer		Y		

Market Data Request Reject

Tag	Field Name	Req'd	Type	Описание
Standart Header		Y		MsgType = Y
262	MDReqID	Y	String	Уникальный идентификатор запроса
281	MDReqRejReason	Y	char	В настоящей версии всегда равен 99 — Unknown Reason
58	Text	Y	String	Текстовое описание ошибки
11021	StreamID	N	String	ID потока (только для multi-stream pricing)
Standart Trailer		Y		

Security List Request

Tag	Field Name	Req'd	Type	Описание
Standart Header		Y		MsgType = x
320	SecurityReqID	Y	string	Уникальный идентификатор запроса
559	SecurityListRequestType	Y	int	Поддерживаемые значения: 0 – Symbol
11021	StreamID	N	String	ID потока (только для multi-stream pricing)
Standart Trailer		Y		

Security List

Tag	Field Name	Req'd	Type	Описание
Standart Header		Y		MsgType = y
320	SecurityReqID	Y	string	Уникальный идентификатор запроса
322	SecurityResponseID	Y	string	Уникальный идентификатор ответа
560	SecurityRequestResult	Y	int	Результат обработки запроса: 0 – Valid Request 1 – Invalid or Unsupported Request
146	NoRelatedSym		NumInGroup	Количество инструментов
→ 55	Symbol	Y	string	Валютная пара в формате CCY1/CCY2
→ 64	SettlDate	N	LocalMktDate	Если приходит, то содержит дату валютирования инструмента
→ 11001	BasePoint	N	Price	Размер пункта. Например: 0.0001 для EUR/USD
→ 11002	RatePrecision	N	Price	Точность цены. Например: 0.00001 для EUR/USD
→ 11003	MinReqQty	N	Qty	Минимальный объем выставляемого ордера. Если данное поле отсутствует, ограничения нет.

→ 11004	MaxReqQty	N	Qty	Максимальный объем выставяемого ордера. Если данное поле отсутствует, ограничения нет.
→ 11005	StepReqQty	N	Qty	Минимальный шаг изменения объема ордера. Например: если StepReqQty = 10000, то OrderQty = 100000 и OrderQty = 110000 – правильные объемы, а OrderQty = 105000 – неправильный. Если данное поле отсутствует, ограничения нет.
58	Text	N	string	Описание ошибки
11021	StreamID	N	String	ID потока (только для multi-stream pricing)
	Standart Trailer	Y		

6 Trade-сессия

6.1 Поддерживаемые типы ордеров и опции

Система Fx Aggregator поддерживает следующие типы ордеров:

- **Limit.** Исполняется при достижении рынком указанной цены.
- **Stop-Loss.** Рыночный ордер, активация которого зависит от достижения или преодоления рынком определенного ценового уровня. Например, стоп-лосс ордер на покупку становится рыночным ордером в системе, когда рыночный курс находится на или выше цены стопа, а стоп-лосс ордер на продажу становится рыночным ордером в системе, когда рыночный курс находится на или ниже цены, заявленной в ордере.
- **Market.** Простой ордер на покупку или продажу, который немедленно исполнится системой по лучшей на тот момент цене.

Поддерживаемые типы сроков исполнения ордеров:

- **Good Till Cancel (GTC).** Ордер с таким сроком исполнения остается активным до тех пор, пока либо будет исполнен, либо будет отменен клиентом.
- **Immediate or Cancel (IOC).** Данный ордер немедленно исполняется по ценам из всего стакана Fx Aggregator. Если соответствующих цен найдено не было, ордер или оставшаяся неисполненной часть снимается.

Fx Aggregator поддерживает частичное исполнение ордеров (partial fills).

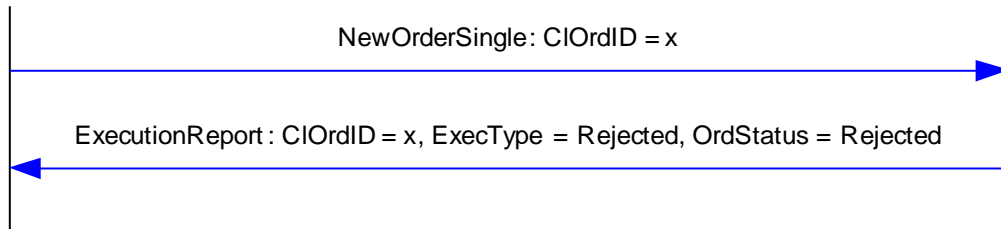
Клиент может изменять или отменять выставленные им ордера. Параметры ордера, такие как объем и цена, могут быть изменены в уже выставленном ордере, при этом его не нужно отменять. Клиент также может отменить выставленный ордер. Отменить можно только неисполненный или частично исполненный ордер. Запрос клиента на изменение или отмену может получить отказ, если в данный момент ордер обрабатывается системой.

В данной версии системы при отключении клиента от шлюза активные ордера не снимаются. Их состояние может быть получено при следующем подключении к серверу.

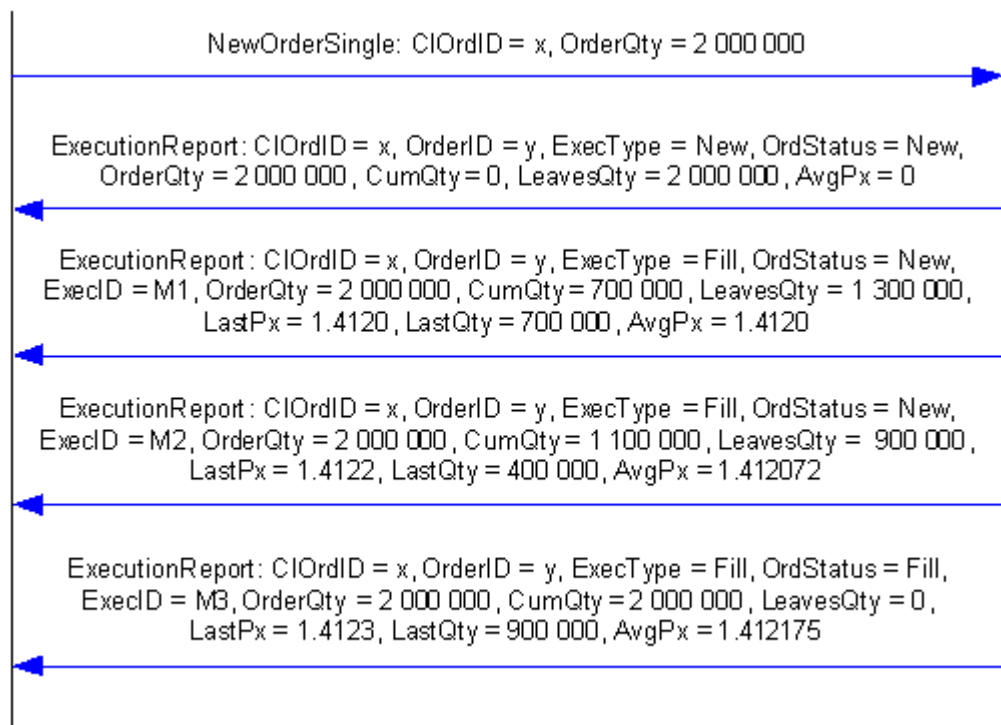
6.2 Поток управления ордерами

Типичный алгоритм установки и исполнения ордера.

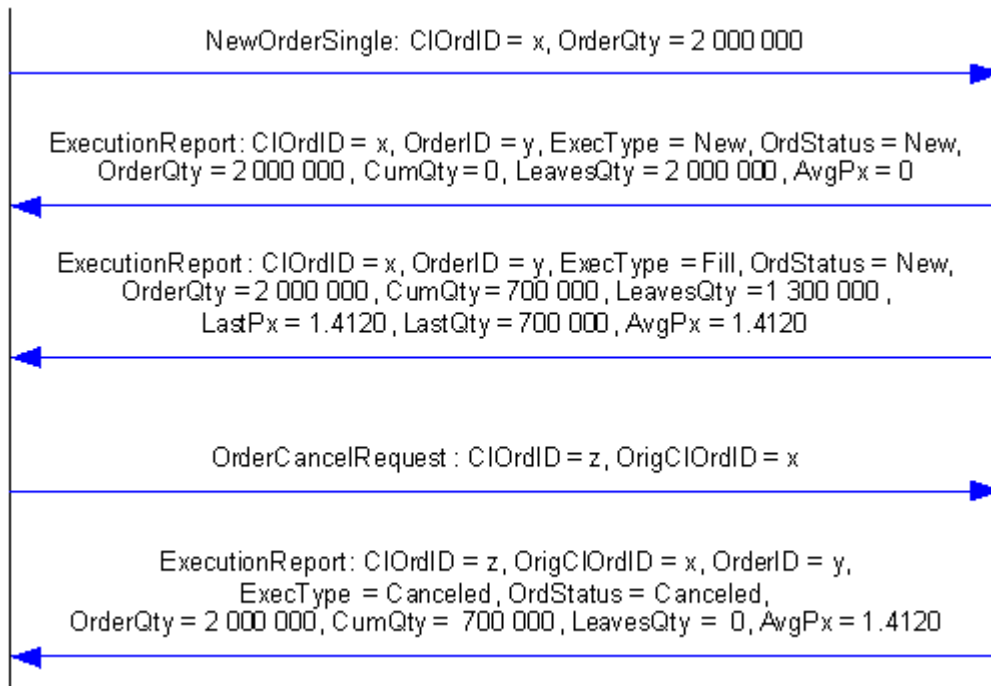
Неудачная установка:



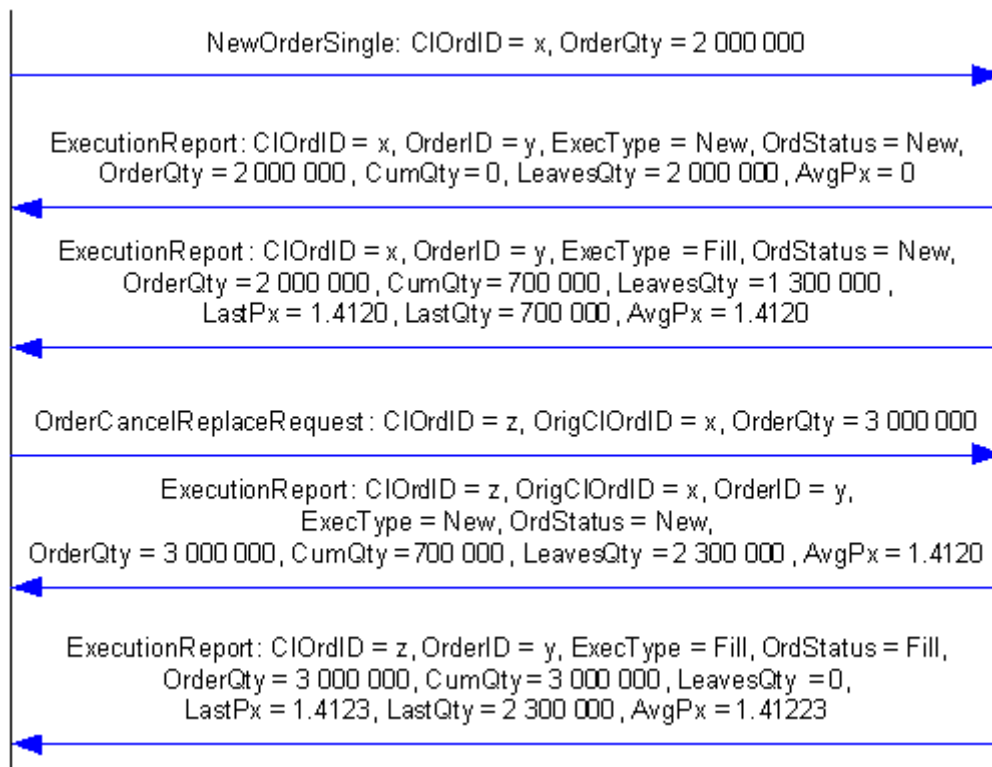
Успешная установка и исполнение:



Типичный алгоритм установки и отмены (в том числе частично исполненного) ордера.



Типичный алгоритм установки и изменения (в том числе частично исполненного) ордера.



6.3 Формат сообщений

New Order - Single

Tag	Field Name	Req'd	Type	Описание
Standart Header		Y		MsgType = D
1	Account	N	string	Позволяет указать счет, на котором будет совершена сделка. Может использоваться по согласованию с провайдером ликвидности.
11	ClOrdID	Y	string	Уникальный идентификатор запроса
21	HandlInst	N	char	Допустимые значения: 1 – Automated Execution Order Private 2 – Automated Execution Order Public В данной версии не обрабатывается.
55	Symbol	Y	string	Валютная пара в формате CCY1/CCY2
54	Side	Y	char	Допустимые значения: 1 – Buy 2 – Sell
60	TransactTime	Y	UTCTimestamp	Время создания запроса на ордер трейдером или торговой системой
38	OrderQty	Y	Qty	Объем выставляемого ордера в базовой валюте
40	OrdType	Y	char	Допустимые значения: 1 – Market 2 – Limit 3 – Stop
44	Price	Y	Price	Цена срабатывания ордера. Для Market-ордера (тэг 40 = 1) игнорируется.
59	TimeInForce	Y	Char	Допустимые значения: 1 – Good Till Cancel (GTC) 3 – Immediate or Cancel (IOC) 101 – Good Till Time 102 – Good During Time
126	ExpireTime	C	UTCTimestamp	Время жизни ордера. Требуется при TimeInForce = 101 или 102
210	MaxShow	N	Qty	Если отсутствует, тогда MaxShow = OrderQty
11030	RefPrice	N	Price	Справочная цена
Standart Trailer		Y		

Примечание.

Для TimeInForce = Good Till Time (101) поле ExpireTime задает дату и время истечения ордера. Например, ExpireTime = '20110630-15:30:00' означает, что 30 июня 2011 года в 15:30:00 UTC ордер (или его неисполненный остаток) будет автоматически снят.

Для TimeInForce = Good During Time (102) поле ExpireTime задает время жизни ордера после его установки. При этом используется только часть поля, содержащая время. Например, ExpireTime = '00000000-00:01:30' означает, что ордер (или его неисполненный остаток) будет автоматически снят через 1 минуту 30 секунд после установки.

Execution Report

Tag	Field Name	Req'd	Type	Описание
	Standart Header	Y		MsgType = 8
1	Account	N	String	Значение из запроса NewOrder-Single
37	OrderID	C	String	Идентификатор ордера, назначаемый Fx Aggregator Отсутствует при ExecType = '8' (Rejected)
11	ClOrdID	Y	String	Уникальный идентификатор запроса
41	OrigClOrdID	C	String	Требуется при ответе на запрос Cancel or Cancel/Replace. (ExecType=PendingCancel, Replace, или Canceled). В случае отмены или изменения ордера ClOrdID ранее принятого ордера.
17	ExecID	Y	String	Уникальный идентификатор сообщения ExecutionReport
150	ExecType	Y	char	Допустимые значения: 0 – New (Active) F – Trade* 4 – Canceled 5 – Replaced 8 – Rejected C – Expired
39	OrdStatus	Y	char	Допустимые значения: 0 – New (Active) 2 – Fill 4 – Canceled 8 – Rejected C – Expired
103	OrdRejReason	C	int	Указывает на причину при ExecType = '8' (Rejected)
55	Symbol	Y	String	Валютная пара в формате CCY1/CCY2
15	Currency	N	String	Валюта сделки
54	Side	Y	char	Допустимые значения: 1 – Buy 2 – Sell
38	OrderQty	Y	Qty	Объем ордера в базовой валюте или контрактах
231	ContractMultiplier	N	Float	Размер контракта
40	OrdType	Y	char	Допустимые значения: 1 – Market 2 – Limit 3 – Stop
44	Price	Y	Price	Цена срабатывания ордера. Для Market-ордера (тэг 40 = 1) игнорируется.
32	LastQty	C	Qty	Объем последней сделки, если ExecType = Trade or Fill or PartialFill
31	LastPx	C	Qty	Цена последней сделки, если ExecType = Trade or Fill or PartialFill
151	LeavesQty	Y	Qty	Количество, доступное для последующего исполнения. Если OrdStatus = Canceled, Expired, или Rejected (в таком случае ордер более не является активным), то LeavesQty может быть равным 0, в противном случае LeavesQty = OrderQty -

				CumQty
14	CumQty	Y	Qty	Исполненный в настоящий момент объем
6	AvgPx	Y	Price	Средняя цена исполнения.
59	TimeInForce	Y	Char	Допустимые значения: 1 – Good Till Cancel (GTC) 3 – Immediate or Cancel (IOC) 101 – Good Till Time 102 – Good During Time
126	ExpireTime	C	UTC Time stamp	Время жизни ордера. Требуется при TimeInForce = 101 или 102
21	HandlInst	N	char	Допустимые значения: 1 – Automated Execution Order Private 2 – Automated Execution Order Public
210	MaxShow	N	Qty	Если отсутствует, то MaxShow = OrderQty
11030	RefPrice	N	Price	Справочная цена
64	SettlDate	C		Дата валютирования. Присутствует если ExecType = Trade или Fill или PartialFill
584	MassStatusReqID	C	String	Требуется в случае ответа на Order Mass Status Request. Возвращает значение, заданное инициатором запроса.
58	Text	N		
75	TradeDate	N	Local Mkt Date	Дата сделки
60	TransactTime	N	UTC Time stamp	Время сделки
11033	BaseCcy	C	String	Базовая валюта последней сделки
11034	BaseQty	C	Qty	Объем базовой валюты последней сделки
11035	TermCcy	C	String	Контрвалюта последней сделки
11036	TermQty	C	Qty	Объем контрвалюты последней сделки
Standart Trailer		Y		

*Значение «2 – Fill» будет поддерживаться, в случае, если это необходимо.

Order Cancel/Replace Request

Tag	Field Name	Req'd	Type	Описание
Standart Header		Y		MsgType = G
11	ClOrdID	Y	String	Уникальный идентификатор запроса и нового (заменяющего ордера) ордера.
41	OrigClOrdID	Y	String	Идентификатор (ClOrdID) заменяемого ордера.
55	Symbol	Y	String	Требуется FIX, но не используется.
54	Side	Y	char	Требуется FIX, но не используется.
60	TransactTime	Y	UTCTimestamp	Время создания запроса на ордер трейдером или торговой системой

38	OrderQty	Y	Qty	Новый объем ордера (OrderQty). Должен быть не меньше уже исполненного объема (CumQty из ExecutionReport)
40	OrdType	Y	char	Требуется FIX, но не используется.
44	Price	Y	Price	Новая цена ордера
210	MaxShow	N	Qty	Новый видимый объем Если отсутствует, то MaxShow = OrderQty.
11030	RefPrice	N	Price	Справочная цена
Standart Trailer		Y		

Order Cancel Request

Tag	Field Name	Req'd	Type	Описание
Standart Header		Y		MsgType = F
11	ClOrdID	Y	String	Уникальный идентификатор запроса.
41	OrigClOrdID	Y	String	Идентификатор (ClOrdID) отменяемого ордера.
55	Symbol	Y	String	Требуется FIX, но не используется.
54	Side	Y	char	Требуется FIX, но не используется.
60	TransactTime	Y	UTCTimestamp	Время создания запроса на ордер трейдером или торговой системой
38	OrderQty	Y	Qty	Требуется FIX, но не используется.
Standart Trailer		Y		

Order Cancel Reject

Tag	Field Name	Req'd	Type	Описание
Standart Header		Y		MsgType = 9
37	OrderID	Y	String	Если CxlRejReason="Unknown order", OrderID = "NONE"
11	ClOrdID	Y	String	Уникальный идентификатор запроса.
41	OrigClOrdID	Y	String	Идентификатор (ClOrdID) изменяемого/отменяемого ордера.
39	OrdStatus	Y	String	Статус ордера
434	CxlRejResponseTo	Y	char	Определяет тип запроса, ответом на который является Cancel Reject. Допустимые значения: 1 = Order Cancel Request 2 = Order Cancel/Replace Request
103	OrdRejReason	N	int	
58	Text	N	String	
Standart Trailer		Y		

7 Приложение 1

User-defined fields

Tag	Field Name	Type	Описание
11001	BasePoint	Price	Размер пункта. Например: 0.0001 для EUR/USD
11002	RatePrecision	Price	Точность цены. Например: 0.00001 для EUR/USD
11003	MinReqQty	Qty	Минимальный объем выставляемого ордера. Если данное поле отсутствует, ограничения нет.
11004	MaxReqQty	Qty	Максимальный объем выставляемого ордера. Если данное поле отсутствует, ограничения нет.
11005	StepReqQty	Qty	Минимальный шаг изменения объема ордера. Например: если StepReqQty = 10000, то OrderQty = 100000 и OrderQty = 110000 – правильные объемы, а OrderQty = 105000 – неправильный. Если данное поле отсутствует, ограничения нет.
11010	MarketDataType	int	Тип котировок
11020	CAList	String	Список доступных контрагентов. Имена контрагентов разделяются символом «;» Пример 1: Alfabank Пример 2: Hotspot;Currenex;FXAll
11021	StreamID	String	ID потока (только для multi-stream pricing)
11030	RefPrice	Price	Справочная цена

Ограничения:

- длина строковых идентификаторов должна быть не более 32 символов